



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ تیر ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

| نام شرکت                    | ۱۳۹۹/۰۳/۳۱     |                |                |                 | تغییرات طی دوره |                   |                   |                | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱     |                |                |                             |
|-----------------------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------------------|
|                             | تعداد          | بهای تمام شده  | خالص ارزش فروش | تعداد           | 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      |                |                |                |                             |
| سایپا دیزل                  | ۵۴۱            | ۳,۰۷۲,۶۳۷      | ۳,۳۵۲,۱۳۲      | ۱۸,۸۵۰,۰۰۰      | ۱۴۱,۴۳۵,۷۰۷,۱۴۳ | (۱۷,۵۰۰,۵۴۱)      | (۱۴۱,۳۶۰,۳۸۴,۷۴۶) | ۱,۳۵۰,۰۰۰      | ۹,۶۱۷          | ۱۱,۰۴۱,۳۸۸,۴۱۸ | ۱۲,۹۳۱,۱۴۸,۰۲۹ | ۵.۷۸٪                       |
| مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان | ۱,۷۱۲,۶۴۱      | ۲۵,۲۱۵,۸۵۰,۸۲۰ | ۳۳,۱۲۵,۰۷۷,۰۵۴ | ۳۱۵,۰۰۰         | ۵,۷۵۵,۰۳۱,۵۰۱   | (۵۸۶,۳۱۵)         | (۱۱,۴۹۶,۴۷۷,۲۰۰)  | ۱,۴۴۱,۳۲۶      | ۱۹,۶۶۰         | ۲۲,۱۶۵,۷۲۱,۷۵۱ | ۲۸,۲۲۳,۴۰۶,۶۴۸ | ۱۲.۶۳٪                      |
| کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی  | ۶۵۷,۵۴۱        | ۱۹,۵۳۲,۳۸۸,۹۳۸ | ۱۹,۹۴۲,۲۳۵,۱۷۷ | ۴,۳۰۰,۰۰۰       | ۱۲۹,۵۳۶,۷۷۰,۰۰۲ | (۳,۳۴۲,۴۸۳)       | (۱۰۲,۰۲۴,۴۵۱,۱۰۴) | ۱,۶۱۵,۰۵۸      | ۲۶,۸۶۰         | ۴۸,۴۵۲,۰۴۵,۱۲۶ | ۴۳,۲۰۷,۳۶۹,۸۵۳ | ۱۹.۳۳٪                      |
| جنرال مکانیک                | ۰              | ۰              | ۰              | ۶۵,۱۰۸          | ۲,۷۳۷,۱۰۰,۳۱۱   | (۶۵,۱۰۸)          | (۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶)   | ۰              | ۰              | ۰              | ۰              | ۰.۰۰٪                       |
| جمع                         | ۴۴,۷۵۱,۳۱۲,۳۹۵ | ۵۳,۰۷۰,۶۶۴,۳۶۴ | ۲۳,۵۳۰,۱۰۸     | ۲۷۹,۴۴۴,۶۰۸,۸۵۷ | (۲۱,۴۹۴,۴۴۷)    | (۲۵۷,۵۸۶,۸۹۳,۷۸۶) | ۳۷۹,۴۴۴,۶۰۸,۸۵۷   | ۸۱,۶۵۹,۱۵۵,۲۹۵ | ۸۴,۳۶۱,۹۲۴,۵۳۰ | ۳۷.۷۳٪         |                |                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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

| ۱۳۹۹/۰۴/۳۱ |             |            |                  | ۱۳۹۹/۰۳/۳۱ |             |            |                  | 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 ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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

| اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                      |                   |              |              |         |          |       |               |                | تغییرات طی دوره |               |       | ۱۳۹۹/۰۳/۳۱         |               |                | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱                  |  |  |
|------------------------------------|----------------------|-------------------|--------------|--------------|---------|----------|-------|---------------|----------------|-----------------|---------------|-------|--------------------|---------------|----------------|-----------------------------|--|--|
| 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 ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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 ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۰۴/۳۱           |                 | تغییرات طی دوره   |                 | ۱۳۹۹/۰۳/۳۱      |         |              |                 |                | سپرده                           |
|----------------------|-----------------|-------------------|-----------------|-----------------|---------|--------------|-----------------|----------------|---------------------------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ            | کاهش              | افزایش          | مبلغ            | نرخ سود | تاریخ افتتاح | نوع حساب        | شماره حساب     |                                 |
| ۲.۹۳٪                | ۶,۵۵۸,۹۳۰,۱۸۲   | (۶۲,۱۵۴,۱۴۷,۳۸۸)  | ۵۳۴,۶۷۳,۹۴۷     | ۶۸,۱۷۸,۴۰۳,۶۲۳  | ۰       | ۱۳۹۷/۰۶/۲۱   | سپرده کوتاه مدت | ۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳ | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۳.۹۱٪                | 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 |
| ۱.۱۹٪                | ۲,۶۶۹,۲۹۳,۸۸۰   | (۲,۹۸۶,۴۶۱,۸۷۹)   | ۵,۶۵۵,۲۲۴,۸۹۴   | ۵۳۰,۸۶۵         | ۰       | ۱۳۹۸/۰۷/۳۰   | سپرده کوتاه مدت | ۱۰۴۴۵۶۴۵۶      | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۰.۰۴٪                | ۹۹,۵۵۰,۹۲۷      | (۱۳۳,۰۶۱,۸۰۷,۳۵۲) | ۱۳۳,۰۶۱,۴۱۸,۲۷۹ | ۹۹,۹۴۰,۰۰۰      | ۰       | ۱۳۹۸/۰۹/۱۳   | حساب جاری       | ۱۰۴۳۳۷۵۸       | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۲۰.۲۰٪               | ۴۵,۱۶۲,۶۸۰,۷۴۳  | (۱۲۰,۴۴۱,۵۳۱,۱۹۴) | ۱۰۵,۸۹۲,۶۱۷,۹۶۱ | ۵۹,۷۱۱,۵۹۳,۹۷۶  | ۰       | ۱۳۹۹/۰۱/۲۵   | سپرده کوتاه مدت | ۱۰۴۴۵۶۶۲۶      | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۲۰.۱۵٪               | ۴۵,۰۵۲,۴۰۹,۹۶۶  | (۹,۶۳۳,۸۲۵,۲۰۶)   | ۵۴,۶۸۶,۲۳۵,۱۷۲  | ۰               |         | ۱۳۹۹/۰۳/۱۳   | سپرده کوتاه مدت | ۱۰۴۴۵۶۷۱۵      | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۴۸.۴۳٪               | ۱۰۸,۲۹۲,۸۶۵,۶۹۸ | (۳۲۸,۲۷۷,۷۷۳,۰۱۹) | ۲۹۹,۸۳۰,۱۷۰,۲۵۳ | ۱۳۶,۷۴۰,۴۶۸,۴۶۴ |         |              |                 |                | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

| اطلاعات اوراق گواهی سپرده               |              |         |          | تغییرات طی دوره   |       |               |                | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱  |               |             |           |
|-----------------------------------------|--------------|---------|----------|-------------------|-------|---------------|----------------|-------------|---------------|-------------|-----------|
| 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 | تعداد       | مبلغ فروش |

| 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 | تعداد       | مبلغ فروش |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

