



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر ترفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

سرمایه‌گذاری‌ها - ۱

سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری - ۱-۱

		تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۲/۳۱				نام شرکت		
۱۴۰۲/۰۳/۳۱		فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش		بهای تمام شده				
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	بهای تمام شده			
۹۲.۶۳٪	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶	۹۳,۹۹۱,۶۷۶,۰۴۴	۱۰,۱۸۸	۹,۲۶۶,۶۵۰	۶۵۹,۵۳۱,۴۵۳,۷۰۷	۶۵,۴۲۳,۸۲۱-	۶۸۹,۵۷۱,۲۳۳,۰۱۰	۶۸,۴۴۲,۸۵۵	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶	۶,۲۴۷,۶۱۶	صندوق س. رشد پایدار-د
۹۲.۶۳٪	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶	۹۳,۹۹۱,۶۷۶,۰۴۴			۶۵۹,۵۳۱,۴۵۳,۷۰۷		۶۸۹,۵۷۱,۲۳۳,۰۱۰		۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۳/۳۱				۱۴۰۲/۰۲/۳۱				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 برتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۲/۳۱		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 بر تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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)

۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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 ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۲/۳۱					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰.۰۹٪	۹۲,۴۱۰,۸۳۰	۴۴۸,۵۱۷,۱۰۷,۴۳۳	۴۴۸,۵۱۶,۳۲۸,۹۳۳	۹۳,۱۸۹,۳۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۴,۶۲۸,۵۱۸	۶۱۶,۳۸۳,۹۳۶,۵۱۸	۶۰۰,۳۲۱,۱۰۷,۱۱۷	۱۶,۰۶۷,۴۵۷,۹۱۹	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۲٪	۱۷,۷۸۳,۴۵۴	۲۰,۸۴۴,۷۲۵,۸۹۶	۲۰,۸۱۱,۱۶۹,۵۷۸	۵۱,۳۳۹,۷۷۲	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
۰.۱۱٪	۱۱۴,۸۲۲,۸۰۲	۱,۰۸۵,۷۴۵,۷۶۹,۸۴۷	۱,۰۶۹,۶۴۸,۶۰۵,۶۲۸	۱۶,۲۱۱,۹۸۷,۰۲۱					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

تغییرات طی دوره		اطلاعات اوراق گواهی سپرده							
۱۴۰۲/۰۳/۳۱		۱۴۰۲/۰۲/۳۱							
تعداد	فروش طی ماه	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	بورسی یا فرابورسی	نرخ سود	نرخ فروش	تاریخ سررسید	گواهی سپرده بانکی
	مبلغ فروش								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری		۲۴,۵۵۶,۶۳۷,۵۱۹	۹۹.۳۵٪	۲۴.۰۹٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳۷,۸۹۷,۱۲۱	۰.۱۵٪	۰.۰۴٪
سایر درآمدها		۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	۰.۵۰٪	۰.۱۲٪
جمع		۲۴,۷۱۷,۶۹۲,۷۳۸	۱۰۰٪	۲۴.۲۵٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در صندوق:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره						طی ماه					نام شرکت	
درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد بازارگردانی	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد بازارگردانی	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	
۰.۰۰٪	۴۱۶,۶۵۲		۴۱۶,۶۵۲	۰	۰	۰.۰۰٪	۰		۰	۰	۰	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
۹۸.۸۱٪	۲۴,۵۵۶,۲۲۰,۸۶۷	۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹	-۱,۹۰۱,۸۱۱,۱۸۷	۴۱۳,۴۱۳,۸۳۲	۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳	۹۹.۵۸٪	۲,۴۸۵,۵۹۲,۷۲۲	۵۸۱,۵۵۹,۷۸۰	۸۲۰,۳۴۰,۸۳۵	۱۰۹,۶۰۲,۵۴۹-	۱,۱۹۳,۲۹۴,۶۵۶	صندوق س.رشد پایدار-د
۹۸.۸۱٪	۲۴,۵۵۶,۶۳۷,۵۱۹	۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹	(۱,۹۰۱,۳۹۴,۵۳۵)	۴۱۳,۴۱۳,۸۳۲	۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳	۹۹.۵۸٪	۲,۴۸۵,۵۹۲,۷۲۲	۵۸۱,۵۵۹,۷۸۰	۸۲۰,۳۴۰,۸۳۵	(۱۰۹,۶۰۲,۵۴۹)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۱-۱-۲- درآمد سود صندوق

