



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۰۹/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۰/۳۰			درصد به کل دارایی‌های صندوق
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	قیمت بازار	
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				
سایپا دیزل	۶,۵۳۲,۱۶۶	۲۲,۴۳۷,۰۶۹,۵۸۰	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۷,۴۰۰,۲۸۰	۲۸,۲۱۱,۹۷۷,۹۰۶	(۱۳,۸۵۷,۳۲۹)	۵۰,۷۱۰,۶۹۰,۹۱۸	۷۵,۱۱۷	۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۰.۴۳٪
جمع		۲۲,۴۳۷,۰۶۹,۵۸۰	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	۷,۴۰۰,۲۸۰	۲۸,۲۱۱,۹۷۷,۹۰۶	(۱۳,۸۵۷,۳۲۹)	۵۰,۷۱۰,۶۹۰,۹۱۸		۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۰.۴۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت برتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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

۱۴۰۰/۱۰/۳۰				۱۴۰۰/۰۹/۳۰				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 تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۰۹/۳۰		۱۴۰۰/۱۰/۳۰				
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 ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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)

۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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 ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده		شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	۰	۵۷,۷۵۷,۴۰۸,۴۴۱	۴۷۳,۸۹۹,۱۰۳	۹۹,۶۸۴,۲۱۷	۵۸,۱۳۱,۶۲۳,۳۲۷	۷۶.۶۶٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۳۲۳۷۵۸	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	۰	۱۰۲,۹۲۹,۷۶۰	۱۹,۸۷۲,۵۰۷,۷۱۰	۱۹,۸۷۲,۹۴۷,۶۴۰	۱۰۲,۴۸۹,۸۳۰	۰.۱۴٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	۰	۱۰۱,۵۰۶,۰۹۲	۳۶,۱۴۰,۰۵۵,۷۱۰	۱۹,۷۷۲,۸۲۳,۴۹۳	۱۶,۴۶۸,۷۳۸,۳۰۹	۲۱.۷۲٪	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	۰	۶۶۰,۹۹۶,۱۹۴	۵,۴۳۲,۸۴۵	۰	۶۶۶,۴۲۹,۰۳۹	۰.۸۸٪	
جمع					۵۸,۶۲۲,۸۴۰,۴۸۷	۵۶,۴۹۱,۸۹۵,۳۶۸	۳۹,۷۴۵,۴۵۵,۳۵۰	۷۵,۳۶۹,۲۸۰,۵۰۵	۹۹.۴۰٪	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۰۹/۳۰				۱۴۰۰/۱۰/۳۰			
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	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۱۰/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		۱,۹۸۶,۷۱۰,۰۴۳	۷۷.۱۷٪	۳.۹۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳,۵۴۳,۰۸۴,۰۷۵	۲۲.۳۷٪	۱.۱۴٪
جمع		۵,۵۲۹,۷۹۴,۱۱۸	۱۰۰٪	۵.۰۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۲-۱- 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	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۲,۱۴۳,۰۷۳,۹۳۸	۸۰.۵۱٪	۰	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۳۵.۱۷٪
جمع	۰	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۲,۱۴۳,۰۷۳,۹۳۸	۸۰.۵۱٪	۰	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۳۵.۱۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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				۰	۰	۰	۰	۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۲-۱-۲- درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
سایپا دیزل	۷۵,۱۱۷	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	-۱,۳۸۹,۸۹۶,۱۷۱	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۷۵,۱۱۷	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۱,۳۳۶,۱۹۸
جمع	۷۵,۱۱۷	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	-۱,۳۸۹,۸۹۶,۱۷۱	۱,۷۱۸,۹۵۸,۸۲۱	۷۵,۱۱۷	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۱,۳۳۶,۱۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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	۱۳,۸۵۷,۳۲۹	۵۰,۷۱۰,۶۹۰,۹۱۸	۵۰,۲۸۶,۵۷۵,۸۰۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۴۳,۷۷۶,۵۵۶	۱۵۶,۷۴۳,۴۳۳,۵۶۱	۱۵۴,۷۵۸,۰۵۹,۷۱۶	۱,۹۸۵,۳۷۳,۸۴۵
جمع	۱۳,۸۵۷,۳۲۹	۵۰,۷۱۰,۶۹۰,۹۱۸	۵۰,۲۸۶,۵۷۵,۸۰۱	۴۲۴,۱۱۵,۱۱۷	۴۳,۷۷۶,۵۵۶	۱۵۶,۷۴۳,۴۳۳,۵۶۱	۱۵۴,۷۵۸,۰۵۹,۷۱۶	۱,۹۸۵,۳۷۳,۸۴۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۱۰/۳۰			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 ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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	۴۷۳,۸۹۹,۱۰۳	۳,۳۵۵,۲۳۲,۵۱۳	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۸۳۴,۲۹۶	۱۴۶,۴۲۱,۰۴۵	
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	۵,۴۳۲,۸۴۵	۴۱,۴۳۰,۵۱۷	
جمع		۴۸۰,۱۶۶,۲۴۴	۳,۵۴۳,۰۸۴,۰۷۵	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

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
۳,۳۵۵,۲۳۲,۵۱۳	۰	۳,۳۵۵,۲۳۲,۵۱۳	۴۷۳,۸۹۹,۱۰۳	۰	۴۷۳,۸۹۹,۱۰۳	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۴۶,۴۲۱,۰۴۵	۰	۱۴۶,۴۲۱,۰۴۵	۸۳۴,۲۹۶	۰	۸۳۴,۲۹۶	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۱,۴۳۰,۵۱۷	۰	۴۱,۴۳۰,۵۱۷	۵,۴۳۲,۸۴۵	۰	۵,۴۳۲,۸۴۵	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۳,۵۴۳,۰۸۴,۰۷۵	۰	۳,۵۴۳,۰۸۴,۰۷۵	۴۸۰,۱۶۶,۲۴۴	۰	۴۸۰,۱۶۶,۲۴۴				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۰/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۱۰/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
♦♦♦	♦♦♦	♦	♦	