



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۴۰۰/۰۳/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۲/۳۱			نام شرکت
درصد به کل دارایی‌های 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				
۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۲	(۴,۴۹۰,۱۴۸)	۰	۰	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۰	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	۴,۴۹۰,۱۴۸	ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۳۶.۵۳٪	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۵۲,۸۴۲,۴۴۴,۹۲۷	۳,۰۸۱	۱۱,۲۴۲,۳۴۶	۴,۶۹۲,۹۳۰,۷۰۱	(۱,۵۰۰,۰۰۰)	۰	۰	۴۵,۶۰۸,۳۹۴,۶۲۹	۵۹,۸۹۲,۹۰۱,۰۶۶	۱۲,۷۴۲,۳۴۶	سایبا دیزل
۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۸۲	(۱,۴۹۶,۷۱۶)	۰	۰	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۷۹	۷,۴۹۲,۹۸۸,۹۶۲	۱,۴۹۶,۷۱۶	مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
۳۶.۵۳٪	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۵۲,۸۴۲,۴۴۴,۹۲۷			۳۰,۱۱۷,۷۶۵,۱۳۵	(۷,۴۸۶,۸۶۴)	۰	۰	۷۱,۰۳۳,۲۲۹,۰۵۸	۸۵,۳۶۸,۹۳۲,۷۶۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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

۱۴۰۰/۰۳/۳۱				۱۴۰۰/۰۲/۳۱				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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۲/۲۱		۱۴۰۰/۰۳/۳۱				
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	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 ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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)

۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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 ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۲/۳۱						سپرده
درصد به کل	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب		
دارایی‌ها										
۶۲.۱۹٪	۵۸,۹۴۳,۳۸۱,۵۸۰	۳۱,۵۶۲,۳۸۱,۹۷۶	۲۵,۹۲۱,۲۳۳,۴۶۴	۶۴,۵۸۴,۵۳۰,۰۹۲	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس	
۰.۱۰٪	۹۸,۰۸۳,۴۹۱	۳۱,۸۱۳,۷۳۱,۰۴۹	۳۱,۸۱۳,۴۰۰,۴۷۹	۹۸,۴۱۴,۰۶۱	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس	
۰.۰۱٪	۸,۰۶۴,۱۱۳	۱۰۷,۱۳۸,۱۱۵	۱۰۵,۲۰۶,۰۲۸	۹,۹۹۶,۲۰۰	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس	
۱.۰۶٪	۱,۰۰۷,۳۸۰,۸۱۹	۱۴۳,۸۸۰,۳۸۸	۸,۵۸۳,۷۸۳	۱,۱۴۲,۶۷۷,۴۲۴	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس	
۶۳.۳۷٪	۶۰,۰۵۶,۹۱۰,۰۰۳	۶۳,۶۲۷,۱۳۱,۵۲۸	۵۷,۸۴۸,۴۲۳,۷۵۴	۶۵,۸۳۵,۶۱۷,۷۷۷					جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۳/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه	
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۲-۱	(۶,۳۰۴,۱۲۰,۵۲۴)	۱۰۰.۰۱٪	(۶.۶۵٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی	۲-۳	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
سایر درآمدها	۲-۴	۸۵۰,۶۶۹	(۰.۰۱٪)	۰.۰۰٪
جمع		(۶,۳۰۳,۲۶۹,۸۵۵)	۱۰۰٪	-۶.۶۵٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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