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			اطلاعات مجمع		نام شرکت
خالص درآمد سود صندوق	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود صندوق	خالص درآمد سود صندوق	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود صندوق	سود متعلق به هر واحد	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ مجمع
۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳		۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳	۱,۱۹۳,۲۹۴,۶۵۶		۱,۱۹۳,۲۹۴,۶۵۶	۱۹۱	۶,۲۴۷,۶۱۶	
۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳	۰	۱۷,۰۷۳,۴۸۶,۰۵۳	۱,۱۹۳,۲۹۴,۶۵۶	۰	۱,۱۹۳,۲۹۴,۶۵۶			صندوق س. رشد پایدار-د جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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
۴۱۳,۴۱۳,۸۳۲	۹۳,۹۹۱,۶۷۶,۰۴۴	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶	۹,۲۶۶,۶۵۰	-۱۰۹,۶۰۲,۵۵۰	۹۴,۵۱۴,۶۹۲,۴۲۶	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶	۹,۲۶۶,۶۵۰	صندوق س. رشد پایدار-د
۴۱۳,۴۱۳,۸۳۲	۹۳,۹۹۱,۶۷۶,۰۴۴	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶		-۱۰۹,۶۰۲,۵۵۰	۹۴,۵۱۴,۶۹۲,۴۲۶	۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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	
۴۱۶,۶۵۲	۶۳,۱۲۶,۱۹۰	۶۳,۵۴۲,۸۴۲	۵۶۸	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس
-۱,۹۰۱,۸۱۱,۱۸۷	۶,۰۹۱,۸۷۹,۴۸۳,۸۷۹	۶,۰۸۹,۹۷۷,۶۷۲,۶۹۲	۶۰۴,۳۴۲,۸۶۰	۸۲۰,۳۴۰,۸۳۵	۶۵۸,۷۱۱,۱۱۲,۸۷۲	۶۵۹,۵۳۱,۴۵۳,۷۰۷	۶۵,۴۲۳,۸۲۱	صندوق س.رشد پایدار-د
(۱,۹۰۱,۳۹۴,۵۳۵)	۶,۰۹۱,۹۴۲,۶۱۰,۰۶۹	۶,۰۹۰,۰۴۱,۲۱۵,۵۳۴	۶۰۴,۳۴۳,۴۲۸	۸۲۰,۳۴۰,۸۳۵	۶۵۸,۷۱۱,۱۱۲,۸۷۲	۶۵۹,۵۳۱,۴۵۳,۷۰۷	۶۵,۴۲۳,۸۲۱	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۴-۱-۲- درآمد کارمزد بازارگردانی

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			طی ماه		نام شرکت
خالص درآمد کارمزد بازارگردانی	هزینه تنزیل	جمع درآمد کارمزد بازارگردانی	خالص درآمد کارمزد بازارگردانی	هزینه تنزیل	
۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹		۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹	۵۸۱,۵۵۹,۷۸۰		صندوق س. رشد پایدار-د
۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹	۰	۸,۹۷۱,۱۳۲,۱۶۹	۵۸۱,۵۵۹,۷۸۰	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۲/۰۳/۳۱			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 ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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
	۶,۳۸۸,۱۲۷		۰	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴۴۹,۲۰۵		۰	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲۶,۵۳۴,۰۷۰		۱۹,۵۷۲	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴,۵۲۵,۷۱۹		۷۵,۱۹۹	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
	۳۷,۸۹۷,۱۲۱		۹۴,۷۷۱		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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
۶,۳۸۸,۱۲۷	۰	۶,۳۸۸,۱۲۷							بانک تجارت تخصصی بورس
۴۴۹,۲۰۵	۰	۴۴۹,۲۰۵							بانک تجارت تخصصی بورس
۲۶,۵۳۴,۰۷۰	۰	۲۶,۵۳۴,۰۷۰	۱۹,۵۷۲		۱۹,۵۷۲	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۴,۵۲۵,۷۱۹	۰	۴,۵۲۵,۷۱۹	۷۵,۱۹۹		۷۵,۱۹۹	۰		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۳۷,۸۹۷,۱۲۱	۰	۳۷,۸۹۷,۱۲۱	۹۴,۷۷۱	۰	۹۴,۷۷۱				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۲/۰۳/۳۱ 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	