



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

سرمایه‌گذاری‌ها - ۱

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام - ۱-۱

نام شرکت	۱۴۰۲/۰۱/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۲/۳۱			
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق	تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	تغییرات طی دوره	تعداد	بهای تمام شده
صندوق س. رشد پایدار-د	۴,۲۱۶,۱۱۱	۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۶۶.۷۳%	۶,۲۴۷,۶۱۶	۱۰,۱۸۹	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶۶.۷۳%	۶,۲۴۷,۶۱۶	۱۰,۱۸۹	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶
جمع		۴۲,۶۸۴,۹۳۸,۱۹۷	۴۲,۹۴۳,۶۹۶,۱۹۷	۶۶.۷۳%			۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶۶.۷۳%			۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۲/۳۱				۱۴۰۲/۰۱/۳۱				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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۱/۳۱		۱۴۰۲/۰۲/۳۱			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فراپورسی	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	مبلغ فروش	تعداد					

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پرتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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)

۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۱/۳۱						سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب		
۰.۱۰٪	۹۳,۱۸۹,۳۳۰	۲۲۷,۲۱۲,۴۶۶,۸۸۷	۲۲۷,۲۱۱,۸۵۶,۸۸۷	۹۳,۷۹۹,۳۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۷۵۸		بانک تجارت تخصصی بورس
۱۶.۸۴٪	۱۶,۰۶۷,۴۵۷,۹۱۹	۲۲۷,۲۱۱,۸۵۶,۸۸۷	۲۱۷,۴۹۷,۳۵۳,۵۲۲	۲۵,۷۸۱,۹۶۱,۲۸۴	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷		بانک تجارت تخصصی بورس
۰.۰۵٪	۵۱,۳۳۹,۷۷۲	۱۶۹,۴۳۷,۰۵۵	۲۱۷,۰۹۸	۲۲۰,۵۵۹,۷۲۹	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳		بانک خاورمیانه بخارست
۱۷.۰۰٪	۱۶,۲۱۱,۹۸۷,۰۲۱	۴۵۴,۵۹۳,۷۶۰,۸۲۹	۴۴۴,۷۰۹,۴۲۷,۵۰۷	۲۶,۰۹۶,۳۲۰,۳۴۳						جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پر تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۱/۳۱				۱۴۰۲/۰۲/۳۱			
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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	یادداشت	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام		(۲,۱۹۸,۷۱۸,۹۸۸)	۱۰۱.۴۳٪	-۲.۳۱٪
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار		۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
درآمد سپرده بانکی		۳۰,۹۶۵,۰۱۸	-۱.۴۳٪	۰.۰۳٪
جمع		(۲,۱۶۷,۷۵۳,۹۷۰)	۱۰۰٪	-۲.۲۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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	۲۶۴,۲۵۸,۳۸۲	۵۶۴,۵۷۲,۶۳۳	۸۲۸,۸۳۱,۰۱۵	۳۷.۰۰٪	۰	۵۲۳,۰۱۶,۳۸۲	-۲,۷۲۲,۱۵۲,۰۲۲	-۲,۱۹۹,۱۳۵,۶۴۰	-۹.۸۴٪
جمع	۰	۲۶۴,۲۵۸,۳۸۲	۵۶۴,۵۷۲,۶۳۳	۸۲۸,۸۳۱,۰۱۵	۳۷.۰۰٪	۰	۵۲۳,۰۱۶,۳۸۲	(۲,۷۲۱,۷۳۵,۳۷۰)	(۲,۱۹۸,۷۱۸,۹۸۸)	-۹.۸۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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				*	*	*	*	*	*

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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
۵۲۳,۰۱۶,۳۸۲	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶,۲۴۷,۶۱۶	۲۶۴,۲۵۸,۳۸۲	۶۳,۳۹۰,۳۱۳,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸	۶,۲۴۷,۶۱۶	
۵۲۳,۰۱۶,۳۸۲	۶۳,۱۳۱,۵۵۵,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸		۲۶۴,۲۵۸,۳۸۲	۶۳,۳۹۰,۳۱۳,۹۰۶	۶۳,۶۵۴,۵۷۲,۲۸۸		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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.پشتوانه طلای لوتوس	۰	۰	۰	۰	۵۶۸	۶۳,۵۴۲,۸۴۲	۶۳,۱۲۶,۱۹۰	۴۱۶,۶۵۲
صندوق س.رشد پایدار-د	۲۵,۶۸۸,۱۰۱	۲۵۹,۰۱۷,۶۳۱,۴۴۷	۲۵۸,۴۵۳,۰۵۸,۸۱۴	۵۶۴,۵۷۲,۶۳۳	۵۳۸,۹۱۹,۰۳۹	۵,۴۳۰,۴۴۶,۲۱۸,۹۸۵	۵,۴۳۳,۱۶۸,۳۷۱,۰۰۷	-۲,۷۲۲,۱۵۲,۰۲۲
جمع	۲۵,۶۸۸,۱۰۱	۲۵۹,۰۱۷,۶۳۱,۴۴۷	۲۵۸,۴۵۳,۰۵۸,۸۱۴	۵۶۴,۵۷۲,۶۳۳	۵۳۸,۹۱۹,۶۰۷	۵,۴۳۰,۵۰۹,۷۶۱,۸۲۷	۵,۴۳۳,۲۳۱,۴۹۷,۱۹۷	(۲,۷۲۱,۷۳۵,۳۷۰)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۲/۰۲/۳۱				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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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	۰	۰
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۶۶۲۶	۰	۰	۰
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	۰	۲۶,۵۱۴,۴۹۸	۲۶,۵۱۴,۴۹۸
بانک خاورمیانه بخارست	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	۲۱۷,۰۹۶	۴,۴۵۰,۵۲۰	۴,۴۵۰,۵۲۰
جمع		۲۱۷,۰۹۶	۳۰,۹۶۵,۰۱۸	۳۰,۹۶۵,۰۱۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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
۴,۴۵۰,۵۲۰	۰	۴,۴۵۰,۵۲۰	۲۱۷,۰۹۶	۰	۲۱۷,۰۹۶	۰		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۳۰,۹۶۵,۰۱۸	۰	۳۰,۹۶۵,۰۱۸	۲۱۷,۰۹۶	۰	۲۱۷,۰۹۶				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۴-۲- سایر درآمدها:

درصد به کل دارایی‌های صندوق	درصد از کل درآمدها	۱۴۰۲/۰۲/۳۱ 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	