



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش افشای پرتفوی ماهانه

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۴۰۲/۰۵/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۶/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی ماه		فروش طی ماه		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
صندوق س. رشد پایدار-د	۲۵,۱۵۳,۹۵۶	۲۵۶,۱۵۹,۰۰۵,۶۳۵	۲۵۶,۴۶۰,۱۱۷,۷۶۱	۴۶,۷۹۷,۹۵۲	۴۷۱,۳۳۲,۹۳۹,۸۷۷	(۶۵,۹۹۷,۹۱۷)	۶۶۳,۵۷۴,۴۰۷,۰۸۲	۵,۹۵۳,۹۹۱	۶۰,۴۳۷,۹۵۹,۷۰۱	۶۰,۷۱۰,۵۶۹,۴۹۵
سپیدار سیستم آسیا	.	.	.	۱۰,۰۲۸,۵۷۷	۷۶۱,۶۳۷,۶۱۸,۵۹۵	(۱۲۰,۳۰۵)	۹,۰۶۲,۳۳۲,۶۷۹	۹,۹۰۸,۲۷۲	۷۵۳,۵۰۰,۸۲۵,۴۶۰	۷۴۱,۵۶۵,۵۵۴,۳۲۵
صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت	.	.	.	۵,۳۰۰,۰۰۰	۱۹۹,۶۶۷,۳۳۰,۵۶۳	.	.	۵,۳۰۰,۰۰۰	۱۹۹,۶۶۷,۳۳۰,۵۶۳	۲۰۰,۵۲۴,۹۹۴,۵۱۳
جمع		۲۵۶,۱۵۹,۰۰۵,۶۳۵	۲۵۶,۴۶۰,۱۱۷,۷۶۱		۱,۴۳۲,۶۳۷,۷۸۹,۰۳۵		۶۷۳,۶۳۶,۶۳۹,۷۶۱		۱۰۱۲,۶۰۶,۰۱۵,۷۲۴	۱۰۰۲,۸۰۱,۱۱۸,۴۳۲
										۸۴.۹۹%

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

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

۱۴۰۲/۰۶/۳۱				۱۴۰۲/۰۵/۳۱				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 پورتفوی
منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱-۴- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۶/۳۱				
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	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					
•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	۰.۰۰٪
•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	•	۰.۰۰٪
								•	•						-	-	•	۰.۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت پورتفوی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

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)

۱۴۰۲/۰۶/۳۱						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 پورتفوی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۶/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۵/۳۱					سپرده
مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۹۴,۳۲۲,۰۳۰	۰.۰۰۸٪	۳۱۴,۸۲۹,۴۴۶,۹۶۰	۳۱۴,۸۳۱,۹۵۸,۱۶۰	۹۱,۸۱۰,۸۳۰	۰	۱۳۹۸/۰۹/۱۳	حساب جاری	۱۰۴۳۳۳۷۵۸	بانک تجارت تخصصی بورس
۲۹۶,۷۰۶	۰.۰۰۰٪	۵,۱۳۵,۰۰۰,۰۰۰	۵,۱۳۱,۴۰۷,۰۲۴	۳,۸۸۹,۶۸۲	۰	۱۴۰۱/۰۳/۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	بانک تجارت تخصصی بورس
۱۵,۶۴۷,۵۸۶,۳۱۲	۱.۳۳۰٪	۶۴۵,۳۵۷,۷۷۴,۶۰۷	۶۶۰,۶۹۵,۳۴۱,۷۸۹	۳۱۰,۰۱۹,۱۳۰	۰	۱۴۰۱/۰۶/۲۰	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	بانک خاورمیانه بخارست
۱۷,۳۰۴,۰۴۱,۸۴۰	۱.۴۷۰٪	۳۰۹,۶۹۶,۹۵۸,۱۶۰	۳۲۷,۰۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۵.۰٪	۱۴۰۲/۰۶/۱۹	سپرده کوتاه مدت	۱۰۴۴۵۸۵۶۴	بانک تجارت تخصصی بورس
۳,۵۶۴,۵۹۳,۰۶۵	۰.۳۰۳٪	۱۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۳,۵۶۴,۵۹۳,۰۶۵	۰	۵.۰٪	۱۴۰۲/۰۶/۲۱	سپرده کوتاه مدت	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۵۴۵۷	بانک خاورمیانه بخارست
۱۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹.۳۴۷٪	۰	۱۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۲۲.۵٪	۱۴۰۲/۰۶/۲۶	سپرده بلند مدت	۱۰۰۷۶۰۹۳۵۰۰۰۰۰۰۱۷۵	بانک خاورمیانه بخارست
۱۴۶,۶۱۰,۸۳۹,۹۵۳	۱۲.۴۶٪	۱,۳۸۵,۰۱۹,۱۷۹,۷۲۷	۱,۵۳۱,۲۲۴,۳۰۰,۰۳۸	۴۰۵,۷۱۹,۶۴۲					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
 صورت وضعیت پورتفوی
 منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۴-۱- سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۶/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۵/۳۱			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی ماه		خرید طی ماه		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				تعداد	مبلغ فروش	بهای تمام شده	تعداد								

