



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت یرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۴۰۰/۰۹/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۸/۳۰			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				
۲۴.۳۴٪	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۲۲,۴۳۷,۰۶۹,۵۸۰	۳,۱۶۹	۶,۵۳۲,۱۶۶	۳۵,۷۲۵,۵۳۵,۵۸۵	(۱۰,۷۸۴,۹۵۴)	۴۰,۲۹۹,۶۰۲,۹۵۰	۱۱,۹۲۷,۲۰۷	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۸	۲۰,۹۰۷,۹۳۶,۹۲۸	۵,۳۸۹,۹۱۳	سایپا دیزل
۲۴.۳۴٪	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۲۲,۴۳۷,۰۶۹,۵۸۰			۳۵,۷۲۵,۵۳۵,۵۸۵	(۱۰,۷۸۴,۹۵۴)	۴۰,۲۹۹,۶۰۲,۹۵۰	۱۱,۹۲۷,۲۰۷	۲۰,۶۳۳,۰۶۳,۶۴۸	۲۰,۹۰۷,۹۳۶,۹۲۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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

۱۴۰۰/۰۹/۳۰				۱۴۰۰/۰۸/۳۰				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 آیان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۸/۳۰				۱۴۰۰/۰۹/۳۰			
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 ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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)

۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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 ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۸/۳۰					سپرده
مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۵۷,۷۵۷,۴۰۸,۴۴۱	۶۷.۹۷٪	۴۶۵,۱۸۶,۹۶۲	۹۳۶,۰۳۵,۴۰۰	۵۷,۲۸۶,۵۶۰,۰۰۳	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۰۲,۹۲۹,۷۶۰	۰.۱۲٪	۲۰,۴۲۲,۰۰۰	۰	۱۲۳,۳۵۱,۷۶۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۰۱,۵۰۶,۰۹۲	۰.۱۲٪	۲,۷۲۱,۸۸۵	۳,۵۴۹,۳۸۰	۱۰۰,۶۷۸,۵۹۷	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۶۶۰,۹۹۶,۱۹۴	۰.۷۸٪	۰	۵,۳۸۸,۵۵۶	۶۵۵,۶۰۷,۶۳۸	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۵۸,۶۲۲,۸۴۰,۴۸۷	۶۸.۹۹٪	۴۸۸,۳۳۰,۸۴۷	۹۴۴,۹۷۳,۳۳۶	۵۸,۱۶۶,۱۹۷,۹۹۸					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۸/۳۰				۱۴۰۰/۰۹/۳۰			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی				خرید طی ماه				بهای تمام شده				فروش طی ماه			
تاریخ سررسید				تعداد				بهای تمام شده				مبلغ فروش			
نرخ سود				تعداد				تعداد				خالص ارزش فروش			
نرخ فروش				تعداد				تعداد				خالص ارزش فروش			
بورسی یا فرابورسی				تعداد				تعداد				درصد به کل دارایی‌ها			

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۱۵۶,۳۶۳,۸۹۴)	۷۷.۱۷٪	۳.۹۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱	۲۲.۳۷٪	۱.۱۴٪
جمع		۲,۹۰۶,۵۵۳,۹۳۷	۱۰۰٪	۵.۰۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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
سایپا دیزل	۰	(۱,۵۸۳,۳۶۱,۹۲۹)	(۲,۹۳۹,۰۶۷,۳۵۸)	(۴,۵۲۲,۴۲۹,۲۸۷)	۱۱۲.۵۵٪	۰	(۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۲)	۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸	(۱۵۶,۳۶۳,۸۹۴)	-۵.۲۳٪
جمع	۰	(۱,۵۸۳,۳۶۱,۹۲۹)	(۲,۹۳۹,۰۶۷,۳۵۸)	(۴,۵۲۲,۴۲۹,۲۸۷)	۱۱۲.۵۵٪	۰	(۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۲)	۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸	(۱۵۶,۳۶۳,۸۹۴)	-۵.۲۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۱-۱-۲- درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع			تغییرات طی دوره			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			نام شرکت
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	
			۰	۰	۰	۰	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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	
-۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۳	۲۲,۴۰۲,۳۲۴,۳۴۷	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۶,۵۳۲,۱۶۶	-۱,۵۸۳,۳۶۱,۹۲۹	۲۲,۲۶۸,۰۶۳,۶۵۴	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۶,۵۳۲,۱۶۶	سایپا دیزل
(۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۳)	۲۲,۴۰۲,۳۲۴,۳۴۷	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۶,۵۳۲,۱۶۶	-۱,۵۸۳,۳۶۱,۹۲۹	۲۲,۲۶۸,۰۶۳,۶۵۴	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۶,۵۳۲,۱۶۶	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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	۱۰,۷۸۴,۹۵۴	۳۵,۷۲۵,۵۳۵,۵۸۵	۳۸,۶۶۴,۶۰۲,۹۴۳	(۲,۹۳۹,۰۶۷,۳۵۸)	۲۹,۹۱۹,۲۲۷	۱۰۶,۰۳۲,۷۴۲,۶۴۳	۱۰۴,۴۷۱,۴۸۳,۹۱۵	۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸
جمع	۱۰,۷۸۴,۹۵۴	۳۵,۷۲۵,۵۳۵,۵۸۵	۳۸,۶۶۴,۶۰۲,۹۴۳	(۲,۹۳۹,۰۶۷,۳۵۸)	۲۹,۹۱۹,۲۲۷	۱۰۶,۰۳۲,۷۴۲,۶۴۳	۱۰۴,۴۷۱,۴۸۳,۹۱۵	۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۰۹/۳۰				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 ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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
	۲,۸۸۱,۳۳۳,۴۱۰		۴۷۰,۸۴۸,۴۳۸	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۱۴۵,۵۸۶,۷۴۹		۸۲۷,۴۹۵	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۳۵,۹۹۷,۶۷۲		۵,۳۸۸,۵۵۶	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱		۴۷۷,۰۶۴,۴۸۹		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

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
۲,۸۸۱,۳۳۳,۴۱۰	۰	۲,۸۸۱,۳۳۳,۴۱۰	۴۷۰,۸۴۸,۴۳۸	۰	۹۳۲,۱۹۶,۹۶۲	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۴۵,۵۸۶,۷۴۹	۰	۱۴۵,۵۸۶,۷۴۹	۸۲۷,۴۹۵	۰	۳,۵۳۷,۶۴۳	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۵,۹۹۷,۶۷۲	۰	۳۵,۹۹۷,۶۷۲	۵,۳۸۸,۵۵۶	۰	۱۰,۶۴۵,۶۸۴	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱	۰	۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱	۴۷۷,۰۶۴,۴۸۹	۰	۹۴۶,۳۸۰,۲۸۹				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۰۹/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	.	.	