



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

برای ماه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۱-سرمایه گذاری ها

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

| ۱۴۰۱/۰۶/۳۱                  |                |                |            |           | تغییرات طی دوره |              |                 |            | ۱۴۰۱/۰۵/۳۱     |                |          |                               | نام شرکت |
|-----------------------------|----------------|----------------|------------|-----------|-----------------|--------------|-----------------|------------|----------------|----------------|----------|-------------------------------|----------|
| درصد به کل دارایی های 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      |                |                |          |                               |          |
|                             |                |                |            |           |                 |              |                 |            |                |                |          |                               |          |
| ۹۶.۵۱٪                      | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹۴,۴۱۴,۴۴۵,۱۲۴ | ۱۰,۱۷۵     | ۹,۲۸۸,۹۳۴ | ۸۲۷,۷۲۸,۶۴۶,۵۱۳ | (۸۲,۲۸۹,۲۴۵) | ۸۵۷,۴۷۸,۸۶۷,۷۳۳ | ۸۵,۱۸۵,۴۹۶ | ۶۵۱۹۰,۱۳۶,۵۱۲  | ۶۵۱۱۶,۳۸۹,۸۹۲  | ۶۳۹۲,۶۸۳ | صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت |          |
| ۰.۰۰٪                       | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹۴,۴۱۴,۴۴۵,۱۲۴ |            |           | ۸۲۷,۷۲۸,۶۴۶,۵۱۳ | (۸۲,۲۸۹,۲۴۵) | ۸۵۷,۴۷۸,۸۶۷,۷۳۳ |            | ۶۵,۱۹۰,۱۳۶,۵۱۲ | ۶۵,۱۱۶,۳۸۹,۸۹۲ |          | جمع                           |          |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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

| ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ |             |            |                  | ۱۴۰۱/۰۵/۳۱ |             |            |                  | 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 پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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

| اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                      |                   |              |              |         |          |       |               |                | ۱۴۰۱/۰۵/۳۱ |               | تغییرات طی دوره |           | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ |                    |               |                |                             |
|------------------------------------|----------------------|-------------------|--------------|--------------|---------|----------|-------|---------------|----------------|------------|---------------|-----------------|-----------|------------|--------------------|---------------|----------------|-----------------------------|
| نام اوراق                          | دارای مجوز از سازمان | بورسی یا فرابورسی | تاریخ انتشار | تاریخ سررسید | نرخ سود | نرخ موثر | تعداد | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | تعداد      | بهای تمام شده | تعداد           | مبلغ فروش | تعداد      | قیمت بازار هر ورقه | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | درصد به کل دارایی های صندوق |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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)

۱۴۰۱/۰۶/۳۱

| 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 ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| ۱۴۰۱/۰۶/۳۱           |             | تغییرات طی دوره   |                   | ۱۴۰۱/۰۵/۳۱     |      |            |                 |                    |                       | سپرده |
|----------------------|-------------|-------------------|-------------------|----------------|------|------------|-----------------|--------------------|-----------------------|-------|
| درصد به کل دارایی ها |             | مبلغ              | کاهش              | افزایش         | مبلغ | نرخ سود    | تاریخ افتتاح    | نوع حساب           | شماره حساب            |       |
| ۰.۱۰٪                | ۱۰۰,۰۹۴,۳۳۰ | ۷۲۵,۰۴۷,۴۹۹,۶۰۳   | ۷۲۵,۰۴۶,۲۴۵,۶۰۳   | ۱۰۱,۳۴۸,۳۳۰    | ۰    | ۱۳۹۸/۰۹/۱۳ | حساب جاری       | ۱۰۴۳۳۷۵۸           | بانک تجارت تخصصی بورس |       |
| ۰.۶۶٪                | ۶۴۳,۹۵۵,۸۱۷ | ۷۶۴,۰۴۷,۲۴۵,۶۰۳   | ۷۵۲,۸۴۹,۱۲۶,۲۴۷   | ۱۱,۸۴۲,۰۷۵,۱۷۳ | ۰    | ۱۴۰۱/۰۳/۰۱ | سپرده کوتاه مدت | ۱۰۴۴۵۷۷۹۷          | بانک تجارت تخصصی بورس |       |
| ۰.۰۲٪                | ۲۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۰                 | ۲۰,۰۰۰,۰۰۰        | ۰              | ۰    | ۱۴۰۱/۰۶/۲۰ | سپرده کوتاه مدت | ۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳ | بانک خاورمیانه بخارست |       |
| ۰.۷۸٪                | ۷۶۴,۰۵۰,۱۴۷ | ۱,۴۸۹,۰۹۴,۷۴۵,۲۰۶ | ۱,۴۷۷,۹۱۵,۳۷۱,۸۵۰ | ۱۱,۹۴۳,۴۲۳,۵۰۳ |      |            |                 |                    | جمع                   |       |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۴-۱- سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

