



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۴۰۱/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۲/۳۱			نام شرکت			
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه			خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۱۹.۸۸٪	۲۰.۸۱۸.۴۷۲.۸۳۹	۲۰.۱۷۰.۴۲۹.۴۶۸	۱۰.۳۴۴	۲۰.۱۲.۷۱۱	۲,۴۳۸,۰۹۲,۵۱۹	۲۳۸,۴۴۹-	۲۲,۵۵۹,۲۴۳,۲۲۹	۲,۲۵۱,۱۶۰	۰	۰	۰	صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت
۱۹.۸۸٪	۲۰.۸۱۸.۴۷۲.۸۳۹	۲۰.۱۷۰.۴۲۹.۴۶۸			۲,۴۳۸,۰۹۲,۵۱۹	(۲۳۸,۴۴۹)	۲۲,۵۵۹,۲۴۳,۲۲۹		۰	۰		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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

۱۴۰۱/۰۳/۳۱				۱۴۰۱/۰۲/۳۱				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 بر ترفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۲۱

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

۱۴۰۱/۰۲/۲۱		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۲/۲۱		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	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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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)

۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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 ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	تغییرات طی دوره		درصد به کل دارایی‌ها
					۱۴۰۱/۰۲/۳۱	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	
					افزایش	کاهش	مبلغ
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	۰	۵۰۸,۹۷۳,۱۱۸	۱۷۴,۳۵۸,۱۴۸	۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	۰	۳۲۷,۵۵۳,۸۵۱	۳۲۷,۵۸۶,۲۴۱	۱۰۱,۷۶۸,۳۳۰
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	۰	۱۳۸,۵۹۰,۱۳۴	۱۵۳,۲۵۵,۷۰۳	۱۶,۴۹۳,۲۷۲,۴۶۶
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	۰	۶۹,۶۶۲,۵۹۹,۲۵۳	۳,۴۴۵,۰۱۲,۸۷۳	۶۶,۲۱۷,۵۸۶,۳۸۰
جمع					۷۰,۶۳۷,۷۱۶,۳۵۶	۴,۱۰۰,۲۱۲,۹۶۵	۸۳,۸۱۲,۶۲۷,۱۷۶
					۶۰,۱۷۷,۴۸۰,۰۳۷		۸۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
					۱۰۱,۸۱۲,۵۷۰		۱۰۱,۷۶۸,۳۳۰
					۱۶,۴۷۱,۱۲۶,۳۱۵		۱۶,۴۹۳,۲۷۲,۴۶۶
					۰		۶۶,۲۱۷,۵۸۶,۳۸۰
					۷۶,۷۵۰,۴۱۸,۹۲۲		۸۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۱/۰۲/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۲/۳۱			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 درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	یادداشت	شرح
۳.۲۹٪	۲۸.۹۵٪	۲,۵۱۱,۲۲۳,۹۳۶		سرمایه‌گذاری در سهام
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰		سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار
۸.۰۷٪	۷۱.۰۵٪	۶,۱۶۱,۷۲۷,۸۷۹		درآمد سپرده بانکی
۱۱.۳۶٪	۱۰۰٪	۸,۶۷۲,۹۵۱,۸۱۵		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره						طی ماه				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	
۲۰.۶۳٪	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	سایپا دیزل
۷.۹۳٪	۶۹۷,۳۲۲,۱۲۹	۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۰	۸۳.۳۸٪	۶۹۷,۳۲۲,۱۲۹	۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۰	صندوق س. رشد پایدار-درآمد ثابت
۲۸.۵۵٪	۲,۵۱۱,۲۲۳,۹۳۶	۱,۸۶۳,۱۸۰,۵۶۵	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۰	۸۳.۳۸٪	۶۹۷,۳۲۲,۱۲۹	۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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	خالص درآمد سود سهام
جمع									

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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	
۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۲۰,۱۷۰,۴۲۹,۴۶۸	۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	۲,۰۱۲,۷۱۱	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۲۰,۱۷۰,۴۲۹,۴۶۸	۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	۲,۰۱۲,۷۱۱	صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت
۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۲۰,۱۷۰,۴۲۹,۴۶۸	۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	۲,۰۱۲,۷۱۱	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	۲۰,۱۷۰,۴۲۹,۴۶۸	۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	۲,۰۱۲,۷۱۱	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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	
۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱۶۱,۱۹۲,۶۰۱,۹۵۶	۱۶۳,۰۰۶,۵۰۳,۷۶۳	۴۵,۳۸۶,۵۶۳	سایپا دیزل
۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۲,۳۸۸,۸۱۳,۷۶۱	۲,۴۳۸,۰۹۲,۵۱۹	۲۳۸,۴۴۹	۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۲,۳۸۸,۸۱۳,۷۶۱	۲,۴۳۸,۰۹۲,۵۱۹	۲۳۸,۴۴۹	صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت
۱,۸۶۳,۱۸۰,۵۶۵	۱۶۳,۵۸۱,۴۱۵,۷۱۷	۱۶۵,۴۴۴,۵۹۶,۲۸۲	۴۵,۶۲۵,۰۱۲	۴۹,۲۷۸,۷۵۸	۲,۳۸۸,۸۱۳,۷۶۱	۲,۴۳۸,۰۹۲,۵۱۹	۲۳۸,۴۴۹	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۱/۰۳/۳۱			توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۲-۳- 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
	۵,۳۱۴,۴۵۵,۸۰۳		۰	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۸۰۰,۳۶۴,۰۶۰		۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴۶,۹۰۸,۰۱۶		۰	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	<u>۶,۱۶۱,۷۲۷,۸۷۹</u>		<u>۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸</u>		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

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
۵,۳۱۴,۴۵۵,۸۰۳	.	۵,۳۱۴,۴۵۵,۸۰۳		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۸۰۰,۳۶۴,۰۶۰	.	۸۰۰,۳۶۴,۰۶۰	۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸	.	۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸	.		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۶,۹۰۸,۰۱۶	.	۴۶,۹۰۸,۰۱۶		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۶,۱۶۱,۷۲۷,۸۷۹	.	۶,۱۶۱,۷۲۷,۸۷۹	۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸	.	۱۳۸,۹۰۰,۱۴۸				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۱/۰۳/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		۰	۰	سایر درآمدها
		۳۱۵,۱۹۹	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	۳۱۵,۱۹۹	۰	