



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ مردادماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت یرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۰۴/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۵/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی ماه		خرید طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	مبلغ فروش	بهای تمام شده	تعداد			
سایپا دیزل	۹۸۷,۰۳۷	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۰	۰	۰	۰	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۹۸۷,۰۳۷
جمع		۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۰	۰	۰	۰	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۹۸۷,۰۳۷
				تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش			
				۹۸۷,۰۳۷	۴,۲۲۶	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۵.۱۰٪		
										۵.۱۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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

۱۴۰۰/۰۵/۳۱				۱۴۰۰/۰۴/۳۱				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 آیان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت														
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تغییرات طی دوره				
										خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد
							تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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)

۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۵/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۴/۳۱			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
				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۵/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۴/۳۱					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۷۲.۹۹٪	۵۹,۶۹۴,۹۵۱,۲۲۳	۳,۷۵۰,۰۰۰	۵۰۲,۷۲۸,۴۶۷	۵۹,۱۹۵,۹۷۲,۷۵۶	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۱۲٪	۹۷,۴۵۰,۴۱۱	۷,۹۲۲,۰۰۰	۷,۵۰۰,۰۰۰	۹۷,۸۷۲,۴۱۱	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۰.۴۶٪	۱۶,۷۳۰,۳۶۹,۳۶۵	۳,۷۵۰,۰۰۰	۱۴۰,۸۹۶,۸۸۹	۱۶,۵۹۳,۲۲۲,۴۷۶	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۹۷٪	۷۹۶,۶۱۲,۸۰۲	۰	۶,۷۰۸,۷۷۴	۷۸۹,۹۰۴,۰۲۸	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۹۴.۵۴٪	۷۷,۳۱۹,۳۸۳,۸۰۱	۱۵,۴۲۲,۰۰۰	۶۵۷,۸۳۴,۱۳۰	۷۶,۶۷۶,۹۷۱,۶۷۱					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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
۱,۰۰۱,۲۵۴,۷۲۵	۰	۱,۰۰۱,۲۵۴,۷۲۵	۵۰۲,۷۲۸,۴۶۷	۰	۵۰۲,۷۲۸,۴۶۷	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۴۰,۹۶۳,۶۸۰	۰	۱۴۰,۹۶۳,۶۸۰	۱۴۰,۸۹۶,۸۸۹	۰	۱۴۰,۸۹۶,۸۸۹	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۳,۳۶۱,۰۴۹	۰	۱۳,۳۶۱,۰۴۹	۶,۷۰۸,۷۷۴	۰	۶,۷۰۸,۷۷۴	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۱۵۵,۵۷۹,۴۵۴	۰	۱,۱۵۵,۵۷۹,۴۵۴	۶۵۰,۳۳۴,۱۳۰	۰	۶۵۰,۳۳۴,۱۳۰				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۱-۱-۲- درآمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			اطلاعات مجمع			نام شرکت
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ مجمع	
*	*	*	*	*	*				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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	
۷۵۳,۷۲۹,۰۴۸	۳,۴۱۴,۳۱۹,۱۸۸	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۹۸۷,۰۳۷	(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۹۸۷,۰۳۷	سایپا دیزل
۷۵۳,۷۲۹,۰۴۸	۳,۴۱۴,۳۱۹,۱۸۸	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۹۸۷,۰۳۷	-۹۰,۷۳۸,۳۸۹	۴,۲۵۸,۷۸۶,۶۲۶	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۹۸۷,۰۳۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۳-۱-۲- سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				تغییرات طی دوره				نام شرکت
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
۵,۰۵۹,۸۸۲,۱۱۰	۳۸,۹۷۸,۹۷۳,۳۴۰	۴۴,۰۳۸,۸۵۵,۴۵۰	۱۲,۴۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	سایپا دیزل
۵,۰۵۹,۸۸۲,۱۱۰	۳۸,۹۷۸,۹۷۳,۳۴۰	۴۴,۰۳۸,۸۵۵,۴۵۰	۱۲,۴۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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

نام شرکت	طی ماه		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
سایپا دیزل	۰	(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	۰	(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	(۱۶.۲۱٪)	۰	۷۵۳,۷۲۹,۰۴۸	۵,۰۵۹,۸۸۲,۱۱۰	۵,۸۱۳,۶۱۱,۱۵۸	۸۳.۰۲٪
جمع	۰	(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	۰	(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	-۱۶.۲۱٪	۰	۷۵۳,۷۲۹,۰۴۸	۵,۰۵۹,۸۸۲,۱۱۰	۵,۸۱۳,۶۱۱,۱۵۸	۸۳.۰۲٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۵/۳۱				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 ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		طی ماه		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
	۱,۰۰۱,۲۵۴,۷۲۵		۵۰۲,۷۲۸,۴۶۷	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱۴۰,۹۶۳,۶۸۰		۱۴۰,۸۹۶,۸۸۹	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱۳,۳۶۱,۰۴۹		۶,۷۰۸,۷۷۴	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	<u>۱,۱۵۵,۵۷۹,۴۵۴</u>		<u>۶۵۰,۳۳۴,۱۳۰</u>		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۵/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
***	***	*	*	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۵/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۰۵/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۹۰,۷۳۸,۳۸۹)	(۱۶.۲۱٪)	(۰.۱۱٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی		۶۵۰,۳۳۴,۱۳۰	۱۱۶.۲۱٪	۰.۸۰٪
جمع		۵۵۹,۵۹۵,۷۴۱	۱۰۰٪	۰.۶۹٪