



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش افشای پرتفوی ماهانه
برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۱/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱			
	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	۱,۲۰۸,۳۳۸	۱۴,۳۳۱,۳۲۹,۱۰۷	۲۳,۷۶۹,۴۵۵,۴۴۵	۳۵۰,۳۰۳	۷,۳۸۲,۶۵۰,۳۶۱	(۴۱,۰۰۰)	۸۵۰,۸۵۶,۴۸۹	۱,۵۱۷,۶۴۱	۲۱,۲۰۱,۱۰۷,۹۶۶	۳۲,۰۱۸,۴۰۶,۴۴۲	۲۰.۴۹%
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۲,۵۰۹,۳۰۵	۴۰,۱۶۸,۴۱۸,۵۲۵	۴۳,۲۹۰,۲۵۱,۸۵۴	۳,۸۵۷,۲۹۱	۷۴,۹۰۵,۳۰۷,۳۰۰	(۴,۳۷۲,۷۲۷)	۸۶,۷۰۲,۲۱۴,۴۴۱	۱,۹۹۳,۸۶۹	۳۸,۲۵۵,۶۴۷,۱۷۹	۴۱,۵۸۱,۰۵۶,۰۸۲	۲۶.۶۱%
جمع		۵۴,۴۹۹,۷۴۷,۶۳۲	۶۷,۰۵۹,۷۰۷,۲۹۹		۸۳,۸۵۴,۲۹۵,۲۳۰	(۴,۶۱۰,۰۰۹)	۸۹,۰۸۹,۵۵۴,۵۵۰		۵۹,۴۵۶,۷۵۵,۱۴۵	۷۳,۵۹۹,۴۶۲,۵۲۴	۴۷.۱۰%

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				۱۳۹۹/۰۱/۳۱				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 پورتنوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										۱۳۹۹/۰۱/۳۱			تغییرات طی دوره			۱۳۹۹/۰۲/۳۱		
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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۱/۳۱		سپرده			
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۳۶.۱۸٪	۵۶,۵۲۷,۱۷۱,۱۱۲	۵۷,۱۶۳,۱۹۱,۷۱۰	۵۵,۱۲۵,۲۶۹,۸۱۷	۵۸,۵۶۵,۰۹۳,۰۰۵	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۵.۶۰٪	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
۱.۸۲٪	۲,۸۴۰,۵۲۷,۲۹۲	۷,۰۱۳,۸۱۷,۸۸۵	۱,۶۳۱,۵۶۳,۴۵۱	۸,۲۲۲,۷۸۱,۷۲۶	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۶٪	۹۹,۹۴۰,۰۰۰	۷,۰۱۸,۹۴۷,۵۳۷	۷,۰۱۳,۶۶۷,۸۸۵	۱۰۵,۲۱۹,۶۵۲	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۳.۶۶٪	۶۸,۲۱۷,۶۳۸,۴۰۴	۷۱,۱۹۵,۹۵۷,۱۳۲	۶۳,۷۷۰,۵۰۱,۱۵۳	۷۵,۶۴۳,۰۹۴,۳۸۳					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده
								مبلغ فروش	تعداد		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	۱۱,۸۰۴,۸۶۸,۴۹۴	۹۸.۴۴٪	۷.۵۵٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۱۸۶,۷۷۲,۲۵۶	۱.۵۶٪	۰.۱۲٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع		۱۱,۹۹۱,۶۴۰,۷۵۰		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۲/۳۱					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 شیشه‌رازی	۰	۲۰۵,۸۴۴,۵۸۵	۹,۸۸۱,۸۶۶,۷۸۳	۱۰,۰۸۷,۷۱۱,۳۶۸	۸۵.۴۵٪	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۳,۳۲۵,۰۷۷,۰۶۰	۷۰,۱۳۶,۰۴۸,۲۶۹	۷۴,۱۷۹,۶۱۸,۰۰۹	۸۳.۳۹٪
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۰	۱,۳۷۹,۱۷۲,۱۳۹	۳۳۷,۹۸۴,۹۸۷	۱,۷۱۷,۱۵۷,۱۲۶	۱۴.۵۵٪	۰	۱۰,۸۱۷,۲۹۸,۴۷۶	۳,۹۸۴,۴۰۰,۳۲۹	۱۴,۸۰۱,۶۹۸,۸۰۵	۱۶.۶۴٪
بانک ملت	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰٪
تولید نیروی برق دماوند	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)	-۰.۰۳٪
