



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۰۷/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۸/۳۰			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق	فروش طی ماه		خرید طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده				
سایپا دیزل	۴,۷۸۷,۰۳۷	۲۰,۳۵۰,۴۳۷,۴۶۷	۱۵,۷۸۰,۴۳۲,۸۱۲	۲۴.۸۳٪	۷,۱۳۷,۱۴۹	۲۶,۹۶۸,۴۱۸,۷۰۴	(۶,۵۳۴,۲۷۳)	۲۵,۳۸۰,۰۲۷,۲۴۳	۳,۸۳۱	۲۰,۹۰۷,۹۳۶,۹۲۸	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۸	۲۴.۸۳٪
جمع		۲۰,۳۵۰,۴۳۷,۴۶۷	۱۵,۷۸۰,۴۳۲,۸۱۲	۲۴.۸۳٪	۷,۱۳۷,۱۴۹	۲۶,۹۶۸,۴۱۸,۷۰۴	(۶,۵۳۴,۲۷۳)	۲۵,۳۸۰,۰۲۷,۲۴۳	۳,۸۳۱	۲۰,۹۰۷,۹۳۶,۹۲۸	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۸	۲۴.۸۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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

۱۴۰۰/۰۸/۳۰				۱۴۰۰/۰۷/۳۰				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 بر ترفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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

۱۴۰۰/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۷/۳۰		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										
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 ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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)

۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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 ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۷/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۶۸.۹۲٪	۵۷,۲۸۶,۵۶۰,۰۰۳	۲۴۳,۳۸۳,۹۵۶	۹۳۲,۱۹۶,۹۶۲	۵۶,۵۹۷,۷۴۶,۹۹۷	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۱۵٪	۱۲۳,۳۵۱,۷۶۰	۴,۹۲۲,۲۲۹,۹۸۹	۴,۹۴۲,۱۵۸,۷۳۹	۱۰۳,۴۲۳,۰۱۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۱۲٪	۱۰۰,۶۷۸,۵۹۷	۴,۶۹۸,۷۷۴,۷۸۳	۴,۴۵۰,۹۷۴,۰۲۲	۳۴۸,۴۷۹,۳۵۸	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۷۹٪	۶۵۵,۶۰۷,۶۳۸	۰	۱۰,۶۴۵,۶۸۴	۶۴۴,۹۶۱,۹۵۴	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۶۹.۹۸٪	۵۸,۱۶۶,۱۹۷,۹۹۸	۹,۸۶۴,۳۸۸,۷۲۸	۱۰,۳۳۵,۹۷۵,۴۰۷	۵۷,۶۹۴,۶۱۱,۳۱۹					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۱-۴- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۸/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۷/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
			مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								
درصد به کل دارایی‌ها														

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۸/۳۰	یادداشت	شرح
۳.۹۳٪	۷۷.۱۷٪	۴,۳۶۶,۰۶۵,۳۹۴		سرمایه‌گذاری در سهام
۰.۰۰٪	۰.۰۰٪	۰		سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار
۱.۱۴٪	۲۲.۳۷٪	۲,۵۸۵,۸۵۳,۳۴۲		درآمد سپرده بانکی
۵.۰۷٪	۱۰۰٪	۶,۹۵۱,۹۱۸,۷۳۶		جمع



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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	
۶۲.۳۲٪	۴,۳۶۶,۰۶۵,۳۹۴	۴,۵۰۰,۳۲۶,۰۸۶	(۱۳۴,۲۶۰,۶۹۲)	۰	۷۷.۱۷٪	۳,۲۶۴,۲۳۹,۳۷۴	(۶۲۰,۶۶۳,۲۱۶)	۳,۸۸۴,۹۰۲,۵۹۰	۰	سایپا دیزل
۶۲.۳۲٪	۴,۳۶۶,۰۶۵,۳۹۴	۴,۵۰۰,۳۲۶,۰۸۶	(۱۳۴,۲۶۰,۶۹۲)	۰	۷۷.۱۷٪	۳,۲۶۴,۲۳۹,۳۷۴	(۶۲۰,۶۶۳,۲۱۶)	۳,۸۸۴,۹۰۲,۵۹۰	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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									

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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	
-۱۳۴,۲۶۰,۶۹۳	۲۰,۷۶۷,۳۲۴,۳۴۰	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۷	۵,۳۸۹,۹۱۳	۳,۸۸۴,۹۰۲,۵۹۰	۱۶,۷۴۸,۱۶۱,۰۵۷	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۷	۵,۳۸۹,۹۱۳	سایپا دیزل
(۱۳۴,۲۶۰,۶۹۳)	۲۰,۷۶۷,۳۲۴,۳۴۰	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۷	۵,۳۸۹,۹۱۳	۳,۸۸۴,۹۰۲,۵۹۰	۱۶,۷۴۸,۱۶۱,۰۵۷	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۷	۵,۳۸۹,۹۱۳	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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	
۴,۵۰۰,۳۲۶,۰۸۶	۳۹,۸۰۶,۱۹۰,۵۱۳	۴۴,۹۲۷,۱۷۹,۸۱۵	۱۹,۱۳۴,۲۷۳	(۶۲۰,۶۶۳,۲۱۶)	۲۶,۰۰۰,۶۹۰,۴۵۹	۲۵,۳۸۰,۰۲۷,۲۴۳	۶,۵۳۴,۲۷۳	سایپا دیزل
۴,۵۰۰,۳۲۶,۰۸۶	۳۹,۸۰۶,۱۹۰,۵۱۳	۴۴,۹۲۷,۱۷۹,۸۱۵	۱۹,۱۳۴,۲۷۳	(۶۲۰,۶۶۳,۲۱۶)	۲۶,۰۰۰,۶۹۰,۴۵۹	۲۵,۳۸۰,۰۲۷,۲۴۳	۶,۵۳۴,۲۷۳	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۸/۳۰			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 ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۲-۳- 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
	۲,۴۱۰,۴۸۴,۹۷۲		۹۳۲,۱۹۶,۹۶۲	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱۴۴,۷۵۹,۲۵۴		۳,۵۳۷,۶۴۳	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۳۰,۶۰۹,۱۱۶		۱۰,۶۴۵,۶۸۴	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	<b>۲,۵۸۵,۸۵۳,۳۴۲</b>		<b>۹۴۶,۳۸۰,۲۸۹</b>		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

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
۲,۴۱۰,۴۸۴,۹۷۲	.	۲,۴۱۰,۴۸۴,۹۷۲	۹۳۲,۱۹۶,۹۶۲	.	۹۳۲,۱۹۶,۹۶۲	.		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۴۴,۷۵۹,۲۵۴	.	۱۴۴,۷۵۹,۲۵۴	۳,۵۳۷,۶۴۳	.	۳,۵۳۷,۶۴۳	.		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۰,۶۰۹,۱۱۶	.	۳۰,۶۰۹,۱۱۶	۱۰,۶۴۵,۶۸۴	.	۱۰,۶۴۵,۶۸۴	.		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۲,۵۸۵,۸۵۳,۳۴۲	.	۲,۵۸۵,۸۵۳,۳۴۲	۹۴۶,۳۸۰,۲۸۹	.	۹۴۶,۳۸۰,۲۸۹				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۸/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۸/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
***	***	.	.	