



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

سرمایه‌گذاری‌ها - ۱

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام - ۱-۱

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۱/۳۰			نام شرکت			
		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					
درصد به کل دارایی‌های صندوق												صندوق س. رشد پایدار-د
۸۸.۲۹%	۸۰.۷۵۱.۶۲۵.۳۵۸	۸۰.۴۱۱.۷۱۲.۰۸۳	۱۰.۱۸۲	۷.۹۳۱.۱۱۹	۵۳۵.۲۹۷.۲۴۴.۵۱۵	۵۳.۲۴۹.۰۶۵-	۴۹۷.۹۸۲.۶۳۵.۸۶۳	۴۹.۴۴۴.۵۶۴	۱۱۹.۵۶۹.۷۴۸.۱۴۶	۱۱۹.۱۲۸.۹۰۹.۱۶۸	۱۱.۷۳۵.۶۲۰	جمع
۸۸.۲۹%	۸۰.۷۵۱.۶۲۵.۳۵۸	۸۰.۴۱۱.۷۱۲.۰۸۳			۵۳۵.۲۹۷.۲۴۴.۵۱۵		۴۹۷.۹۸۲.۶۳۵.۸۶۳		۱۱۹.۵۶۹.۷۴۸.۱۴۶	۱۱۹.۱۲۸.۹۰۹.۱۶۸		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۱/۱۲/۲۹				۱۴۰۱/۱۱/۳۰				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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۱/۳۰		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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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)

۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۱۱/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰.۱۰٪	۹۴,۴۹۴,۳۳۰	۴۶۲,۹۱۰,۱۸۶,۹۰۱	۴۶۲,۹۰۹,۶۸۶,۹۰۱	۹۴,۹۹۴,۳۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۵.۹۲٪	۵,۴۲۲,۵۳۲,۹۸۶	۴۶۲,۹۰۹,۶۸۶,۹۰۱	۴۶۸,۲۴۱,۳۹۵,۷۸۲	۹۰,۸۲۴,۱۰۵	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۲۴٪	۲۲۰,۰۴۷,۰۶۷	۲۳۹,۸۲۳,۹۸۰	۸۷۰,۷۰۰	۴۵۹,۰۰۰,۳۴۷	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
۶.۲۶٪	۵,۷۳۷,۰۷۴,۳۸۳	۹۲۶,۰۵۹,۶۹۷,۷۸۲	۹۳۱,۱۵۱,۹۵۳,۳۸۳	۶۴۴,۸۱۸,۷۸۲					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۱/۳۰		اطلاعات اوراق گواهی سپرده					
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه‌گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۳,۲۰۲,۰۹۲,۵۳۶)	۱۰۰.۹۴٪	-۳.۵۰٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۲۹,۸۱۵,۲۶۰	-۰.۹۴٪	۰.۰۳٪
جمع		(۳,۱۷۲,۲۷۷,۲۷۶)	۱۰۰٪	-۳.۴۷٪



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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
-۱۷.۹۱٪	-۳,۲۰۲,۵۰۹,۱۸۸	-۳,۵۴۲,۴۲۲,۴۶۳	۳۳۹,۹۱۳,۲۷۵	۰	-۱۰۶.۵۳٪	-۱,۵۰۲,۷۵۲,۲۱۱	-۱,۴۰۱,۸۲۶,۵۰۹	-۱۰۰,۹۲۵,۷۰۲	۰	صندوق س.رشد پایدار-د
-۱۷.۹۰٪	(۳,۲۰۲,۰۹۲,۵۳۶)	(۳,۵۴۲,۰۰۵,۸۱۱)	۳۳۹,۹۱۳,۲۷۵	۰	-۱۰۶.۵۳٪	(۱,۵۰۲,۷۵۲,۲۱۱)	(۱,۴۰۱,۸۲۶,۵۰۹)	(۱۰۰,۹۲۵,۷۰۲)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری
صندوق س. رشد پایدار-د	۷,۹۳۱,۱۱۹	۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۸۵۲,۵۵۱,۰۶۱	-۱۰۰,۹۲۵,۷۰۲	۷,۹۳۱,۱۱۹	۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۴۱۱,۷۱۲,۰۸۳
جمع		۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۸۵۲,۵۵۱,۰۶۱	-۱۰۰,۹۲۵,۷۰۲		۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۴۱۱,۷۱۲,۰۸۳
							۳۳۹,۹۱۳,۲۷۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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	۵۶۸	.	.	.	.	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
-۳,۵۴۲,۴۲۲,۴۶۳	۴,۵۵۸,۲۱۳,۵۸۳,۰۴۷	۴,۵۵۴,۶۷۱,۱۶۰,۵۸۴	۴۵۲,۰۳۷,۶۶۸	-۱,۴۰۱,۸۲۶,۵۰۹	۵۳۶,۶۹۹,۸۳۲,۹۴۸	۵۳۵,۲۹۸,۰۰۶,۴۳۹	۵۳,۲۴۹,۰۶۵	صندوق س.رشد پایدار-د
(۳.۵۴۲,۰۰۵.۸۱۱)	۴.۵۵۸,۲۷۶.۷۰۹,۲۳۷	۴,۵۵۴,۷۳۴,۷۰۳,۴۲۶		(۱,۴۰۱,۸۲۶,۵۰۹)	۵۳۶,۶۹۹,۸۳۲,۹۴۸	۵۳۵,۲۹۸,۰۰۶,۴۳۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۱/۱۲/۲۹				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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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
			۰	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
			۰	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲۶,۵۱۴,۴۹۸		۴۹,۹۵۷	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
	۳,۳۰۰,۷۶۲		۸۷۰,۷۰۰	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
	<u>۲۹,۸۱۵,۲۶۰</u>		<u>۹۲۰,۶۵۷</u>		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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
۳,۳۰۰,۷۶۲	۰	۳,۳۰۰,۷۶۲	۸۷۰,۷۰۰	۰	۸۷۰,۷۰۰	۰		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۲۹,۲۷۹,۶۶۲	۰	۲۹,۷۶۵,۳۰۳	۹۲۰,۰۱۰	۰	۹۲۰,۰۱۰				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۱/۱۲/۲۹ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۱۳٪	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
۰.۱۳٪	۱۰۰٪	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	۰	