جمع	۰	۱,۵۸۵,۰۱۶,۷۲۴	۱۰,۲۱۹,۸۵۱,۷۷۰	۱۱,۸۰۴,۸۶۸,۴۹۴	۱۰۰.۰۰٪	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۱۴,۱۴۲,۳۷۵,۵۳۶	۷۴,۰۹۰,۴۷۱,۷۰۹	۸۸,۹۵۱,۳۳۹,۹۲۵	۱۰۰.۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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 شیشه‌رازی	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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۲-۱-۲- در آمد 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	
۳,۳۲۵,۰۷۷,۰۶۰	۳۸,۲۵۵,۹۷۹,۰۲۱	۴۱,۵۸۱,۰۵۶,۰۸۱	۱,۹۹۳,۸۶۹	۲۰۵,۸۴۴,۵۸۵	۴۱,۳۷۵,۳۱۱,۴۹۶	۴۱,۵۸۱,۰۵۶,۰۸۱	۱,۹۹۳,۸۶۹	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۱۰,۸۱۷,۲۹۸,۴۷۶	۲۱,۲۰۱,۱۰۷,۹۶۶	۳۲,۰۱۸,۴۰۶,۴۴۲	۱,۵۱۷,۶۴۱	۱,۳۷۹,۱۷۲,۱۳۹	۳۰,۶۳۹,۲۳۴,۳۰۳	۳۲,۰۱۸,۴۰۶,۴۴۲	۱,۵۱۷,۶۴۱	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۱۴,۱۴۲,۳۷۵,۵۳۶	۵۹,۴۵۷,۰۸۶,۹۸۷	۷۳,۵۹۹,۴۶۲,۵۲۳		۱,۵۸۵,۰۱۶,۷۲۴	۷۲,۰۱۴,۴۴۵,۷۹۹	۷۳,۵۹۹,۴۶۲,۵۲۳		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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 شیشه‌رازی	۴,۳۷۲,۷۲۷	۸۶,۷۰۲,۲۱۴,۴۴۱	۷۶,۸۲۰,۳۴۷,۶۵۸	۹,۸۸۱,۸۶۶,۷۸۳	۳۲,۸۹۶,۰۲۷	۳۸۰,۶۵۱,۶۶۶,۱۷۹	۳۱۰,۵۱۵,۶۱۷,۹۱۰	۷۰,۱۳۶,۰۴۸,۲۶۹
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۴۱,۰۰۰	۸۵۰,۸۵۶,۴۸۹	۵۱۲,۸۷۱,۵۰۲	۳۳۷,۹۸۴,۹۸۷	۱,۳۹۲,۳۲۶	۲۰,۰۵۳,۹۵۱,۲۰۰	۱۶,۰۶۹,۵۵۰,۸۷۱	۳,۹۸۴,۴۰۰,۳۲۹
بانک ملت	.	.	.	.	۱۹۶,۲۸۲	۱,۵۳۶,۴۸۳,۶۲۰	۱,۵۶۶,۳۳۷,۵۶۹	.
تولید نیروی برق دماوند	.	.	.	.	۵۰,۰۰۰	۲,۳۴۰,۸۳۷,۹۶۰	۲,۳۷۰,۸۱۴,۸۴۹	(۲۹,۹۷۶,۸۸۹)
جمع		۸۷,۵۵۳,۰۷۰,۹۳۰	۷۷,۳۳۳,۲۱۹,۱۶۰	۱۰,۲۱۹,۸۵۱,۷۷۰		۴۰۴,۵۸۲,۹۳۸,۹۵۹	۳۳۰,۵۲۲,۳۲۱,۱۹۹	۷۴,۰۹۰,۴۷۱,۷۰۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱				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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۳-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری 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
	۷۸۳,۷۲۹,۲۴۲		۱۹,۰۷۳,۴۷۷	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۱,۵۸۲,۴۸۶,۶۷۸		۱۴۸,۵۸۱,۰۱۲	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
	۲۵۵,۶۳۰,۱۱۸		۱۹,۱۱۷,۷۴۷	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲,۶۲۱,۸۴۶,۰۳۸		۱۸۶,۷۷۲,۲۳۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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
۷۸۳,۷۲۹,۲۴۲	۰	۷۸۳,۷۲۹,۲۴۲	۱۹,۰۷۳,۴۷۷	۰	۱۹,۰۷۳,۴۷۷	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱,۵۸۲,۴۴۱,۱۳۶	۴۵,۵۴۲	۱,۵۸۲,۴۸۶,۶۷۸	۱۴۸,۵۸۱,۰۳۲	(۲۰)	۱۴۸,۵۸۱,۰۱۲	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۲۵۵,۶۳۰,۱۱۸	۰	۲۵۵,۶۳۰,۱۱۸	۱۹,۱۱۷,۷۴۷	۰	۱۹,۱۱۷,۷۴۷	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۲,۶۲۱,۸۰۰,۴۹۶	۴۵,۵۴۲	۲,۶۲۱,۸۴۶,۰۳۸	۱۸۶,۷۷۲,۲۵۶	(۲۰)	۱۸۶,۷۷۲,۲۳۶				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۳۹۹/۰۲/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰.۰۰	۱۰۳,۰۱۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	۱۰۳,۰۱۰	۰	جمع