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

شرح	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	(۱۳,۹۸۷,۳۲۵,۸۷۰)	۱۰۲.۵٪	(۱.۱۹٪)
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۰	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی	۳۳۹,۴۰۷,۰۵۱	(۲.۵٪)	۰.۰۲۹٪
جمع	(۱۳,۶۴۷,۹۱۸,۸۱۹)	۱۰۰٪	(۱.۱۶٪)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱-۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره					۱۴۰۲/۰۶/۳۱					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	
۲۸.۱۰٪	(۳,۸۳۵,۳۵۸,۳۲۸)	(۴,۱۰۷,۸۶۵,۴۲۱)	۲۷۲,۶۰۷,۱۹۳	۰	۲۵.۷۰٪	(۳,۵۰۸,۰۸۱,۰۵۹)	(۳,۴۸۰,۲۲۷,۱۳۳)	(۳۷,۸۵۳,۹۲۶)	۰	صندوق س. رشد پایدار-د
۸۰.۶۷٪	(۱۱,۰۰۹,۸۳۱,۵۹۱)	(۷۴,۵۶۰,۴۵۶)	(۱۰,۹۳۵,۲۷۱,۱۳۵)	۰	۸۰.۶۷٪	(۱۱,۰۰۹,۸۳۱,۵۹۱)	(۷۴,۵۶۰,۴۵۶)	(۱۰,۹۳۵,۲۷۱,۱۳۵)	۰	سپیدار سیستم آسیا
(۶.۲۸٪)	۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۰	۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۰	(۶.۲۸٪)	۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۰	۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۰	صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت
۱۰۲.۴۹٪	(۱۳,۹۸۷,۳۲۵,۸۷۰)	(۴,۱۸۲,۴۲۵,۸۷۷)	(۹,۸۰۴,۸۹۹,۹۹۳)	۰	۱۰۰.۱٪	(۱۳,۶۶۰,۱۴۸,۷۰۱)	(۳,۵۵۴,۷۸۷,۵۸۹)	(۱۰,۱۰۵,۳۶۱,۱۱۲)	۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱-۱-۲- در آمد سود سهام

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره			تغییرات طی دوره			اطلاعات مجمع			نام شرکت
خالص در آمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع در آمد سود سهام	خالص در آمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع در آمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ مجمع	
.	.	.	.	.	.	.	.	.	.
.	.	.	.	.	.	.	.	.	.
.	.	.	.	.	.	.	.	.	جمع

منتہی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

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 د-	۶۵,۹۹۷,۹۱۷	۶۶۳,۵۷۴,۴۰۷,۰۸۲	۶۶۷,۰۵۴,۶۳۴,۲۱۵	(۳,۴۸۰,۲۲۷,۱۳۳)	۱۱۴,۱۳۳,۵۲۱	۱,۱۵۰,۷۵۰,۹۹۸,۱۳۷	۱,۱۵۴,۸۵۸,۸۶۳,۵۵۸	(۴,۱۰۷,۸۶۵,۴۲۱)
سپیدار سیستم آسیا	۱۲۰,۳۰۵	۹,۰۶۲,۳۳۲,۶۷۹	۹,۱۳۶,۷۹۳,۱۳۵	(۷۴,۵۶۰,۴۵۶)	۱۲۰,۳۰۵	۹,۰۶۲,۳۳۲,۶۷۹	۹,۱۳۶,۷۹۳,۱۳۵	(۷۴,۵۶۰,۴۵۶)
جمع	۶۷۲,۶۳۶,۶۳۹,۷۶۱	۶۷۶,۱۹۱,۴۲۷,۳۵۰	(۳,۵۵۴,۷۸۷,۵۸۹)		۱,۱۵۹,۸۱۳,۲۳۰,۸۱۶	۱,۱۶۳,۹۹۵,۶۵۶,۶۹۳	(۴,۱۸۲,۴۲۵,۸۷۷)	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت بور تفوی

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۴-۱-۲- درآمد کارمزد بازارگردانی