نام شرکت	طی ماه					از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها
جنرال مکانیک	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
صنایع چوب خزر کاسپین	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۸,۴۸۹	۸,۴۸۹	(۰.۰۰٪)
مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۰	۶۰۶,۰۰۵,۹۳۳	(۶۰۶,۰۰۵,۹۳۰)	۳	(۰.۰۰٪)	۰	۰	(۴۶۷,۹۸۵,۸۷۹)	(۴۶۷,۹۸۵,۸۷۹)	۰.۵۸٪
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۰	۰	۰	۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	(۱۵,۱۱۹,۷۲۶,۸۳۱)	(۱۴,۷۹۶,۷۱۵,۳۳۱)	۱۸٪
سایپا دیزل	۰	(۳,۹۴۶,۵۹۵,۰۹۱)	(۲,۳۵۷,۵۲۵,۴۳۸)	(۶,۳۰۴,۱۲۰,۵۲۹)	۱۰۰٪	۰	(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	(۴۷,۰۲۵,۷۴۰,۶۳۹)	(۶۵,۲۵۶,۸۴۲,۱۶۸)	۸۱.۰۱٪
ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۰	۳۶,۱۰۰,۷۹۰	(۳۶,۱۰۰,۷۸۸)	۲	۰٪	۰	۰	(۳۶,۱۰۰,۷۸۸)	(۳۶,۱۰۰,۷۸۸)	۰.۰۴٪
جمع	۰	(۳,۳۰۴,۴۸۸,۳۶۸)	(۲,۹۹۹,۶۳۲,۱۵۶)	(۶,۳۰۴,۱۲۰,۵۲۴)	۱۰۰٪	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	(۶۲,۶۴۹,۵۴۵,۶۴۸)	(۸۰,۵۵۷,۶۳۵,۵۷۷)	۱۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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 جمع	۱۳۹۹/۰۴/۳۰	۱,۶۱۵,۰۵۸	۲۰۰	۰	۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰
				۰	۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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	
(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	۵۲,۸۴۲,۴۴۴,۹۲۷	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۱۱,۲۴۲,۳۴۶	(۳,۹۴۶,۵۹۵,۰۹۱)	۳۸,۵۵۷,۹۳۸,۴۸۹	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۱۱,۲۴۲,۳۴۶	سایپا دیزل
.	.	.	.	۳۶,۱۰۰,۷۹۰	-۳۶,۱۰۰,۷۹۰	.	.	ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
.	.	.	.	۶۰۶,۰۰۵,۹۳۳	-۶۰۶,۰۰۵,۹۳۳	.	.	مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان
(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	۵۲,۸۴۲,۴۴۴,۹۲۷	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸		-۳,۳۰۴,۴۸۸,۳۶۸	۳۷,۹۱۵,۸۳۱,۷۶۶	۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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	سود و زیان ناشی از فروش
جنرال مکانیک	۰	۰	۰	۰	۶۵,۱۰۸	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	۲,۷۰۵,۶۸۰,۷۳۶	۰
صنایع چوب خزر کاسپین	۰	۰	۰	۰	۷	۱۸۳,۶۱۳	۱۷۵,۱۲۴	۸,۴۸۹
مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۱,۴۹۶,۷۱۶	۷,۴۷۷,۸۹۲,۴۸۲	۸,۰۸۳,۸۹۸,۴۱۲	(۶۰۶,۰۰۵,۹۳۰)	۳,۵۸۱,۳۸۸	۴۷,۴۰۷,۶۰۹,۴۲۲	۴۷,۸۷۵,۵۹۵,۳۰۱	(۴۶۷,۹۸۵,۸۷۹)
کارخانجات تولیدی شیشه‌رازی	۰	۰	۰	۰	۲۶,۹۴۷,۷۳۴	۶۲۰,۰۸۶,۵۳۰,۰۱۸	۶۳۵,۲۰۶,۲۵۶,۸۴۹	(۱۵,۱۱۹,۷۲۶,۸۳۱)
سایپا دیزل	۱,۵۰۰,۰۰۰	۴,۶۹۲,۹۳۰,۷۰۱	۷,۰۵۰,۴۵۶,۱۳۹	(۲,۳۵۷,۵۲۵,۴۳۸)	۸۲,۷۸۳,۲۲۸	۴۸۴,۵۰۶,۵۴۶,۹۳۹	۵۳۱,۵۳۲,۲۸۷,۵۷۸	(۴۷,۰۲۵,۷۴۰,۶۳۹)
ح.مجمع تولیدی نیلی صنعت کرمان	۴,۴۹۰,۱۴۸	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۲	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	(۳۶,۱۰۰,۷۸۸)	۴,۴۹۰,۱۴۸	۱۷,۹۴۶,۹۴۱,۹۵۲	۱۷,۹۸۳,۰۴۲,۷۴۰	(۳۶,۱۰۰,۷۸۸)
جمع		۳۰,۱۱۷,۷۶۵,۱۳۵	۳۳,۱۱۷,۳۹۷,۲۹۱	(۲,۹۹۹,۶۳۲,۱۵۶)		۱,۱۷۲,۶۵۳,۴۹۲,۶۸۰	۱,۲۳۵,۳۰۳,۰۳۸,۳۲۸	(۶۲,۶۴۹,۵۴۵,۶۴۸)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۳/۳۱				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 ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		تغییرات طی دوره		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
	۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۵۰۸-۴۳	بانک سپه مفتاح شمالی
	۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹		۰	۳۱۷۴۱۱۰۰۷۸-۷۹	بانک سپه مفتاح شمالی
	۱,۳۴۴,۵۴۶,۰۰۰		۴۹۶,۳۹۹,۰۳۰	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۶۸۲,۶۷۳		۶۷,۹۱۳	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱,۴۷۵,۱۲۴,۶۹۲		۸,۴۸۳,۷۸۳	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱,۰۵۳,۷۱۴,۷۰۸		۰	۱۵۱۱۰۰۲۶۴۰۶۵	بانک سپه بلوار کشاورز وصال شیرازی
	۴,۸۷۰,۸۵۰,۵۹۴		۵۰۴,۹۵۰,۷۲۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

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
۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲	۰	۴۴۳,۱۳۶,۵۵۲	۰	۰	۰	۰		۱	بانک سپه مفتح شمالی
۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹	۰	۵۵۳,۶۴۵,۹۶۹	۰	۰	۰	۱۵		۱	بانک سپه مفتح شمالی
۱,۳۴۴,۵۴۶,۰۰۰	۰	۱,۳۴۴,۵۴۶,۰۰۰	۴۹۶,۳۹۹,۰۳۰	۰	۴۹۶,۳۹۹,۰۳۰	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۶۸۲,۶۷۳	۰	۶۸۲,۶۷۳	۶۷,۹۱۳	۰	۶۷,۹۱۳	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۴۷۵,۱۲۴,۶۹۲	۰	۱,۴۷۵,۱۲۴,۶۹۲	۸,۴۸۳,۷۸۳	۰	۸,۴۸۳,۷۸۳	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۰۵۳,۳۹۹,۵۰۹	۳۱۵,۱۹۹	۱,۰۵۳,۷۱۴,۷۰۸	۰	۰	۰	۱۵		۱	بانک سپه بلوار کشاورز وصال شیرازی
۴,۸۷۰,۵۳۵,۳۹۵	۳۱۵,۱۹۹	۴,۸۷۰,۸۵۰,۵۹۴	۵۰۴,۹۵۰,۷۲۶	۰	۵۰۴,۹۵۰,۷۲۶				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۳/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
۰.۰۰٪	(۰.۰۱٪)	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٪	۵.۳۴٪	۸۵۰,۶۶۹	۰	