| اطلاعات اوراق گواهی سپرده               |              |         |          | تغییرات طی دوره   |       |               |                | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱  |               |             |           |
|-----------------------------------------|--------------|---------|----------|-------------------|-------|---------------|----------------|-------------|---------------|-------------|-----------|
| سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی | تاریخ سررسید | نرخ سود | نرخ فروش | بورسی یا فرابورسی | تعداد | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | خرید طی ماه |               | فروش طی ماه |           |
|                                         |              |         |          |                   |       |               |                | تعداد       | بهای تمام شده | تعداد       | مبلغ فروش |
|                                         |              |         |          |                   |       |               |                |             |               |             |           |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| شرح                          | یادداشت | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱    | درصد از کل درآمدها | درصد به کل دارایی های صندوق |
|------------------------------|---------|---------------|--------------------|-----------------------------|
| سرمایه گذاری در سهام         |         | (۶۸۲,۱۹۲,۳۵۰) | ۱۰۵.۰۳٪            | -۰.۷۰٪                      |
| سرمایه گذاری در اوراق بهادار |         | ۰             | ۰.۰۰٪              | ۰.۰۰٪                       |
| درآمد سپرده بانکی            |         | ۳۲,۶۴۶,۱۲۱    | -۵.۰۳٪             | ۰.۰۳٪                       |
| جمع                          |         | (۶۴۹,۵۴۶,۲۲۹) | ۱۰۰٪               | -۰.۶۶٪                      |



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازرگانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۱-۲- در آمد 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 |                               |
| -۲۴.۹۳٪                          | (۶۸۲,۱۹۲,۳۵۰) | (۷۷۹,۰۲۳,۹۰۲) | ۹۶,۹۱۴,۰۱۷       | ۰              | -۴۷.۳۴٪            | (۴۲۸,۹۹۸,۵۹۱) | (۴۵۲,۱۶۵,۹۹۰) | ۲۳,۱۶۷,۳۹۹       | ۰              | صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت |
| -۲۴.۹۳٪                          | (۶۸۲,۱۹۲,۳۵۰) | (۷۷۹,۰۲۳,۹۰۲) | ۹۶,۹۱۴,۰۱۷       | ۰              | -۴۷.۳۴٪            | (۴۲۸,۹۹۸,۵۹۱) | (۴۵۲,۱۶۵,۹۹۰) | ۲۳,۱۶۷,۳۹۹       | ۰              | جمع                           |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آیان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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 |
| جمع      |              |                                |                     | ۰                  | ۰           | ۰                                | ۰                  | ۰           |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

