



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۶/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۴,۳۵۴,۶۷۲	۳۰,۰۵۱,۲۱۶,۳۳۷	۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۱	۲,۹۳۲,۳۸۳	۲۵,۶۰۷,۱۱۲,۳۶۵	(۱,۲۴۴,۳۵۱)	۱۱,۴۰۰,۴۵۲,۷۷۵	۶,۰۴۲,۷۰۴	۷,۹۹۸	۴۶,۸۲۴,۹۵۱,۲۱۶	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱
جمع	۴,۳۵۴,۶۷۲	۳۰,۰۵۱,۲۱۶,۳۳۷	۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۱	۲,۹۳۲,۳۸۳	۲۵,۶۰۷,۱۱۲,۳۶۵	(۱,۲۴۴,۳۵۱)	۱۱,۴۰۰,۴۵۲,۷۷۵	۶,۰۴۲,۷۰۴		۴۶,۸۲۴,۹۵۱,۲۱۶	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱
											درصد به کل دارایی‌های صندوق ۷۴.۵۳٪
											۷۴.۵۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

اطلاعات آماری مرتبط با اوراق اختیار فروش تبعی خریداری شده توسط صندوق سرمایه‌گذاری:

۱۳۹۸/۰۷/۳۰				۱۳۹۸/۰۶/۳۱				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۲-۱- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار یا درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۶/۳۱				۱۳۹۸/۰۷/۳۰			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی های صندوق			
										تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

(بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه‌گذاری)

۱۳۹۸/۰۷/۳۰

نام شرکت	تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل
----------	-------	-------------	------------------	------------	-------------------------	-------

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۷/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۶/۳۱		سپرده		
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب
۰.۰۰٪	۲۰۰,۰۰۰	۱۹,۵۴۰,۳۸۳,۰۱۹	۱۲,۰۶۶,۳۸۴,۳۹۸	۷,۴۷۴,۱۹۸,۶۲۱	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳
۱۳.۵۵٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹
۱۰.۸۴٪	۷,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۷,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶
۲۴.۳۸٪	۱۵,۷۵۰,۲۰۰,۰۰۰	۱۹,۵۴۰,۳۸۳,۰۱۹	۱۹,۰۶۶,۳۸۴,۳۹۸	۱۶,۲۲۴,۱۹۸,۶۲۱				
جمع								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۷/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۶/۳۱			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
درصد به کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	(۳,۸۰۴,۴۳۰,۵۵۸)	۱۰۳.۹۷٪	(۵.۸۹٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۱۴۵,۰۳۵,۷۲۴	(۳.۹۶٪)	۰.۲۲٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	(۰.۰۰٪)	۰.۰۰٪
جمع		(۳,۶۵۹,۲۹۱,۸۲۴)		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۱-۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۷/۳۰					از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۰	(۶,۲۱۱,۶۱۴,۵۶۷)	۲,۴۰۷,۱۸۴,۰۰۹	(۳,۸۰۴,۴۳۰,۵۵۸)	۱	۶۹۲,۱۴۰,۱۹۸	۸۳۲,۰۲۸,۷۱۴	۶,۷۰۷,۱۷۰,۸۲۲	۸,۲۳۱,۳۳۹,۷۳۴	۱۰۰.۳۷٪
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۰.۳۷٪)
جمع	۰	(۶,۲۱۱,۶۱۴,۵۶۷)	۲,۴۰۷,۱۸۴,۰۰۹	(۳,۸۰۴,۴۳۰,۵۵۸)	۱۰۰.۰۰٪	۶۹۲,۱۴۰,۱۹۸	۸۳۲,۰۲۸,۷۱۴	۶,۶۷۷,۱۹۳,۹۳۳	۸,۲۰۱,۳۶۲,۸۴۵	۱۰۰.۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۱-۱-۲- درآمد سود سهام

نام شرکت	اطلاعات مجمع			تغییرات طی دوره			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		
	تاریخ مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۲۶,۳۵۲,۴۸۲	۶۹۲,۱۴۰,۱۹۸
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۲۶,۳۵۲,۴۸۲	۶۹۲,۱۴۰,۱۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۲-۱-۲- درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰				نام شرکت
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
۸۳۲,۰۲۸,۷۱۴	۴۷,۳۰۴,۶۸۲,۹۸۷	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۶,۰۴۲,۷۰۴	(۶,۲۱۱,۶۱۴,۵۶۷)	۵۴,۳۴۸,۳۲۶,۲۶۹	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۶,۰۴۲,۷۰۴	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۸۳۲,۰۲۸,۷۱۴	۴۷,۳۰۴,۶۸۲,۹۸۷	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۶,۰۴۲,۷۰۴	(۶,۲۱۱,۶۱۴,۵۶۷)	۵۴,۳۴۸,۳۲۶,۲۶۹	۴۸,۱۳۶,۷۱۱,۷۰۱	۶,۰۴۲,۷۰۴	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۳-۱-۲- سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

نام شرکت	تغییرات طی دوره				از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۱,۲۴۴,۳۵۱	۱۱,۴۰۰,۴۵۲,۷۷۵	۸,۹۹۳,۲۶۸,۷۶۶	۲,۴۰۷,۱۸۴,۰۰۹	۷,۸۰۱,۱۴۳	۵۵,۱۸۵,۴۵۸,۱۵۴	۴۸,۴۷۸,۲۸۷,۳۳۲	۶,۷۰۷,۱۷۰,۸۲۲
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
جمع		۱۱,۴۰۰,۴۵۲,۷۷۵	۸,۹۹۳,۲۶۸,۷۶۶	۲,۴۰۷,۱۸۴,۰۰۹		۵۷,۵۲۶,۲۹۶,۱۱۴	۵۰,۸۴۹,۱۰۲,۱۸۱	۶,۶۷۷,۱۹۳,۹۳۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۳-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی		تغییرات طی دوره		از ابتدای سال مالی تا پایان دوره	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۵۰۸-۴۳	۰	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶		
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	۱۴۵,۰۳۴,۲۴۷	۵۷۲,۳۴۶,۰۵۰		
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	۰	۰		
جمع		۱۴۵,۰۳۴,۲۴۷	۷۴۲,۷۰۰,۹۴۶		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			مشخصات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	توضیحات
۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶	۰	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶	۰	۰	۰	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۵۷۲,۳۰۱,۷۳۵	۴۴,۳۱۵	۵۷۲,۳۴۶,۰۵۰	۱۴۵,۰۳۵,۷۲۴	(۱,۴۷۷)	۱۴۵,۰۳۴,۲۴۷	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۷۴۲,۶۵۶,۶۳۱	۴۴,۳۱۵	۷۴۲,۷۰۰,۹۴۶	۱۴۵,۰۳۵,۷۲۴	(۱,۴۷۷)	۱۴۵,۰۳۴,۲۴۷				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۷/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۰۷/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	سایر درآمدها برای تنزیل سود سهام
۰.۰۰٪	(۰.۰۰٪)	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰٪	(۰.۰۰٪)	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	جمع