



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت برتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۱۰/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه	تعداد	بهای تمام شده	فروش طی ماه	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده
سایپا دیزل	۷۵,۱۱۷	۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۱,۵۳۴,۸۹۰	۶,۱۰۶,۸۱۵,۷۸۸	(۱,۶۱۰,۰۰۷)	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۰	۰	۰	۰
جمع		۳۲۷,۷۲۶,۴۵۲	۳۲۹,۰۶۲,۶۵۰	۱,۵۳۴,۸۹۰	۶,۱۰۶,۸۱۵,۷۸۸	(۱,۶۱۰,۰۰۷)	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۰	۰	۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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

۱۴۰۰/۱۱/۳۰				۱۴۰۰/۱۰/۳۰				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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۱۰/۳۰		۱۴۰۰/۱۱/۳۰				
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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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)

۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۱۰/۳۰						سپرده
درصد به کل	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب		
دارایی‌ها										
۷۶.۳۶٪	۵۸,۶۰۹,۴۱۷,۴۹۱	۰	۴۷۷,۷۹۴,۱۶۴	۵۸,۱۳۱,۶۲۳,۳۲۷	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس	
۰.۱۴٪	۱۰۲,۳۰۷,۸۳۰	۳,۲۹۱,۳۱۶,۵۱۱	۳,۲۹۱,۱۳۴,۵۱۱	۱۰۲,۴۸۹,۸۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس	
۲۱.۴۹٪	۱۶,۲۷۹,۳۶۹,۷۳۶	۳,۲۹۱,۱۳۴,۵۱۱	۳,۱۰۱,۷۶۵,۹۳۸	۱۶,۴۶۸,۷۳۸,۳۰۹	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس	
۰.۸۹٪	۶۷۱,۹۰۶,۵۳۸	۰	۵,۴۷۷,۴۹۹	۶۶۶,۴۲۹,۰۳۹	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس	
۹۸.۸۸٪	۷۵,۶۶۳,۰۰۱,۵۹۵	۶,۵۸۲,۴۵۱,۰۲۲	۶,۸۷۶,۱۷۲,۱۱۲	۷۵,۳۶۹,۲۸۰,۵۰۵					جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت یر تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده										تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰	
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فراپورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۱۱/۳۰	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	-۴۰.۷۹٪	-۰.۲۳٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۴,۱۳۴,۷۵۱,۸۹۲	۱۳۹.۶۷٪	۰.۷۸٪
جمع		۵,۹۴۸,۶۵۳,۶۹۹	۹۹٪	۰.۵۵٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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	مبلغ	درصد از کل درآمدها
سایپا دیزل	۰	(۱,۳۳۶,۱۹۸)	(۱۷۱,۴۷۲,۰۳۸)	(۱۷۲,۸۰۸,۲۳۶)	-۴۰.۷۹٪	۰	۰	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۲۹.۸۷٪
جمع	۰	(۱,۳۳۶,۱۹۸)	(۱۷۱,۴۷۲,۰۳۸)	(۱۷۲,۸۰۸,۲۳۶)	-۴۰.۷۹٪	۰	۰	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۲۹.۸۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آیان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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
سایپا دیزل	۰	۰	۱,۳۳۶,۱۹۸	-۱,۳۳۶,۱۹۸	۰	۰	۰
جمع	۰	۰	۱,۳۳۶,۱۹۸	-۱,۳۳۶,۱۹۸	۰	۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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
سایپا دیزل	۱,۶۱۰,۰۰۷	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۶,۴۳۴,۵۴۲,۲۴۰	(۱۷۱,۴۷۲,۰۳۸)	۴۵,۳۸۶,۵۶۳	۱۶۳,۰۰۶,۵۰۳,۷۶۳	۱۶۱,۱۹۲,۶۰۱,۹۵۶
جمع	۱,۶۱۰,۰۰۷	۶,۲۶۳,۰۷۰,۲۰۲	۶,۴۳۴,۵۴۲,۲۴۰	(۱۷۱,۴۷۲,۰۳۸)	۴۵,۳۸۶,۵۶۳	۱۶۳,۰۰۶,۵۰۳,۷۶۳	۱۶۱,۱۹۲,۶۰۱,۹۵۶
							سود و زیان ناشی از فروش
							۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰				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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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
	۳,۸۳۳,۰۲۶,۶۷۷		۴۷۷,۷۹۴,۱۶۴	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۲۵۴,۸۱۷,۱۹۹		۱۰۸,۳۹۶,۱۵۴	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴۶,۹۰۸,۰۱۶		۵,۴۷۷,۴۹۹	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴,۱۳۴,۷۵۱,۸۹۲		۵۹۱,۶۶۷,۸۱۷		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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
۳,۸۳۳,۰۲۶,۶۷۷	۰	۳,۸۳۳,۰۲۶,۶۷۷	۴۷۷,۷۹۴,۱۶۴	۰	۴۷۷,۷۹۴,۱۶۴	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۵۴,۸۱۷,۱۹۹	۰	۲۵۴,۸۱۷,۱۹۹	۱۰۸,۳۹۶,۱۵۴	۰	۱۰۸,۳۹۶,۱۵۴	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۶,۹۰۸,۰۱۶	۰	۴۶,۹۰۸,۰۱۶	۵,۴۳۲,۸۴۵	۰	۵,۴۷۷,۴۹۹	۰		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴,۱۳۴,۷۵۱,۸۹۲	۰	۴,۱۳۴,۷۵۱,۸۹۲	۵۹۱,۶۲۳,۱۶۳	۰	۵۹۱,۶۶۷,۸۱۷				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۱۱/۳۰ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		۰	۰	سایر درآمدها
		۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۰.۰۰	۰.۰۰	۰	۰	