



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۰۱/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۲/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۴,۴۹۰,۱۴۸	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۰	۰	۰	۰	۰	۴,۴۹۰,۱۴۸	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۰
سایبا دیزل	۱۲,۷۴۲,۳۴۶	۵۹,۸۹۲,۹۰۱,۰۶۶	۴۶,۱۶۸,۶۳۱,۷۴۹	۰	۰	۰	۰	۱۲,۷۴۲,۳۴۶	۵۹,۸۹۲,۹۰۱,۰۶۶	۴۶,۱۶۸,۶۳۱,۷۴۹
مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱,۴۹۶,۷۱۶	۷,۴۹۲,۹۸۸,۹۶۲	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۷۹	۰	۰	۰	۰	۱,۴۹۶,۷۱۶	۷,۴۹۲,۹۸۸,۹۶۲	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۷۹
جمع		۸۵,۳۶۸,۹۳۲,۷۶۸	۷۱,۵۹۳,۴۶۶,۱۷۸	۰	۰	۰	۰			

تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق
۴,۴۹۰,۱۴۸	۴,۰۰۰	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۰	۱۳.۰۹٪
۱۲,۷۴۲,۳۴۶	۳,۵۸۲	۵۹,۸۹۲,۹۰۱,۰۶۶	۴۵,۶۰۸,۳۹۴,۶۲۹	۳۳.۲۷٪
۱,۴۹۶,۷۱۶	۵,۰۰۰	۷,۴۹۲,۹۸۸,۹۶۲	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۷۹	۵.۴۶٪
		۸۵,۳۶۸,۹۳۲,۷۶۸	۷۱,۰۳۳,۲۲۹,۰۵۸	۵۱.۸۲٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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

۱۴۰۰/۰۲/۳۱				۱۴۰۰/۰۱/۳۱				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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۱/۳۱		۱۴۰۰/۰۲/۳۱				
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه	تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی های صندوق
													مبلغ فروش					

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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)

۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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 ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	۱۴۰۰/۰۱/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۲/۳۱	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها	
بانک سپه مفتوح شمالی	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۷/۰۶/۲۱	۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۱,۲۳۱,۵۵۲	۲۶۱,۲۳۱,۵۵۲	۰	۰.۰۰٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	۰	۶۴,۴۷۸,۲۳۸,۱۲۵	۱۰۶,۶۷۹,۰۶۷	۳۸۷,۱۰۰	۶۴,۵۸۴,۵۳۰,۰۹۲	۴۷.۱۲٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	۰	۹۸,۸۳۴,۰۶۱	۳۸۷,۱۰۰	۸۰۷,۱۰۰	۹۸,۴۱۴,۰۶۱	۰.۰۷٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	۰	۹,۸۲۸,۵۴۱	۱۶۷,۶۵۹	۰	۹,۹۹۶,۲۰۰	۰.۰۱٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	۰	۴۹۷,۱۳۲,۰۲۱	۶۴۵,۵۴۵,۴۰۳	۰	۱,۱۴۲,۶۷۷,۴۲۴	۰.۸۳٪	
جمع					۶۵,۰۹۴,۰۳۲,۷۴۸	۱,۰۰۴,۰۱۰,۷۸۱	۲۶۲,۴۲۵,۷۵۲	۶۵,۸۳۵,۶۱۷,۷۷۷	۴۸.۰۳٪	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۲/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۰۲/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۲-۱	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	۱۴۰.۶۹٪	(۰.۴۱٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی	۲-۳	۱۶۱,۱۷۱,۸۷۲	(۴۰.۴۷٪)	۰.۱۲٪
سایر درآمدها	۲-۴	۸۵۰,۶۶۹	(۰.۲۱٪)	۰.۰۰٪
جمع		(۳۹۸,۲۱۴,۵۷۹)	۱۰۰٪	-۰.۲۹٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره						۱۴۰۰/۰۲/۳۱				نام شرکت
درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ		
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	جنرال مکانیک	
۰	۰	۰	۸,۴۸۹	۰	۰	۰	۰	۰	صنایع چوب خزر کاسپین	
۰	۰	۱۳۸,۰۲۰,۰۵۱	(۴۶۷,۹۸۵,۸۸۲)	(۶۰۶,۰۰۵,۹۳۳)	۰	۰	۰	۰	مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	
۰	۰	(۱۵,۱۱۹,۷۲۶,۸۳۱)	(۱۴,۷۹۶,۷۱۵,۲۳۱)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۰	۰	۰	کارخانجات تولیدی شیشه رازی	
۰	۰	(۴۴,۶۶۸,۲۱۵,۲۰۱)	(۵۸,۹۵۲,۷۲۱,۶۳۹)	(۱۴,۲۸۴,۵۰۶,۴۲۸)	۱۰۰٪	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	۰	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	سایپا دیزل	
۰	۰	۰	(۳۶,۱۰۰,۷۹۰)	(۳۶,۱۰۰,۷۹۰)	۰٪	۰	۰	۰	ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	
۰	۰	(۵۹,۶۴۹,۹۱۳,۴۹۲)	(۷۴,۲۵۳,۵۱۵,۰۵۳)	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۱۰۰٪	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	۰	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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
کارخانجات تولیدی شیشه رازی	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	۱,۶۱۵,۰۵۸	۲۰۰	۰	۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰
جمع				۰	۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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	
(۱۴,۲۸۴,۵۰۶,۴۳۸)	۵۹,۸۹۲,۹۰۱,۰۶۶	۴۵,۶۰۸,۳۹۴,۶۲۸	۱۲,۷۴۲,۳۴۶	(۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰)	۴۶,۱۶۸,۶۳۱,۷۴۸	۴۵,۶۰۸,۳۹۴,۶۲۸	۱۲,۷۴۲,۳۴۶	سایپا دیزل
(۳۶,۱۰۰,۷۹۰)	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۰	۴,۴۹۰,۱۴۸	.	.	.	.	ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۶۰۶,۰۰۵,۹۳۳)	۸,۰۸۳,۸۹۸,۴۱۲	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۷۹	۱,۴۹۶,۷۱۶	.	.	.	.	مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۱۴,۹۲۶,۶۱۳,۱۶۱)	۸۵,۹۵۹,۸۴۲,۲۱۸	۷۱,۰۳۳,۲۲۹,۰۵۷		-۵۶۰,۲۳۷,۱۲۰	۴۶,۱۶۸,۶۳۱,۷۴۸	۴۵,۶۰۸,۳۹۴,۶۲۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۳-۱-۲- سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