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان دوره		
	جمع درآمد کارمزد بازارگردانی	هزینه تنزیل	خالص درآمد کارمزد بازارگردانی	جمع درآمد کارمزد بازارگردانی	هزینه تنزیل	خالص درآمد کارمزد بازارگردانی
صندوق س. رشد پایدار-د	۵۳۴,۸۳۰,۶۹۴		۵۳۴,۸۳۰,۶۹۴	۱,۶۲۹,۰۶۷,۹۳۱		۱,۶۲۹,۰۶۷,۹۳۱
جمع	۵۳۴,۸۳۰,۶۹۴	۰	۵۳۴,۸۳۰,۶۹۴	۱,۶۲۹,۰۶۷,۹۳۱	۰	۱,۶۲۹,۰۶۷,۹۳۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۲-۱-۲- درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۲/۰۶/۳۱				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	
۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۱۹۹,۶۶۷,۲۳۰,۵۶۳	۲۰۰,۵۲۴,۹۹۴,۵۱۲	۵,۳۰۰,۰۰۰	۸۵۷,۷۶۳,۹۴۹	۱۹۹,۶۶۷,۲۳۰,۵۶۳	۲۰۰,۵۲۴,۹۹۴,۵۱۲	۵,۳۰۰,۰۰۰	صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت
۲۷۲,۶۰۷,۱۹۳	۶۰,۴۳۷,۹۶۲,۳۰۲	۶۰,۷۱۰,۵۶۹,۴۹۵	۵,۹۵۳,۹۹۱	(۲۷,۸۵۳,۹۲۶)	۶۰,۷۳۸,۴۲۳,۴۲۲	۶۰,۷۱۰,۵۶۹,۴۹۵	۵,۹۵۳,۹۹۱	صندوق س. رشد پایدار-د
(۱۰,۹۳۵,۲۷۱,۱۳۵)	۷۵۲,۵۰۰,۸۲۵,۴۶۰	۷۴۱,۵۶۵,۵۵۴,۳۲۴	۹,۹۰۸,۲۷۲	(۱۰,۹۳۵,۲۷۱,۱۳۵)	۷۵۲,۵۰۰,۸۲۵,۴۶۰	۷۴۱,۵۶۵,۵۵۴,۳۲۴	۹,۹۰۸,۲۷۲	سپیدار سیستم آسیا
(۹,۸۰۴,۸۹۹,۹۹۳)	۱,۰۱۲,۶۰۶,۰۱۸,۳۲۵	۱,۰۰۲,۸۰۱,۱۱۸,۳۳۱		(۱۰,۱۰۵,۳۶۱,۱۱۲)	۱,۰۱۲,۹۰۶,۴۷۹,۴۴۵	۱,۰۰۲,۸۰۱,۱۱۸,۳۳۱		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

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

از ابتدای سال مالی تا پایان دوره				۱۴۰۲/۰۶/۳۱				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	جمع کل

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۳-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

نام سپرده بانکی	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	تغییرات طی دوره	از ابتدای سال مالی تا پایان دوره
بانک تجارت تخصصی بورس	۱۰۴۴۵۷۷۹۷	-	۲۶,۴۶۴	۲۶,۴۶۴
بانک خاورمیانه بخارست	۱۰۰۷۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۴۶۷۳	۲۶۷,۶۴۶	۳۳۹,۴۹۲	۳۳۹,۴۹۲
بانک خاورمیانه بخارست	۱۰۰۷۶۰۹۳۵۰۰۰۰۰۰۱۷۵	۳۳۹,۰۴۱,۰۹۵	۳۳۹,۰۴۱,۰۹۵	۳۳۹,۰۴۱,۰۹۵
جمع		۳۳۹,۳۰۸,۷۴۱	۳۳۹,۴۰۷,۰۵۱	۳۳۹,۴۰۷,۰۵۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۶/۳۱			طی ماه			مشخصات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	توضیحات
۲۶,۴۶۴	-	۲۶,۴۶۴	.	-	.	-		۳۰	بانک تجارت تخصصی بورس
۳۳۹,۴۹۲	-	۳۳۹,۴۹۲	۲۶۷,۶۴۶	-	۲۶۷,۶۴۶	-		۳۱	بانک خاورمیانه بخارست
۳۳۳,۶۹۲,۸۶۷	۵,۳۴۸,۲۲۸	۳۳۹,۰۴۱,۰۹۵	۳۳۳,۶۹۲,۸۶۷	۵,۳۴۸,۲۲۸	۳۳۹,۰۴۱,۰۹۵	۲۳		۲۶	بانک خاورمیانه بخارست
۳۳۴,۰۵۸,۸۲۳	۵,۳۴۸,۲۲۸	۳۳۹,۴۰۷,۰۵۱	۳۳۳,۹۶۰,۵۱۳	۵,۳۴۸,۲۲۸	۳۳۹,۳۰۸,۷۴۱				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت وضعیت درآمدها

منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۴-۲- سایر درآمدها:

۱۴۰۲/۰۶/۳۱	طی دوره	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
.	.	سایر درآمدها
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
.	.	جمع