



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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۱-سرمایه گذاری ها

۱-۱-سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۸/۱۰/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۹/۳۰			نام شرکت
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۵۶/۳۳٪	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۳۳,۱۲۴,۸۸۳,۰۲۹	۸,۶۴۳	۵,۳۵۴,۳۴۴	۳۰,۰۱۸,۳۹۳,۸۲۷	(۳,۹۰۷,۸۱۱)	۱۷,۴۹۳,۸۰۵,۰۱۹	۲,۳۸۹,۳۰۲	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۳۹,۱۵۳,۶۵۹,۹۷۲	۶,۸۷۲,۸۵۳	خانجات تولیدی شیشه رازی
۵۶/۳۳٪	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۳۳,۱۲۴,۸۸۳,۰۲۹		۵,۳۵۴,۳۴۴	۳۰,۰۱۸,۳۹۳,۸۲۷	(۳,۹۰۷,۸۱۱)	۱۷,۴۹۳,۸۰۵,۰۱۹	۲,۳۸۹,۳۰۲	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	۳۹,۱۵۳,۶۵۹,۹۷۲	۶,۸۷۲,۸۵۳	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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

۱۳۹۸/۱۰/۳۰				۱۳۹۸/۰۹/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۲- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰				
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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

۱۳۹۸/۱۰/۳۰						نام شرکت
تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۳-۱-سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۹/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۱۹/۵۴٪	۱۵,۹۹۴,۱۸۳,۵۱۲	۱۱,۸۱۵,۷۳۸,۰۶۵	۱۸,۴۴۸,۷۲۳,۵۰۳	۹,۳۶۱,۱۹۸,۰۷۴	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۰/۶۹٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۸/۷۶٪	۷,۱۷۳,۶۶۲,۳۲۰	۳۶۰,۰۰۰	۵۸,۴۸۰,۹۴۳	۷,۱۱۵,۵۴۱,۳۷۷	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰/۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۹/۰۰٪	۳۱,۹۱۷,۸۴۵,۸۳۲	۱۱,۸۱۶,۰۹۸,۰۶۵	۱۸,۵۰۷,۲۰۴,۴۴۶	۲۵,۲۲۶,۷۳۹,۴۵۱					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۴-۱- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۹/۳۰				۱۳۹۸/۱۰/۳۰			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۷,۶۱۹,۰۸۰,۵۳۷	۹۷/۴۱٪	۹/۳۱٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰/۰۰	۰/۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۰۲,۳۱۶,۵۵۹	۲/۵۹٪	۰/۲۵٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪
جمع		۷,۸۲۱,۵۰۰,۱۰۶		

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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

نام شرکت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰					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 شیشه رازی	۰	۱,۲۱۸,۷۷۲,۶۳۷	۶,۴۰۰,۳۰۷,۹۰۰	۷,۶۱۹,۰۸۰,۵۳۷	۱	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱۲,۸۵۱,۶۸۳,۱۱۰	۱۵,۱۲۸,۶۲۴,۶۶۷	۲۸,۶۹۸,۸۰۰,۴۵۷	۱۰۰/۱۰٪
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۰/۰۰	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۰/۱۰٪)
جمع	۰	۱,۲۱۸,۷۷۲,۶۳۷	۶,۴۰۰,۳۰۷,۹۰۰	۷,۶۱۹,۰۸۰,۵۳۷	۱۰۰/۰۰٪	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱۲,۸۵۱,۶۸۳,۱۱۰	۱۵,۰۹۸,۶۴۷,۷۷۸	۲۸,۶۶۸,۸۲۳,۵۶۸	۱۰۰/۰۰٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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
خانجات تولیدی شیشه رازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰				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	
۱۲,۸۵۱,۶۸۳,۱۱۰	۳۳,۲۴۱,۲۶۴,۴۷۷	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۵,۳۵۴,۳۴۴	۱,۲۱۸,۷۷۲,۶۳۷	۴۴,۸۷۴,۱۷۴,۹۵۰	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۵,۳۵۴,۳۴۴	رخانجات تولیدی شیشه رازی
۱۲,۸۵۱,۶۸۳,۱۱۰	۳۳,۲۴۱,۲۶۴,۴۷۷	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۵,۳۵۴,۳۴۴	۱,۲۱۸,۷۷۲,۶۳۷	۴۴,۸۷۴,۱۷۴,۹۵۰	۴۶,۰۹۲,۹۴۷,۵۸۷	۵,۳۵۴,۳۴۴	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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 شیشه رازی	۳,۹۰۷,۸۱۱	۳۰,۰۱۸,۳۹۳,۸۲۷	۲۳,۶۱۸,۰۸۵,۹۲۷	۶,۴۰۰,۳۰۷,۹۰۰	۱۶,۰۸۷,۶۷۵	۱۲۱,۵۶۴,۹۴۱,۳۳۰	۱۰۶,۴۳۶,۳۱۶,۶۶۳	۱۵,۱۲۸,۶۲۴,۶۶۷
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
جمع		۳۰,۰۱۸,۳۹۳,۸۲۷	۲۳,۶۱۸,۰۸۵,۹۲۷	۶,۴۰۰,۳۰۷,۹۰۰		۱۲۳,۹۰۵,۷۷۹,۲۹۰	۱۰۸,۸۰۷,۱۳۱,۵۱۲	۱۵,۰۹۸,۶۴۷,۷۷۸

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۲-۲ درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت درآمدها
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		تغییرات طی دوره		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
	۱۷۰,۳۵۴,۸۹۶		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۰۰۳,۸۵۲,۸۹۸		۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱۷۴,۰۲۲,۳۲۰		۵۸,۴۸۰,۹۴۳	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۰		۰	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱,۳۴۸,۲۳۰,۱۱۴		۲۰۲,۳۱۶,۵۵۹		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

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
۱,۰۰۳,۸۰۸,۵۸۳	۴۴,۳۱۵	۱,۰۰۳,۸۵۲,۸۹۸	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۰	۱۴۳,۸۳۵,۶۱۶	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۷۴,۰۲۲,۳۲۰	۰	۱۷۴,۰۲۲,۳۲۰	۵۸,۴۸۰,۹۴۳	۰	۵۸,۴۸۰,۹۴۳	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۳۴۸,۱۸۵,۷۹۹	۴۴,۳۱۵	۱,۳۴۸,۲۳۰,۱۱۴	۲۰۲,۳۱۶,۵۵۹	۰	۲۰۲,۳۱۶,۵۵۹				جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۰/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۱۰/۳۰ 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