نام شرکت	تغییرات طی دوره				از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری
جنرال مکانیک	۰	۰	۰	۰	۶۵,۱۰۸	۲,۷۲۷,۱۰۰,۲۱۱	۲,۷۲۷,۱۰۰,۲۱۱
صنایع چوب خزر کاسپین	۰	۰	۰	۰	۷	۱۸۳,۶۱۳	۱۷۵,۱۲۴
مجتمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۰	۰	۰	۰	۲,۰۸۴,۶۷۲	۳۹,۹۲۹,۷۱۶,۹۴۰	۳۹,۷۹۱,۶۹۶,۸۸۹
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۰	۰	۰	۰	۲۶,۹۴۷,۷۳۴	۶۲۰,۰۸۶,۵۳۰,۰۱۸	۶۳۵,۲۰۶,۲۵۶,۸۴۹
سایبا دیزل	۰	۰	۰	۰	۸۱,۲۸۳,۲۲۸	۴۷۹,۸۱۳,۶۱۶,۲۳۸	۵۲۴,۴۸۱,۸۳۱,۴۳۹
جمع		۰	۰	۰		۱,۱۴۲,۵۵۷,۱۴۷,۰۲۰	۱,۲۰۲,۲۰۷,۰۶۰,۵۱۲
							(۵۹,۶۴۹,۹۱۳,۴۹۲)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۲/۳۱				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 ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۳-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی		تغییرات طی دوره		از ابتدای سال مالی تا پایان دوره	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
بانک سپه مفتاح شمالی	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	۴,۵۲۳,۹۰۲		۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲	
بانک سپه مفتاح شمالی	۳۱۷۴۱۱۰۰۰۷۸-۷۹	۰		۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	۱۰۶,۶۷۹,۰۶۷		۸۴۸,۱۴۶,۹۷۰	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۱۶۷,۶۵۹		۶۱۴,۷۶۰	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	۳۸۴,۸۱۳,۸۵۱		۱,۴۶۶,۶۴۰,۹۰۹	
بانک سپه بلوار کشاورز وصال شیرازی	۱۵۱۱۰۰۲۶۴.۶۵	۱۶۱,۱۷۱,۸۷۲		۱,۰۵۳,۷۱۴,۷۰۸	
جمع		۶۵۷,۳۵۶,۳۵۱		۴,۳۶۵,۸۹۹,۸۶۸	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

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
۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲	۰	۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲	۴,۵۲۳,۹۰۲	۰	۴,۵۲۳,۹۰۲	۰		۱	بانک سپه مفتاح شمالی
۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹	۰	۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹	۰	۰	۰	۱۵		۱	بانک سپه مفتاح شمالی
۸۴۸,۱۴۶,۹۷۰	۰	۸۴۸,۱۴۶,۹۷۰	۱۰۶,۶۷۹,۰۶۷	۰	۱۰۶,۶۷۹,۰۶۷	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۶۱۴,۷۶۰	۰	۶۱۴,۷۶۰	۱۶۷,۶۵۹	۰	۱۶۷,۶۵۹	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۴۶۶,۶۴۰,۹۰۹	۰	۱,۴۶۶,۶۴۰,۹۰۹	۳۸۴,۸۱۳,۸۵۱	۰	۳۸۴,۸۱۳,۸۵۱	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۰۵۳,۳۹۹,۵۰۹	۳۱۵,۱۹۹	۱,۰۵۳,۷۱۴,۷۰۸	۱۶۱,۱۷۱,۸۷۲	۰	۱۶۱,۱۷۱,۸۷۲	۱۵		۱	بانک سپه بلوار کشاورز وصال شیرازی
۴,۳۶۵,۵۸۴,۶۶۹	۳۱۵,۱۹۹	۴,۳۶۵,۸۹۹,۸۶۸	۶۵۷,۳۵۶,۳۵۱	۰	۶۵۷,۳۵۶,۳۵۱				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۲/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۲/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰٪	(۰.۲۰٪)	۸۰۵,۱۲۷	۰	سایر درآمدها
۰.۰۰٪	۵.۳۵٪	۴۵,۵۴۲	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰٪	۵.۱۵٪	۸۵۰,۶۶۹	۰	