



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت برتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

سرمایه گذاری ها - ۱

سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام - ۱-۱

۱۴۰۱/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۰/۳۰			نام شرکت			
درصد به کل دارایی های 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				
۹۵.۹۹%	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶	۱۱۹,۱۲۸,۹۰۹,۱۶۸	۱۰,۱۸۹	۱۱,۷۳۵,۶۲۰	۲۷۴,۱۷۶,۲۰۳,۶۶۳	۲۷,۲۰۹,۶۹۳-	۲۹۶,۳۵۹,۰۷۳,۶۵۸	۲۹,۳۴۶,۲۰۲	۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۶	۹۷,۳۳۵,۶۹۴,۶۴۵	۹,۵۹۹,۱۱۱	صندوق س. رشد پایدار-د
۰.۰۰%	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶	۱۱۹,۱۲۸,۹۰۹,۱۶۸			۲۷۴,۱۷۶,۲۰۳,۶۶۳		۲۹۶,۳۵۹,۰۷۳,۶۵۸		۹۷,۸۶۸,۸۶۵,۵۳۶	۹۷,۳۳۵,۶۹۴,۶۴۵		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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

۱۴۰۱/۱۱/۳۰				۱۴۰۱/۱۰/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۱-۲ سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۴۰۱/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۰/۳۰		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت								
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرابورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					تعداد	مبلغ فروش										

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

۱۴۰۱/۱۱/۳۰

نام شرکت

تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل
-------	-------------	------------------	------------	-------------------------	-------

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۳-۱-سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۱۰/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰.۰۸٪	۹۴,۹۹۴,۳۳۰	۲۲۲,۵۶۶,۷۰۴,۴۳۹	۲۲۲,۵۶۴,۸۷۴,۴۳۹	۹۶,۸۲۴,۳۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۷٪	۹۰,۸۲۴,۱۰۵	۲۵۴,۵۶۴,۸۷۴,۴۳۹	۲۵۴,۳۷۵,۹۷۷,۲۷۱	۲۷۹,۷۲۱,۲۷۳	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۳۷٪	۴۵۹,۰۰۰,۳۴۷	۶۴,۱۲۶,۶۴۲	۱,۸۷۸,۵۸۲	۵۲۱,۲۴۸,۴۰۷	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
۰.۵۳٪	۶۴۴,۸۱۸,۷۸۲	۴۷۷,۱۹۵,۷۰۵,۵۲۰	۴۷۶,۹۴۲,۷۳۰,۲۹۲	۸۹۷,۷۹۴,۰۱۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۴-۱- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۰/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش 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
				تعداد	مبلغ فروش								

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۱/۱۱/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام		(۱,۶۹۹,۴۲۲,۷۸۹)	۱۰۱.۷۳%	-۱.۷۱%
سرمایه گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰%	۰.۰۰%
درآمد سپرده بانکی		۲۸,۸۹۴,۶۰۳	-۱.۷۳%	-۰.۰۳%
جمع		(۱,۶۷۰,۵۲۸,۱۸۶)	۱۰۰%	-۱.۷۴%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۱-۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری 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	
-۱۶.۹۸٪	(۱,۶۹۹,۸۳۹,۴۴۱)	(۲,۱۴۰,۵۹۵,۹۵۴)	۴۴۰,۸۳۸,۹۷۸	۰	-۳۳.۹۹٪	(۴۸۱,۹۸۷,۳۸۳)	(۳۸۹,۶۵۵,۴۷۲)	(۹۲,۳۳۱,۹۱۱)	۰	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
۰.۰۰٪	۴۱۶,۶۵۲	۴۱۶,۶۵۲	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	صندوق س.رشد پایدار-د
-۱۶.۹۸٪	(۱,۶۹۹,۴۲۲,۷۸۹)	(۲,۱۴۰,۱۷۹,۳۰۲)	۴۴۰,۸۳۸,۹۷۸	۰	-۳۳.۹۹٪	(۴۸۱,۹۸۷,۳۸۳)	(۳۸۹,۶۵۵,۴۷۲)	(۹۲,۳۳۱,۹۱۱)	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۲-۱-۲- درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

نام شرکت	از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			طی ماه				
	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد
صندوق س. رشد پایدار-د	۴۴۰,۸۳۸,۹۷۸	۱۱۹,۱۲۸,۹۰۹,۱۶۸	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶	۱۱,۷۳۵,۶۲۰	-۹۲,۳۳۱,۹۱۱	۱۱۹,۶۶۲,۰۸۰,۰۵۸	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶	۱۱,۷۳۵,۶۲۰
جمع	۴۴۰,۸۳۸,۹۷۸	۱۱۹,۱۲۸,۹۰۹,۱۶۸	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶		-۹۲,۳۳۱,۹۱۱	۱۱۹,۶۶۲,۰۸۰,۰۵۸	۱۱۹,۵۶۹,۷۴۸,۱۴۶	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۲-۱-۳- 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	۵۶۸	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
-۲,۱۴۰,۵۹۵,۹۵۴	۴,۰۲۱,۵۱۳,۷۵۰,۰۹۹	۴,۰۱۹,۳۷۳,۰۷۱,۶۸۰	۳۹۸,۷۸۸,۶۰۳	-۳۸۹,۶۵۵,۴۷۲	۲۷۴,۵۶۵,۸۵۹,۱۳۵	۲۷۴,۱۷۶,۲۰۳,۶۶۳	۲۷,۲۰۹,۶۹۳	صندوق س.رشد پایدار-د
(۲,۱۴۰,۱۷۹,۳۰۲)	۴,۰۲۱,۵۷۶,۸۷۶,۲۸۹	۴,۰۱۹,۴۳۶,۶۱۴,۵۲۲		(۳۸۹,۶۵۵,۴۷۲)	۲۷۴,۵۶۵,۸۵۹,۱۳۵	۲۷۴,۱۷۶,۲۰۳,۶۶۳		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۲-۲ درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۱/۱۱/۳۰				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۲-۳-درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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
			۰	۱۰۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
			۰	۱۰۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲۶,۴۶۴,۵۴۱		۴۸۵,۶۴۱	۱۰۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲,۴۳۰,۰۶۲		۱,۸۷۸,۵۸۲	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
	۲۸,۸۹۴,۶۰۳		۲,۳۶۴,۲۲۳		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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
۲۵,۹۷۸,۹۰۰	۰	۲۶,۴۶۴,۵۴۱	۴۹,۳۱۰	۰	۴۹,۳۱۰	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۵۵۱,۴۸۰	۰	۲,۴۳۰,۰۶۲	۲۰۰,۹۹۳	۰	۲۰۰,۹۹۳	۰		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۲۶,۵۳۰,۳۸۰	۰	۲۸,۸۹۴,۶۰۳	۲۵۰,۳۰۳	۰	۲۵۰,۳۰۳				

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۱/۱۱/۳۰ 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	