



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۱۱/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱,۳۶۰,۰۰۰	۱۳,۹۰۶,۷۸۵,۴۱۷	۱۹,۴۶۷,۹۳۱,۷۷۹	۱,۱۶۹,۶۶۴	۱۵,۵۹۹,۷۳۷,۳۸۹	(۱,۱۱۸,۸۲۶)	۱۵,۳۱۷,۳۱۲,۵۶۴	۱,۴۱۰,۸۳۸	۱۶,۶۸۰,۱۱۷,۳۷۰	۱۹,۶۷۲,۹۲۲,۵۸۹	۱۵.۲۴٪
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۳,۵۲۱,۷۰۳	۲۸,۸۵۲,۵۰۳,۳۷۵	۴۲,۳۱۶,۳۰۶,۵۵۰	۳,۳۶۸,۷۶۲	۴۸,۵۰۲,۰۶۵,۲۳۵	(۳,۵۹۰,۵۳۵)	۵۲,۲۴۲,۳۲۷,۱۱۴	۳,۲۹۹,۹۳۰	۴۱,۰۸۷,۱۵۳,۶۴۱	۵۰,۵۳۰,۶۹۸,۶۵۶	۳۹.۱۴٪
بانک ملت	.	.	.	۱۹۶,۲۸۲	۱,۵۶۶,۳۳۷,۵۶۹	(۱۹۶,۲۸۲)	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰	.	.	.	۰.۰۰٪
جمع	۴,۸۸۱,۷۰۳	۴۲,۷۵۹,۲۸۸,۷۹۲	۶۱,۷۸۴,۲۳۸,۳۲۹	۴,۷۳۴,۷۰۸	۶۵,۶۶۸,۱۴۰,۱۹۳	(۴,۹۰۵,۶۴۳)	۶۹,۰۹۶,۱۳۳,۲۹۸	۴,۷۱۰,۷۶۸	۵۷,۷۶۷,۲۷۱,۰۱۱	۷۰,۲۰۳,۶۲۱,۲۴۵	۵۴.۳۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

۱۳۹۸/۱۲/۲۹				۱۳۹۸/۱۱/۳۰				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 ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

اطلاعات اوراق بهادار یا درآمد ثابت														تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			
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 پورتهفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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)

۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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 ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۱/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۲۷.۴۹٪	۳۵,۴۹۶,۶۲۶,۳۲۳	۳۷,۸۸۲,۸۳۳,۳۵۴	۳۲,۹۶۷,۲۶۵,۳۴۷	۴۰,۴۱۲,۱۹۴,۳۳۰	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۶.۷۸٪	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده بلند مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۰.۲۱٪	۲۶۶,۱۵۵,۵۷۲	۱۲,۰۳۸,۹۶۲,۲۸۵	۵,۱۷۳,۵۵۵,۵۶۳	۷,۱۳۱,۵۶۲,۲۹۴	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۸٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۰۳۸,۹۶۲,۲۸۵	۱۲,۰۳۸,۹۶۲,۲۸۵	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۴.۵۵٪	۴۴,۶۱۲,۷۸۱,۸۹۵	۶۱,۹۶۰,۷۵۷,۹۲۴	۵۰,۱۷۹,۷۸۳,۱۹۵	۵۶,۳۹۳,۷۵۶,۶۲۴					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۲/۲۹				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۱/۳۰			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 ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۸/۱۲/۲۹	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۱۱,۸۷۷,۲۲۹,۹۷۱	۹۴.۲۲٪	۹.۲۰٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۷۲۸,۴۰۱,۰۴۶	۵.۷۸٪	۰.۵۶٪
سایر درآمدها	۲-۴	۱۰۳,۰۱۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
جمع		۱۲,۶۰۵,۷۳۴,۰۲۷		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۳۹۸/۱۲/۲۹					نام شرکت
درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۹۱.۱۱٪	۵۶,۵۲۶,۲۰۷,۶۱۹	۴۶,۳۷۶,۳۷۷,۵۵۷	۹,۴۳۱,۳۳۷,۳۸۲	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱.۰۰۷	۱۱,۹۵۴,۶۶۳,۹۸۵	۱۵,۹۴۷,۵۰۶,۰۷۳	(۳,۹۹۲,۸۴۲,۰۸۸)	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۰.۰۰	.	.	.	.	۰.۰۰۰	.	.	.	۰	بانک ملت
۸.۹۴٪	۵,۵۴۵,۴۶۶,۸۴۸	۲,۵۵۲,۶۶۱,۶۲۹	۲,۹۹۲,۸۰۵,۲۱۹	.	(۰.۰۷)	(۷۷,۴۳۴,۰۱۴)	۲,۴۹۰,۹۰۷,۱۲۸	(۲,۵۶۸,۳۴۱,۱۴۲)	۰	مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۰.۰۵٪)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	.	.	۰.۰۰	.	.	.	۰	تولید نیروی برق دماوند
۱۰۰.۰۰٪	۶۲,۰۴۱,۶۹۷,۵۷۸	۴۸,۸۹۹,۰۶۲,۲۹۷	۱۲,۴۲۴,۱۴۲,۶۰۱	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱۰۰.۰۰٪	۱۱,۸۷۷,۲۲۹,۹۷۱	۱۸,۴۳۸,۴۱۳,۲۰۱	(۶,۵۶۱,۱۸۳,۲۳۰)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۱۳۹۸/۰۴/۱۲	۳,۹۹۱,۶۲۶	۱۸۰	-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰
جمع				-	-	-	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				طی ماه				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	
۹,۴۳۱,۳۳۷,۳۸۲	۴۱,۰۹۹,۳۶۱,۲۷۳	۵۰,۵۳۰,۶۹۸,۶۵۵	۳,۲۹۹,۹۳۰	(۳,۹۹۲,۸۴۲,۰۸۸)	۵۴,۵۲۳,۵۴۰,۷۴۴	۵۰,۵۳۰,۶۹۸,۶۵۵	۳,۲۹۹,۹۳۰	کارخانجات تولیدی شیشه رازی
۳,۹۹۲,۸۰۵,۲۱۹	۱۶,۶۸۰,۱۱۷,۳۷۰	۱۹,۶۷۲,۹۲۲,۵۸۹	۱,۴۱۰,۸۳۸	(۲,۵۶۸,۳۴۱,۱۴۲)	۲۲,۲۴۱,۲۶۳,۷۳۲	۱۹,۶۷۲,۹۲۲,۵۸۹	۱,۴۱۰,۸۳۸	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۱۲,۴۲۴,۱۴۲,۶۰۱	۵۷,۷۷۹,۴۷۸,۶۴۳	۷۰,۲۰۳,۶۲۱,۲۴۴		(۶,۵۶۱,۱۸۳,۲۳۰)	۷۶,۷۶۴,۸۰۴,۴۷۶	۷۰,۲۰۳,۶۲۱,۲۴۴		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش
کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی	۳,۵۹۰,۵۳۵	۵۲,۲۴۲,۳۳۷,۱۱۴	۳۶,۲۹۴,۸۳۱,۰۴۱	۱۵,۹۴۷,۵۰۶,۰۷۳	۲۴,۴۸۰,۵۱۴	۲۲۳,۲۰۰,۵۸۵,۸۷۷
بانک ملت	۱۹۶,۲۸۲	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰	۱,۵۶۶,۳۳۷,۵۶۹	۰	۱۹۶,۲۸۲	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱,۱۱۸,۸۲۶	۱۵,۳۱۷,۳۱۲,۵۶۴	۱۲,۸۲۶,۴۰۵,۴۳۶	۲,۴۹۰,۹۰۷,۱۲۸	۱,۱۳۳,۸۲۶	۱۵,۵۳۲,۴۵۰,۷۳۱
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰
جمع	۶۹,۰۹۶,۱۳۳,۲۹۸	۵۰,۶۸۷,۵۷۴,۰۴۶	۱۸,۴۳۸,۴۱۳,۲۰۱	۲۴۲,۶۱۰,۳۵۸,۱۸۸	۱۹۳,۷۴۱,۱۴۹,۸۴۰	۴۸,۸۹۹,۰۶۲,۲۹۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹				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 ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	۵۸۶,۱۰۶,۱۶۶	۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵		
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	۱۴۰,۲۳۹,۷۲۶	۱,۲۸۷,۹۲۸,۲۴۰		
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	۲,۰۹۷,۹۹۲	۲۳۴,۲۵۸,۰۴۸		
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۳۳۷۵۸	۰	۰		
جمع		۷۲۸,۴۴۳,۸۸۴	۲,۲۸۶,۸۴۲,۰۵۳		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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
۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵	۰	۷۶۴,۶۵۵,۷۶۵	۵۸۶,۱۰۶,۱۶۶	۰	۵۸۶,۱۰۶,۱۶۶	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۲۸۷,۹۲۶,۷۶۳	۱,۴۷۷	۱,۲۸۷,۹۲۸,۲۴۰	۱۴۰,۱۹۶,۸۸۸	(۴۲,۸۳۸)	۱۴۰,۲۳۹,۷۲۶	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۳۴,۲۵۸,۰۴۸	۰	۲۳۴,۲۵۸,۰۴۸	۲,۰۹۷,۹۹۲	۰	۲,۰۹۷,۹۹۲	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۲,۲۸۶,۸۴۰,۵۷۶	۱,۴۷۷	۲,۲۸۶,۸۴۲,۰۵۳	۷۲۸,۴۰۱,۰۴۶	(۴۲,۸۳۸)	۷۲۸,۴۴۳,۸۸۴				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۸/۱۲/۲۹ 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