



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت یرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۴۰۰/۰۶/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۵/۳۱			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				
۲۲.۶۶٪	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۲	۲۰,۳۵۰,۴۳۷,۴۶۷	۳,۵۶۱	۴,۷۸۷,۰۳۷	۸۸۸,۳۲۴,۳۶۵	(۲۰۰,۰۰۰)	۱۷,۲۱۲,۴۹۴,۰۸۰	۴,۰۰۰,۰۰۰	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶	۹۸۷,۰۳۷	سایپا دیزل
۲۲.۶۶٪	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۲	۲۰,۳۵۰,۴۳۷,۴۶۷			۸۸۸,۳۲۴,۳۶۵	(۲۰۰,۰۰۰)	۱۷,۲۱۲,۴۹۴,۰۸۰	۴,۰۰۰,۰۰۰	۴,۱۶۸,۰۴۸,۲۳۶	۳,۹۸۸,۱۷۴,۴۳۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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

۱۴۰۰/۰۶/۳۱				۱۴۰۰/۰۵/۳۱				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 آیان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۵/۳۱				۱۴۰۰/۰۶/۳۱			
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 ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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)

۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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 ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۶/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۵/۳۱					
درصد به کل	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	سپرده
دارایی‌ها									
۷۵.۳۷٪	۵۶,۶۴۳,۸۵۵,۶۰۹	۳,۵۲۸,۱۲۸,۸۹۹	۴۷۷,۰۳۳,۲۸۵	۵۹,۶۹۴,۹۵۱,۲۲۳	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۱۳٪	۹۷,۴۵۰,۴۱۱	۲۰,۳۱۹,۳۸۷,۱۶۵	۲۰,۳۱۹,۳۸۷,۱۶۵	۹۷,۴۵۰,۴۱۱	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۴۴٪	۳۳۴,۴۳۴,۷۵۴	۱۶,۷۷۲,۰۲۲,۸۲۷	۳۷۶,۰۸۸,۲۱۶	۱۶,۷۳۰,۳۶۹,۳۶۵	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۱.۰۴٪	۷۸۳,۹۷۹,۷۴۶	۱۹,۲۳۵,۴۳۹	۶,۶۰۲,۳۸۳	۷۹۶,۶۱۲,۸۰۲	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۷۶.۹۹٪	۵۷,۸۵۹,۷۲۰,۵۲۰	۴۰,۶۳۸,۷۷۴,۳۳۰	۲۱,۱۷۹,۱۱۱,۰۴۹	۷۷,۳۱۹,۳۸۳,۸۰۱					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۵/۳۱				۱۴۰۰/۰۶/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی				خرید طی ماه				خالص ارزش فروش				بهای تمام شده			
تاریخ سررسید				تعداد				بهای تمام شده				تعداد			
نرخ سود				مبلغ فروش				خالص ارزش فروش				درصد به کل دارایی‌ها			
نرخ فروش															
بورسی یا فرابورسی															

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۰۶/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		۲,۳۵۵,۰۷۶,۵۱۹	۵۸.۹۶٪	۳.۱۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار			۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی		۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	۴۱.۰۴٪	۲.۱۸٪
جمع		۳,۹۹۴,۵۴۹,۵۷۲	۱۰۰٪	۵.۳۲٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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

نام شرکت	از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					طی ماه			
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	درصد از کل درآمدها
سایپا دیزل	۰	(۳,۵۱۹,۶۴۱,۸۳۱)	۶۱,۱۰۷,۱۹۲	(۳,۴۵۸,۵۳۴,۶۳۹)	۱۱۶.۲۹٪	۰	(۳,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۳)	۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲	۲,۳۵۵,۰۷۶,۵۱۹
جمع	۰	(۳,۵۱۹,۶۴۱,۸۳۱)	۶۱,۱۰۷,۱۹۲	(۳,۴۵۸,۵۳۴,۶۳۹)	۱۱۶.۲۹٪	۰	(۳,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۳)	۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲	۲,۳۵۵,۰۷۶,۵۱۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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
جمع				۰	۰	۰	۰	۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۲-۱-۲- در آمد 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	
(۲,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۳)	۱۹,۷۹۹,۵۹۶,۰۹۵	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۱	۴,۷۸۷,۰۳۷	(۳,۵۱۹,۶۴۱,۸۳۱)	۲۰,۵۵۳,۳۲۵,۱۴۳	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۱	۴,۷۸۷,۰۳۷	سایپا دیزل
(۲,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۳)	۱۹,۷۹۹,۵۹۶,۰۹۵	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۱	۴,۷۸۷,۰۳۷	-۳,۵۱۹,۶۴۱,۸۳۱	۲۰,۵۵۳,۳۲۵,۱۴۳	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۱	۴,۷۸۷,۰۳۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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
سایپا دیزل	۲۰۰,۰۰۰	۸۸۸,۳۲۴,۳۶۵	۸۲۷,۲۱۷,۱۷۳	۶۱,۱۰۷,۱۹۲	۱۲,۶۰۰,۰۰۰	۴۴,۹۲۷,۱۷۹,۸۱۵	۳۹,۸۰۶,۱۹۰,۵۱۳	۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲
جمع	۲۰۰,۰۰۰	۸۸۸,۳۲۴,۳۶۵	۸۲۷,۲۱۷,۱۷۳	۶۱,۱۰۷,۱۹۲	۱۲,۶۰۰,۰۰۰	۴۴,۹۲۷,۱۷۹,۸۱۵	۳۹,۸۰۶,۱۹۰,۵۱۳	۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۶/۳۱				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 ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی ماه	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
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	۴۷۷,۰۳۳,۲۸۵	۱,۴۷۸,۲۸۸,۰۱۰	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۲۵۷,۹۳۱	۱۴۱,۲۲۱,۶۱۱	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	۶,۶۰۲,۳۸۳	۱۹,۹۶۳,۴۳۲	
جمع		۴۸۳,۸۹۳,۵۹۹	۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

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
۱,۴۷۸,۲۸۸,۰۱۰	۰	۱,۴۷۸,۲۸۸,۰۱۰	۴۷۷,۰۳۳,۲۸۵	۰	۴۷۷,۰۳۳,۲۸۵	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۴۱,۲۲۱,۶۱۱	۰	۱۴۱,۲۲۱,۶۱۱	۲۵۷,۹۳۱	۰	۲۵۷,۹۳۱	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۹,۹۶۳,۴۳۲	۰	۱۹,۹۶۳,۴۳۲	۶,۶۰۲,۳۸۳	۰	۶,۶۰۲,۳۸۳	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	۰	۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	۴۸۳,۸۹۳,۵۹۹	۰	۴۸۳,۸۹۳,۵۹۹				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق	۱۴۰۰/۰۶/۳۱ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	.	.	