



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

سرمایه‌گذاری‌ها - ۱

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام - ۱-۱

نام شرکت	۱۴۰۱/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۰/۳۰		درصد به کل دارایی‌های صندوق
	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	
			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده			
صندوق س. رشد پایدار-د	۸,۴۳۶,۳۴۹	۸۵,۴۰۸,۷۶۹,۹۵۱	-	۶۴۹,۹۵۲,۱۰۸,۵۵۳	۶۴,۵۲۹,۹۱۹	۶۶۱,۷۹۹,۳۸۴,۲۲۹	۶۵,۶۹۲,۶۸۱	۸۵,۸۱۹,۷۶۰,۰۱۵	۹۵.۵۷٪
جمع		۸۵,۴۰۸,۷۶۹,۹۵۱		۶۴۹,۹۵۲,۱۰۸,۵۵۳		۶۶۱,۷۹۹,۳۸۴,۲۲۹		۸۵,۸۱۹,۷۶۰,۰۱۵	۹۵.۵۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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

۱۴۰۱/۱۰/۳۰				۱۴۰۱/۰۹/۳۰				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 ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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

۱۴۰۱/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۹/۳۰		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 ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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)

۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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 ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۱۰/۳۰	
					کاهش	افزایش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	۰	۳۲۰,۰۸۸,۶۲۶,۳۳۲	۳۲۰,۰۸۹,۱۲۶,۳۳۲	۹۶,۸۲۴,۳۳۰	۰.۱٪
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	۰	۳۲۰,۳۶۲,۳۴۸,۱۹۶	۳۲۰,۰۸۸,۶۲۶,۳۳۲	۲۷۹,۷۲۱,۲۷۳	۰.۲۸٪
بانک خاورمیانه بخارست	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	۰	۲۶۲,۶۴۲,۶۲۹,۷۷۶	۲۶۲,۱۵۱,۹۴۹,۱۸۱	۵۲۱,۲۴۸,۴۰۷	۰.۵۳٪
جمع					۹۰۳,۰۹۳,۶۰۴,۳۰۴	۹۰۲,۳۲۹,۷۰۱,۸۴۵	۸۹۷,۷۹۴,۰۱۰	۰.۹۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۰/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۹/۳۰			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	سرمایه‌گذاری 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 ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۱/۱۰/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۱,۲۱۷,۴۳۵,۴۰۵)	۱۰۲.۸۲٪	-۱.۲۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳۳,۳۶۷,۷۱۲	-۲.۸۲٪	-۰.۰۳٪
جمع		(۱,۱۸۴,۰۶۷,۶۹۳)	۱۰۰٪	-۱.۲۶٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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	
۰.۰۰٪	۴۱۶,۶۵۲	۴۱۶,۶۵۲	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
-۱۴.۱۷٪	-۱,۲۱۷,۸۵۲,۰۵۷	-۱۷۵,۱۰۲,۹۴۷	۵۳۳,۱۷۰,۸۹۰	۰	۱۱.۸۸٪	۲۰۱,۸۲۹,۸۴۴	۷۹۶,۴۹۰,۱۸	۱۲۲,۱۸۰,۸۲۶	۰	صندوق س.رشد پایدار-د
-۱۴.۱۷٪	(۱,۲۱۷,۴۳۵,۴۰۵)	(۱,۷۵۰,۶۰۶,۲۹۵)	۵۳۳,۱۷۰,۸۹۰	۰	۱۱.۸۸٪	۲۰۱,۸۲۹,۸۴۴	۷۹,۶۴۹,۰۱۸	۱۲۲,۱۸۰,۸۲۶	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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 آنان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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
۵۳۳,۱۷۰,۸۹۰	۹۷,۳۳۵,۶۹۴,۶۴۵	۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۵	۹,۵۹۹,۱۱۱	۱۲۲,۱۸۰,۸۲۶	۹۷,۷۴۶,۶۸۴,۷۰۹	۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۵	۹,۵۹۹,۱۱۱	صندوق س.رشد پایدار-د
۵۳۳,۱۷۰,۸۹۰	۹۷,۳۳۵,۶۹۴,۶۴۵	۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۵		۱۲۲,۱۸۰,۸۲۶	۹۷,۷۴۶,۶۸۴,۷۰۹	۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۵		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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	
۴۱۶,۶۵۲	۶۳,۱۲۶,۱۹۰	۶۳,۵۴۲,۸۴۲	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
-۱,۷۵۱,۰۲۲,۹۴۷	۳,۷۴۶,۹۴۷,۸۹۰,۹۶۴	۳,۷۴۵,۱۹۶,۸۶۸,۰۱۷	۳۷۱,۵۷۸,۹۱۰	۷۹,۶۴۹,۰۱۸	۶۴۹,۸۷۲,۴۵۹,۵۳۵	۶۴۹,۹۵۲,۱۰۸,۵۵۳	۶۴,۵۲۹,۹۱۹	صندوق س.رشد پایدار-د
(۱,۷۵۰,۶۰۶,۲۹۵)	۳,۷۴۷,۰۱۱,۰۱۷,۱۵۴	۳,۷۴۵,۲۶۰,۴۱۰,۸۵۹		۷۹,۶۴۹,۰۱۸	۶۴۹,۸۷۲,۴۵۹,۵۳۵	۶۴۹,۹۵۲,۱۰۸,۵۵۳		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۱/۱۰/۳۰			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 ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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
	۶,۳۸۸,۱۲۷		۰	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴۴۹,۲۰۵		۰	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲۵,۹۷۸,۹۰۰		۴۹,۳۱۰	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
	۵۵۱,۴۸۰		۲۰۰,۹۹۳	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
	۳۳,۳۶۷,۷۱۲		۲۵۰,۳۰۳		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

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
۶,۳۸۸,۱۲۷	.	۶,۳۸۸,۱۲۷		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۴۹,۲۰۵	.	۴۴۹,۲۰۵		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۵,۹۷۸,۹۰۰	.	۲۵,۹۷۸,۹۰۰	۴۹,۳۱۰	.	۴۹,۳۱۰	.		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۵۵۱,۴۸۰	.	۵۵۱,۴۸۰	۲۰۰,۹۹۳	.	۲۰۰,۹۹۳	.		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۳۳,۳۶۷,۷۱۲	.	۳۳,۳۶۷,۷۱۲	۲۵۰,۳۰۳	.	۲۵۰,۳۰۳				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۰/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۱/۱۰/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۱۲٪	۱۰۰٪	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	۰	سایر درآمدها
۰.۰۰	۰	۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۱۲٪	۱۰۰٪	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	۰	