



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

سرمایه‌گذاری‌ها - ۱

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام - ۱-۱

۱۴۰۲/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۲/۲۹				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		
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده					
۴۶.۰۱٪	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷	۱۰,۱۸۶	۴,۲۱۶,۱۱۱	۶۱۶,۷۵۷,۴۲۶,۹۵۴	۶۱,۱۹۳,۲۷۰	۵۷۸,۷۷۴,۹۵۵,۲۶۰	۵۷,۴۷۸,۲۶۲	۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۴۱۱,۷۱۲,۰۸۳	۷,۹۳۱,۱۱۹	صندوق س.رشد پایدار-د	
۴۶.۰۱٪	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷			۶۱۶,۷۵۷,۴۲۶,۹۵۴		۵۷۸,۷۷۴,۹۵۵,۲۶۰		۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	۸۰,۴۱۱,۷۱۲,۰۸۳		جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۱/۳۱				۱۴۰۱/۱۲/۲۹				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 ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۱/۳۱						
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	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 ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

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

۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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 ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۱۲/۲۹						
درصد به کل دارایی‌ها		مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	سپرده
۰.۱۰٪	۹۳,۷۹۹,۳۳۰	۳۵۹,۹۸۹,۴۵۴,۷۶۹	۳۵۹,۹۸۸,۷۵۹,۷۶۹	۹۴,۴۹۴,۳۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس	
۲۷.۶۲٪	۲۵,۷۸۱,۹۶۱,۲۸۴	۳۵۹,۹۸۸,۷۵۹,۷۶۹	۳۸۰,۳۴۸,۱۸۸,۰۶۷	۵,۴۲۲,۵۳۲,۹۸۶	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس	
۰.۲۴٪	۲۲۰,۵۵۹,۷۲۹	۴۲۰,۰۰۰	۹۳۲,۶۶۲	۲۲۰,۰۴۷,۰۶۷	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست	
۲۷.۹۶٪	۲۶,۰۹۶,۳۲۰,۳۴۳	۷۱۹,۹۷۸,۶۳۴,۵۳۸	۷۴۰,۳۳۷,۸۸۰,۴۹۸	۵,۷۳۷,۰۷۴,۳۸۳					جمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۱/۳۱			
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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۲/۰۱/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۳,۰۲۸,۳۹۴,۳۹۲)	۱۰۱.۰۳٪	-۳.۲۴٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳۰,۷۴۷,۹۲۲	-۱.۰۳٪	۰.۰۳٪
جمع		(۲,۹۹۷,۶۴۶,۴۷۰)	۱۰۰٪	-۳.۲۱٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۲-۱- 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
صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰٪	۰	۰	۴۱۶,۶۵۲	۴۱۶,۶۵۲	۰.۰۰٪
صندوق س.رشد پایدار-د	۰	-۸۱,۱۵۵,۲۷۴	۲۵۵,۶۹۷,۸۰۸	۱۷۴,۵۴۲,۵۳۴	۱۲.۳۷٪	۰	۲۵۸,۷۵۸,۰۰۰	-۳,۲۸۷,۵۶۹,۰۴۴	-۳,۰۲۸,۸۱۱,۰۴۴	-۱۵.۰۶٪
جمع	۰	(۸۱,۱۵۵,۲۷۴)	۲۵۵,۶۹۷,۸۰۸	۱۷۴,۵۴۲,۵۳۴	۱۲.۳۷٪	۰	۲۵۸,۷۵۸,۰۰۰	(۳,۲۸۷,۱۵۲,۳۹۲)	(۳,۰۲۸,۳۹۴,۳۹۲)	-۱۵.۰۵٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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	خالص درآمد سود سهام
جمع				۰	۰	۰	۰	۰	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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	صندوق س. رشد پایدار-د
۲۵۸,۷۵۸,۰۰۰	۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۴,۲۱۶,۱۱۱	-۸۱,۱۵۵,۲۷۴	۴۳,۰۲۴,۸۵۱,۴۷۲	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۴,۲۱۶,۱۱۱	
۲۵۸,۷۵۸,۰۰۰	۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷		-۸۱,۱۵۵,۲۷۴	۴۳,۰۲۴,۸۵۱,۴۷۲	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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
صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	۰	۰	۰	۰	۵۶۸	۶۳,۵۴۲,۸۴۲	۶۳,۱۲۶,۱۹۰
صندوق س.رشد پایدار-د	۶۱,۱۹۳,۲۷۰	۶۱۶,۷۵۷,۴۲۶,۹۵۴	۶۱۶,۵۰۱,۷۲۹,۱۴۶	۲۵۵,۶۹۷,۸۰۸	۵۱۳,۲۳۰,۹۳۸	۵,۱۷۱,۴۲۸,۵۸۷,۵۳۸	۵,۱۷۴,۷۱۵,۳۱۲,۱۹۳
جمع		۶۱۶,۷۵۷,۴۲۶,۹۵۴	۶۱۶,۵۰۱,۷۲۹,۱۴۶	۲۵۵,۶۹۷,۸۰۸		۵,۱۷۱,۴۹۲,۱۳۰,۳۸۰	۵,۱۷۴,۷۷۸,۴۳۸,۳۸۳
							۴۱۶,۶۵۲
							-۳,۲۸۶,۷۲۴,۶۵۵
							(۳,۲۸۶,۳۰۸,۰۰۳)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۲/۰۱/۳۱				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 ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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	۰		
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۰		
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	۰	۲۶,۵۱۴,۴۹۸	
بانک خاورمیانه بخارست	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	۹۳۲,۶۶۲	۴,۲۳۳,۴۲۴	
جمع		۹۳۲,۶۶۲	۳۰,۷۴۷,۹۲۲	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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
۲۶,۵۱۴,۴۹۸	۰	۲۶,۵۱۴,۴۹۸	۰	۰	۰	۰		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۴,۲۳۳,۴۲۴	۰	۴,۲۳۳,۴۲۴	۹۳۲,۶۶۲	۰	۹۳۲,۶۶۲	۰		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۳۰,۷۴۷,۹۲۲	۰	۳۰,۷۴۷,۹۲۲	۹۳۲,۶۶۲	۰	۹۳۲,۶۶۲				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۲/۰۱/۳۱ مبلغ	طی دوره 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٪	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	۰	