| شرح                                        | یادداشت | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱      | درصد از کل درآمدها | درصد به کل دارایی‌های صندوق |
|--------------------------------------------|---------|-----------------|--------------------|-----------------------------|
| سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام        | ۲-۱     | (۲,۳۹۴,۹۲۸,۱۶۰) | ۱۳۴.۰۵٪            | (۱.۰۷٪)                     |
| سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۲-۲     | ۰               | ۰.۰۰               | ۰.۰۰                        |
| درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده            | ۲-۳     | ۶۰۷,۴۳۲,۳۹۶     | (۳۴.۰۰٪)           | ۰.۲۷٪                       |
| سایر درآمدها                               | ۲-۴     | ۸۵۰,۶۶۹         | (۰.۰۵٪)            | ۰.۰۰٪                       |
| جمع                                        |         | (۱,۷۸۶,۶۴۵,۰۹۵) |                    |                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دوره |                 |                |                  |                | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱         |                 |                |                  |                | 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 |                              |
| .                                | .               | .              | .                | .              | .                  | .               | .              | .                | .              | جنرال مکانیک                 |
| ۲۰.۵۸۵٪                          | (۴,۹۲۹,۹۱۰,۰۴۸) | ۱,۰۰۰,۲۹۹,۵۲۱  | (۵,۲۴۷,۴۸۳,۷۴۳)  | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴    | ۲۰.۵۸۵٪            | (۴,۹۲۹,۹۱۰,۰۴۸) | ۱,۰۰۰,۲۹۹,۵۲۱  | (۵,۲۴۷,۴۸۳,۷۴۳)  | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴    | کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی   |
| (۲۶.۹۴٪)                         | ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷     | ۱۹۴,۵۵۳,۰۱۶    | ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷      | .              | (۲۶.۹۴٪)           | ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷     | ۱۹۴,۵۵۳,۰۱۶    | ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷      | .              | مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان |
| (۷۸.۹۱٪)                         | ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱   | ۱۰,۹۷۲,۶۱۳,۸۸۹ | ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱    | .              | (۷۸.۹۱٪)           | ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱   | ۱۰,۹۷۲,۶۱۳,۸۸۹ | ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱    | .              | سایپا دیزل                   |
| ۱۰۰٪                             | (۲,۳۹۴,۹۲۸,۱۶۰) | ۱۲,۱۶۷,۴۶۶,۴۲۶ | (۲,۷۱۲,۵۰۱,۸۵۵)  | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴    | ۱۰۰٪               | (۲,۳۹۴,۹۲۸,۱۶۰) | ۱۲,۱۶۷,۴۶۶,۴۲۶ | (۲,۷۱۲,۵۰۱,۸۵۵)  | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴    | جمع                          |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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               | هزینه تنزیل |
| کارخانجات تولیدی شیشه‌سازی | ۱۳۹۹/۰۴/۳۰   | ۱,۶۱۵,۰۵۸                      | ۲۰۰                 | ۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰        | (۵,۴۳۷,۹۰۶) | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴         | ۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰                      | (۵,۴۳۷,۹۰۶) |
| جمع                        |              |                                |                     | ۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰        | (۵,۴۳۷,۹۰۶) | ۳۱۷,۵۷۳,۶۹۴         | ۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰                      | (۵,۴۳۷,۹۰۶) |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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     |                              |
| ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷                      | ۲۷,۵۷۸,۱۸۴,۳۷۱ | ۲۸,۲۲۳,۴۰۶,۶۴۸ | ۱,۴۴۱,۳۲۶ | ۶۴۵,۲۲۲,۲۷۷                   | ۲۷,۵۷۸,۱۸۴,۳۷۱ | ۲۸,۲۲۳,۴۰۶,۶۴۸ | ۱,۴۴۱,۳۲۶ | مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان |
| ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱                    | ۱۱,۰۴۱,۳۸۸,۴۱۸ | ۱۲,۹۳۱,۱۴۸,۰۲۹ | ۱,۳۵۰,۰۰۰ | ۱,۸۸۹,۷۵۹,۶۱۱                 | ۱۱,۰۴۱,۳۸۸,۴۱۸ | ۱۲,۹۳۱,۱۴۸,۰۲۹ | ۱,۳۵۰,۰۰۰ | سایپا دیزل                   |
| (۵,۲۴۷,۴۸۳,۷۴۳)                  | ۴۸,۴۵۴,۸۵۳,۵۹۶ | ۴۳,۲۰۷,۳۶۹,۸۵۳ | ۱,۶۱۵,۰۵۸ | (۵,۲۴۷,۴۸۳,۷۴۳)               | ۴۸,۴۵۴,۸۵۳,۵۹۶ | ۴۳,۲۰۷,۳۶۹,۸۵۳ | ۱,۶۱۵,۰۵۸ | کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی   |
| (۲,۷۱۲,۵۰۱,۸۵۵)                  | ۸۷,۰۷۴,۴۲۶,۳۸۵ | ۸۴,۳۶۱,۹۲۴,۵۳۰ |           | (۲,۷۱۲,۵۰۱,۸۵۵)               | ۸۷,۰۷۴,۴۲۶,۳۸۵ | ۸۴,۳۶۱,۹۲۴,۵۳۰ |           | جمع                          |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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 |
| جنرال مکانیک                 | ۶۵,۱۰۸          | ۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶   | ۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶   | ۰                       | ۶۵,۱۰۸                           | ۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶   | ۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶   | ۰                       |
| مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان | ۵۸۶,۳۱۵         | ۱۱,۴۹۶,۴۷۷,۲۰۰  | ۱۱,۳۰۱,۹۲۴,۱۸۴  | ۱۹۴,۵۵۳,۰۱۶             | ۵۸۶,۳۱۵                          | ۱۱,۴۹۶,۴۷۷,۲۰۰  | ۱۱,۳۰۱,۹۲۴,۱۸۴  | ۱۹۴,۵۵۳,۰۱۶             |
| کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی   | ۳,۳۴۲,۴۸۳       | ۱۰۲,۰۲۴,۴۵۱,۱۰۴ | ۱۰۱,۰۲۴,۱۵۱,۵۸۳ | ۱,۰۰۰,۲۹۹,۵۲۱           | ۳,۳۴۲,۴۸۳                        | ۱۰۲,۰۲۴,۴۵۱,۱۰۴ | ۱۰۱,۰۲۴,۱۵۱,۵۸۳ | ۱,۰۰۰,۲۹۹,۵۲۱           |
| سایپا دیزل                   | ۱۷,۵۰۰,۵۴۱      | ۱۴۱,۳۶۰,۲۸۴,۷۴۶ | ۱۳۰,۳۸۷,۶۷۰,۸۵۷ | ۱۰,۹۷۲,۶۱۳,۸۸۹          | ۱۷,۵۰۰,۵۴۱                       | ۱۴۱,۳۶۰,۲۸۴,۷۴۶ | ۱۳۰,۳۸۷,۶۷۰,۸۵۷ | ۱۰,۹۷۲,۶۱۳,۸۸۹          |
| جمع                          |                 | ۲۵۷,۵۸۶,۸۹۳,۷۸۶ | ۲۴۵,۴۱۹,۴۲۷,۳۶۰ | ۱۲,۱۶۷,۴۶۶,۴۲۶          |                                  | ۲۵۷,۵۸۶,۸۹۳,۷۸۶ | ۲۴۵,۴۱۹,۴۲۷,۳۶۰ | ۱۲,۱۶۷,۴۶۶,۴۲۶          |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دوره |            |                  |                 | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱ |            |                  |                 | 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 ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۲-۳- 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                       |
|                                  | ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳                   |                           | ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳                   | ۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳  | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
|                                  | ۱۴۸,۱۷۸,۵۰۲                   |                           | ۱۴۸,۱۷۸,۵۰۲                   | ۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹   | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
|                                  | ۳,۳۸۸                         |                           | ۳,۳۸۸                         | ۱۰۴۴۵۶۶۲۶       | بانک تجارت تخصصی بورس           |
|                                  | ۷۲,۸۰۰,۶۰۳                    |                           | ۷۲,۸۰۰,۶۰۳                    | ۱۰۴۴۵۶۷۱۵       | بانک تجارت تخصصی بورس           |
|                                  | ۶۰۷,۴۳۲,۳۹۶                   |                           | ۶۰۷,۴۳۲,۳۹۶                   |                 | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

