



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۲۹ اسفند ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۱-سرمایه گذاری ها

۱-۱-سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۰/۱۱/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۲/۲۹				
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی های صندوق
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش					
جمع												

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۰/۱۲/۲۹				۱۴۰۰/۱۱/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بر ترفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۱-۲ سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۴۰۰/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰		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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

(بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری)

۱۴۰۰/۱۲/۲۹

نام شرکت

تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل
-------	-------------	------------------	------------	-------------------------	-------

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۳-۱-سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۰/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۱۱/۳۰					سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۷۸.۲۸٪	۵۹,۷۴۶,۹۸۷,۸۹۴	۰	۱,۱۳۷,۵۷۰,۴۰۳	۵۸,۶۰۹,۴۱۷,۴۹۱	۰	۱۳۹۸/۰۷/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۱۳٪	۱۰۲,۳۰۷,۸۳۰	۰	۰	۱۰۲,۳۰۷,۸۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۱.۵۰٪	۱۶,۴۰۸,۷۱۲,۶۷۳	۰	۱۲۹,۳۴۲,۹۳۷	۱۶,۲۷۹,۳۶۹,۷۳۶	۰	۱۳۹۹/۰۱/۲۵	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۰	۶۷۱,۹۰۶,۵۳۸	۰	۶۷۱,۹۰۶,۵۳۸	۰	۱۳۹۹/۰۳/۱۳	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۰٪	۷۶,۲۵۸,۰۰۸,۳۹۷	۶۷۱,۹۰۶,۵۳۸	۱,۲۶۶,۹۱۳,۳۴۰	۷۵,۶۶۳,۰۰۱,۵۹۵					جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۴-۱- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۰/۱۲/۲۹			تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده					
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	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								

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام		۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	-۴۰.۷۹٪	-۰.۲۳٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۴,۷۲۹,۷۵۸,۶۹۴	۱۳۹.۶۷٪	۰.۷۸٪
جمع		۶,۵۴۳,۶۶۰,۵۰۱	۹۹٪	۰.۵۵٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۲-۱- درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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	
۳۷.۳۰٪	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	سایپا دیزل
۰.۰۰٪	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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 سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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	۴۵,۳۸۶,۵۶۳	۱۶۱,۱۹۲,۶۰۱,۹۵۶	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷
جمع	۴۵,۳۸۶,۵۶۳	۱۶۱,۱۹۲,۶۰۱,۹۵۶	۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۰/۱۲/۲۹			توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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
	۴,۲۹۸,۶۹۰,۵۴۲		۴۶۵,۶۶۳,۸۶۵	۱۰۴۴۵۶۴۵۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۳۸۴,۱۶۰,۱۳۶		۱۲۹,۳۴۲,۹۳۷	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴۶,۹۰۸,۰۱۶		۰	۱۰۴۴۵۶۷۱۵	بانک تجارت تخصصی بورس
	۴,۷۲۹,۷۵۸,۶۹۴		۵۹۵,۰۰۶,۸۰۲		جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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
۴,۲۹۸,۶۹۰,۵۴۲	.	۴,۲۹۸,۶۹۰,۵۴۲	۴۶۵,۶۶۳,۸۶۵	.	۴۶۵,۶۶۳,۸۶۵	.		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۸۴,۱۶۰,۱۳۶	.	۳۸۴,۱۶۰,۱۳۶	۱۲۹,۳۴۲,۹۳۷	.	۱۲۹,۳۴۲,۹۳۷	.		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴۶,۹۰۸,۰۱۶	.	۴۶,۹۰۸,۰۱۶		۱۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۴,۷۲۹,۷۵۸,۶۹۴	.	۴,۷۲۹,۷۵۸,۶۹۴	۵۹۵,۰۰۶,۸۰۲	.	۵۹۵,۰۰۶,۸۰۲				

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۰/۱۲/۲۹ مبلغ	طی دوره مبلغ	سایر درآمدها
		.	.	سایر درآمدها
		.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
		.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
***	***	.	.	