



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۵/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۶/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
سایپا دیزل	۱۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۵,۶۹۱,۷۴۹,۵۸۷	۹۶,۳۳۱,۸۴۴,۳۲۰	.	.	(۲,۸۰۰,۰۰۰)	۲۰,۸۶۹,۷۲۰,۹۶۹	۹,۲۰۰,۰۰۰	۸۸,۶۹۷,۰۰۸,۰۱۴	۶۲,۱۹۵,۳۳۷,۰۷۵
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۸۹۰,۸۲۶	۱۳,۹۵۷,۷۳۴,۶۶۶	۱۷,۴۸۳,۴۸۷,۱۱۶	۶۰,۰۰۰	۱,۰۹۰,۴۸۳,۳۲۷	(۱۶۰,۰۰۰)	۲,۷۰۷,۲۸۰,۷۰۸	۷۹۰,۸۲۶	۱۲,۵۱۷,۹۸۷,۸۳۶	۱۳,۳۴۲,۰۰۵,۹۹۲
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۴,۲۶۵,۰۵۸	۱۰۰,۵۸۹,۶۸۷,۴۱۸	۸۰,۲۲۴,۷۴۷,۰۵۱	۲,۹۲۱,۸۹۶	۵۵,۷۹۹,۲۳۲,۸۲۶	(۳,۰۰۰,۲۸۹)	۵۹,۱۵۱,۸۶۸,۳۴۶	۴,۱۸۶,۶۶۵	۸۸,۳۸۰,۹۰۶,۹۴۹	۷۳,۶۱۷,۰۳۲,۵۵۶
جمع		۲۳۰,۲۳۹,۱۷۱,۶۷۱	۱۹۳,۹۴۰,۰۷۸,۴۸۷	۲,۹۸۱,۸۹۶	۵۶,۸۸۹,۷۱۶,۱۵۳	(۵,۹۶۰,۲۸۹)	۸۲,۷۲۸,۸۷۰,۰۲۳		۱۸۹,۵۹۵,۹۰۲,۷۹۹	۱۴۹,۱۵۴,۲۷۵,۶۲۳
										۸۴,۴۰%
										۴۱,۶۶%
										۷,۵۵%
										۳۵,۱۹%

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۶/۳۱				۱۳۹۹/۰۵/۳۱				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 ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت												تغییرات طی دوره			۱۳۹۹/۰۵/۳۱			۱۳۹۹/۰۶/۳۱		
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 ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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 ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۶/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۵/۳۱					سپرده
درصد به کل	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
دارایی‌ها									
۰.۰۵٪	۸۰,۰۷۵,۱۹۳	(۶۹,۱۵۶,۷۲۱)	۱۴۸,۲۳۱,۹۱۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۴.۹۵٪	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
۹.۸۷٪	۱۷,۴۳۸,۲۶۰,۵۵۷	(۱,۳۸۵,۴۱۱,۸۹۵)	۲,۸۳۳,۴۷۵,۹۲۲	۱۵,۹۹۰,۱۹۶,۵۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۶٪	۹۹,۴۲۰,۹۲۷	(۳۳,۴۴۲,۳۴۲,۳۰۷)	۳۳,۴۴۲,۲۶۲,۳۰۷	۹۹,۵۰۰,۹۲۷	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۵۶۹,۳۹۰	۰	۴,۷۸۲	۵۶۴,۶۰۸	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۵۱٪	۹۰۰,۰۰۴,۲۷۱	(۳۲,۰۵۶,۸۵۰,۴۱۲)	۳۲,۹۵۶,۳۵۰,۴۴۸	۵۰۴,۲۳۵		۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۵.۴۳٪	۲۷,۲۶۸,۳۳۰,۳۳۷	(۶۶,۹۵۳,۷۶۱,۳۳۵)	۶۹,۳۸۰,۳۲۵,۳۷۲	۲۴,۸۴۱,۷۶۶,۳۰۰					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۶/۳۱			