**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     |                               |
| ۹۶,۹۱۴,۰۱۷                       | ۹۴,۴۱۴,۴۴۵,۱۲۴ | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹,۲۸۸,۹۳۴ | ۲۳,۱۶۷,۳۹۹                    | ۹۴,۴۸۸,۱۹۱,۷۴۲ | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹,۲۸۸,۹۳۴ | صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت |
| ۹۶,۹۱۴,۰۱۷                       | ۹۴,۴۱۴,۴۴۵,۱۲۴ | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹,۲۸۸,۹۳۴ | ۲۳,۱۶۷,۳۹۹                    | ۹۴,۴۸۸,۱۹۱,۷۴۲ | ۹۴,۵۱۱,۳۵۹,۱۴۱ | ۹,۲۸۸,۹۳۴ | جمع                           |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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 |
| صندوق س.رشد پایدار-درآمد ثابت | ۸۲,۲۸۹,۲۴۵      | ۸۲۷,۷۲۸,۶۴۶,۵۱۳ | ۸۲۸,۱۸۰,۸۱۲,۵۰۳ | (۴۵۲,۱۶۵,۹۹۰)           | ۱۶۳,۰۵۵,۳۶۳                      | ۱,۶۴۳,۴۶۸,۰۴۷,۴۴۱ | ۱,۶۴۴,۲۴۷,۱۵۳,۸۰۸ | (۷۷۹,۰۲۳,۹۰۲)           |
|                               | ۸۲,۲۸۹,۲۴۵      | ۸۲۷,۷۲۸,۶۴۶,۵۱۳ | ۸۲۸,۱۸۰,۸۱۲,۵۰۳ | (۴۵۲,۱۶۵,۹۹۰)           | ۱۶۳,۰۵۵,۳۶۳                      | ۱,۶۴۳,۴۶۸,۰۴۷,۴۴۱ | ۱,۶۴۴,۲۴۷,۱۵۳,۸۰۸ | (۷۷۹,۰۲۳,۹۰۲)           |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دوره |            |                  |                 | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ |            |                  |                 | توضیحات |
|----------------------------------|------------|------------------|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------|---------|
| جمع                              | درآمد فروش | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق | جمع        | درآمد فروش | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق |         |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۳-۲-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             |
|                                  | ۶,۳۸۸,۱۲۷                     |                           | ۰                             | ۱۰۴۴۵۶۴۵۶       | بانک تجارت تخصصی بورس |
|                                  | ۴۴۹,۲۰۵                       |                           | ۰                             | ۱۰۴۴۵۶۶۲۶       | بانک تجارت تخصصی بورس |
|                                  | ۲۵,۸۰۸,۷۸۹                    |                           | ۱۰۳,۳۴۱                       | ۱۰۴۴۵۷۷۹۷       | بانک تجارت تخصصی بورس |
|                                  | ۳۲,۶۴۶,۱۲۱                    |                           | ۱۰۳,۳۴۱                       |                 | جمع                   |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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               |
| ۶,۳۸۸,۱۲۷                        | ۰           | ۶,۳۸۸,۱۲۷  | ۰               | ۰           | ۰         | ۰       |              | ۳۰               | بانک تجارت تخصصی بورس |
| ۴۴۹,۲۰۵                          | ۰           | ۴۴۹,۲۰۵    | ۰               | ۰           | ۰         | ۰       |              | ۱۷               | بانک تجارت تخصصی بورس |
| ۲۵,۸۰۸,۷۸۹                       | ۰           | ۲۵,۸۰۸,۷۸۹ | ۱۰۳,۳۴۱         | ۰           | ۱۰۳,۳۴۱   | ۰       |              | ۳۰               | بانک تجارت تخصصی بورس |
| ۳۲,۶۴۶,۱۲۱                       | ۰           | ۳۲,۶۴۶,۱۲۱ | ۱۰۳,۳۴۱         | ۰           | ۱۰۳,۳۴۱   |         |              |                  |                       |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

| درصد به کل دارایی های صندوق | درصد از کل درآمدها | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱<br>مبلغ | طی دوره<br>مبلغ | سایر درآمدها                           |
|-----------------------------|--------------------|--------------------|-----------------|----------------------------------------|
| ۰.۱۳٪                       | ۱۰۰٪               | ۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸        | ۰               | سایر درآمدها                           |
| ۰.۰۰                        | ۰                  | ۰                  | ۰               | معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک |
| ۰.۰۰                        | ۰                  | ۰                  | ۰               | تعدیل کارمزد کارگزار                   |
| ۰.۱۳٪                       | ۱۰۰.۰۰٪            | ۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸        | ۰               |                                        |