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                         |
| ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳                      | ۰           | ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳ | ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳     | ۰           | ۳۸۶,۴۴۹,۹۰۳ | ۰       |              | ۱                | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۱۴۸,۱۷۸,۵۰۲                      | (۴۵,۵۴۲)    | ۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴ | ۱۴۸,۱۷۸,۵۰۲     | (۴۵,۵۴۲)    | ۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴ | ۱۵      |              | ۱                | موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری |
| ۳,۳۸۸                            | ۰           | ۳,۳۸۸       | ۳,۳۸۸           | ۰           | ۳,۳۸۸       | ۰       |              | ۱۷               | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۷۲,۸۰۰,۶۰۳                       | ۰           | ۷۲,۸۰۰,۶۰۳  | ۷۲,۸۰۰,۶۰۳      | ۰           | ۷۲,۸۰۰,۶۰۳  | ۰       |              | ۱۷               | بانک تجارت تخصصی بورس           |
| ۶۰۷,۴۳۲,۳۹۶                      | (۴۵,۵۴۲)    | ۶۰۷,۴۷۷,۹۳۸ | ۶۰۷,۴۳۲,۳۹۶     | (۴۵,۵۴۲)    | ۶۰۷,۴۷۷,۹۳۸ |         |              |                  | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۴/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

| درصد به کل دارایی‌های صندوق | درصد از کل درآمدها | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱<br>مبلغ | طی دوره<br>مبلغ | سایر درآمدها                           |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|-----------------|----------------------------------------|
| ۰.۰۰٪                       | (۰.۰۵٪)            | ۸۰۵,۱۲۷            | ۸۰۵,۱۲۷         | سایر درآمدها                           |
| ۰.۰۰٪                       | (۰.۰۰٪)            | ۴۵,۵۴۲             | ۴۵,۵۴۲          | معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک |
| ۰.۰۰                        | ۰.۰۰               | ۰                  | ۰               | تعدیل کارمزد کارگزار                   |
| ۰.۰۰٪                       | (۰.۰۵٪)            | ۸۵۰,۶۶۹            | ۸۵۰,۶۶۹         | جمع                                    |