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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۲-۱	(۱۸,۹۴۶,۶۴۸,۹۹۱)	۱۰۱.۴۷٪	(۱۰.۷۲٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۳	۲۷۴,۴۳۶,۱۸۰	(۱.۴۷٪)	۰.۱۶٪
سایر درآمدها	۲-۴	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع		(۱۸,۶۷۲,۲۱۲,۸۱۱)		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره						۱۳۹۹/۰۶/۳۱				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	
۲.۸۰٪	(۱,۳۲۱,۵۶۳,۴۸۶)	۴۵۱,۸۸۵,۴۵۵	(۱,۷۷۳,۴۴۸,۹۴۱)	۰	۱۳.۳۳٪	(۲,۵۲۴,۶۸۳,۷۴۲)	(۳۵۱,۸۴۴,۴۱۴)	(۲,۱۷۲,۸۳۹,۳۲۸)	۰	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۵۶.۴۶٪	(۳۶,۶۶۶,۳۹۵,۸۰۶)	(۱۲,۲۲۴,۹۳۹,۱۳۳)	(۱۴,۷۶۴,۴۶۸,۲۷۳)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۱۷.۱۸٪	(۳,۲۵۵,۰۷۸,۹۷۴)	(۸,۸۵۶,۹۶۳,۶۳۱)	۵,۶۰۱,۸۸۴,۶۵۷	۰	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
۴۰.۷۴٪	(۱۹,۲۳۸,۶۵۷,۹۶۳)	۷,۲۶۳,۱۱۲,۹۷۵	(۲۶,۵۰۱,۷۷۰,۹۳۸)	۰	۶۹.۴۹٪	(۱۳,۱۶۶,۸۸۶,۲۷۵)	(۶,۱۲۵,۰۲۰,۶۰۴)	(۷,۰۴۱,۸۶۵,۶۷۱)	۰	سایپا دیزل
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	جنرال مکانیک
(۰.۰۰٪)	۱۵۹,۱۸۷	۱۵۹,۱۸۷	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اصلاحی کارمزد
۱۰۰٪	(۴۷,۲۲۶,۴۵۸,۰۶۸)	(۴,۵۰۹,۷۸۱,۵۱۶)	(۴۳,۰۳۹,۶۸۸,۱۵۲)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۱۰۰٪	(۱۸,۹۴۶,۶۴۸,۹۹۱)	(۱۵,۳۳۳,۸۲۸,۶۴۹)	(۳,۶۱۲,۸۲۰,۳۴۲)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت درآمدها
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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 شیشه‌رازی	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	۱,۶۱۵,۰۵۸	۲۰۰	-	۰	-	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰
جمع				-	۰	-	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰
							۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	
(۱,۷۷۳,۴۴۸,۹۴۲)	۱۵,۱۱۵,۴۵۴,۹۲۳	۱۳,۳۴۲,۰۰۵,۹۹۱	۷۹۰,۸۲۶	(۲,۱۷۲,۸۳۹,۳۲۹)	۱۵,۵۱۴,۸۴۵,۳۲۰	۱۳,۳۴۲,۰۰۵,۹۹۱	۷۹۰,۸۲۶	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۲۶,۵۰۱,۷۷۰,۹۳۹)	۸۸,۶۹۷,۰۰۸,۰۱۴	۶۲,۱۹۵,۲۳۷,۰۷۵	۹,۲۰۰,۰۰۰	(۷,۰۴۱,۸۶۵,۶۷۲)	۶۹,۲۳۷,۱۰۲,۷۴۷	۶۲,۱۹۵,۲۳۷,۰۷۵	۹,۲۰۰,۰۰۰	سایپا دیزل
(۱۴,۷۶۴,۴۶۸,۲۷۴)	۸۸,۳۸۱,۵۰۰,۸۳۰	۷۳,۶۱۷,۰۳۲,۵۵۶	۴,۱۸۶,۶۶۵	۵,۶۰۱,۸۸۴,۶۵۷	۶۸,۰۱۵,۱۴۷,۸۹۹	۷۳,۶۱۷,۰۳۲,۵۵۶	۴,۱۸۶,۶۶۵	کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی
(۴۳,۰۳۹,۶۸۸,۱۵۵)	۱۹۲,۱۹۳,۹۶۳,۷۷۷	۱۴۹,۱۵۴,۲۷۵,۶۲۲		(۳,۶۱۳,۸۳۰,۳۴۴)	۱۵۲,۷۶۷,۰۹۵,۹۶۶	۱۴۹,۱۵۴,۲۷۵,۶۲۲		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱۶۰,۰۰۰	۲,۷۰۷,۲۸۰,۷۰۸	۳,۰۵۹,۱۲۵,۱۲۲	(۳۵۱,۸۴۴,۴۱۴)	۱,۳۷۱,۸۱۵	۲۶,۷۹۰,۹۲۱,۷۱۵	۲۶,۳۳۹,۰۳۶,۳۶۰	۴۵۱,۸۸۵,۴۵۵
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۳,۰۰۰,۲۸۹	۵۹,۱۵۱,۸۶۸,۳۴۶	۶۸,۰۰۸,۸۳۱,۹۷۷	(۸,۸۵۶,۹۶۳,۶۳۱)	۸,۱۴۲,۷۷۲	۲۰۳,۹۸۱,۱۴۹,۸۶۴	۲۱۶,۲۰۶,۰۸۸,۹۹۷	(۱۲,۲۲۴,۹۳۹,۱۳۳)
سایپا دیزل	۲,۸۰۰,۰۰۰	۲۰,۸۶۹,۷۲۰,۹۶۹	۲۶,۹۹۴,۷۴۱,۵۷۳	(۶,۱۲۵,۰۲۰,۶۰۴)	۲۱,۶۵۰,۵۴۱	۱۷۵,۶۸۶,۹۱۳,۸۲۳	۱۶۸,۴۲۳,۸۰۰,۸۴۸	۷,۲۶۳,۱۱۲,۹۷۵
جنرال مکانیک	.	.	.	.	۶۵,۱۰۸	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	.
اصلاحی کارمزد	.	.	.	.				۱۵۹,۱۸۷
جمع		۸۲,۷۲۸,۸۷۰,۰۲۳	۹۸,۰۶۲,۶۹۸,۶۷۲	(۱۵,۳۳۳,۸۲۸,۶۴۹)		۴۰۹,۱۶۴,۶۶۶,۱۳۸	۴۱۳,۶۷۴,۶۰۶,۸۴۱	(۴,۵۰۹,۷۸۱,۵۱۶)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۳۹۹/۰۶/۳۱				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 ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۷,۸۶۹		۴۳۰,۹۰۰,۷۹۶	
موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴		۴۴۴,۶۷۲,۱۳۲	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	۱۲۶,۱۹۵,۲۱۴		۱۴۸,۸۰۳,۹۸۷	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۴,۷۸۲		۱۲,۹۱۲	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	۴,۲۷۱		۷۲,۸۰۹,۱۰۹	
جمع		۲۷۴,۴۳۶,۱۸۰		۱,۰۹۷,۱۹۸,۹۳۶	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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
۴۳۰,۹۰۰,۷۹۶	۰	۴۳۰,۹۰۰,۷۹۶	۷,۸۶۹	۰	۷,۸۶۹	۰		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۴۴۴,۶۲۶,۵۹۰	(۴۵,۵۴۲)	۴۴۴,۶۷۲,۱۳۲	۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴	۰	۱۴۸,۲۲۴,۰۴۴	۱۵		۱	موسسه مالی و اعتباری کوثر مطهری
۱۴۸,۸۰۳,۹۸۷	۰	۱۴۸,۸۰۳,۹۸۷	۱۲۶,۱۹۵,۲۱۴	۰	۱۲۶,۱۹۵,۲۱۴	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۲,۹۱۲	۰	۱۲,۹۱۲	۴,۷۸۲	۰	۴,۷۸۲	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۷۲,۸۰۹,۱۰۹	۰	۷۲,۸۰۹,۱۰۹	۴,۲۷۱	۰	۴,۲۷۱	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۰۹۷,۱۵۳,۳۹۴	(۴۵,۵۴۲)	۱,۰۹۷,۱۹۸,۹۳۶	۲۷۴,۴۳۶,۱۸۰	۰	۲۷۴,۴۳۶,۱۸۰				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

سایر درآمدها	طی دوره مبلغ	۱۳۹۹/۰۶/۳۱ مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سایر درآمدها	۰	۸۰۵,۱۲۷	۰.۰۰	۰.۰۰
معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک	۰	۴۵,۵۴۲	۰.۰۰	۰.۰۰
تعدیل کارمزد کارگزار	۰	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع	۰	۸۵۰,۶۶۹	۰.۰۰	۰.۰۰