
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

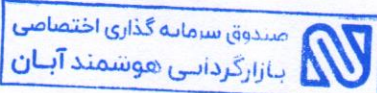
دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ که در اجرای مفاد بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق بر اساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده به شرح زیر تقدیم می‌گردد.

شماره صفحه	
۲	• صورت خالص دارایی‌ها
۳	• صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها
۴	• تاریخچه صندوق
۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۶	• ترکیب صنعت
۷	• جدول فعالیت صندوق
۸	• نمودار NAV
۹	• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

با سپاس



امضاء

نماینده

بابک حقیقی مهمانداری

شخص حقوقی

شرکت کارگزاری آبان

ارکان صندوق

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۴۰۰/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۱۷,۰۳۳,۶۸۳,۳۱۱	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۶۰,۰۵۶,۹۱۰,۰۰۳	۵۷,۸۵۹,۷۲۰,۵۲۰	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۰۵,۱۱۱,۲۲۲	۲۶۰,۹۲۶,۲۲۸	سایر دارایی‌ها
۹۴,۷۷۳,۳۶۴,۶۲۳	۷۵,۱۵۴,۳۳۰,۰۵۹	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها
(۱۸,۹۵۲,۹۹۹,۶۵۰)	.	جاری کارگزاران
(۱,۳۰۰,۵۲۱,۶۳۳)	(۴۴۴,۸۱۷,۶۶۸)	پرداختنی به ارکان صندوق
(۵۸۴,۵۶۹,۲۲۹)	(۷۵۷,۴۲۱,۶۴۷)	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
(۲۰,۸۳۸,۰۹۰,۵۱۲)	(۱,۲۰۲,۲۳۹,۳۱۵)	جمع بدهی‌ها
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۷۳,۹۵۲,۰۹۰,۷۴۴	خالص دارایی‌ها
۶۱۹,۱۳۰	۶۲۷,۴۶۸	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
ریال	ریال	ریال
درآمدها:		
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲	(۴,۵۰۹,۷۸۱,۵۱۶)
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۲,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۴)	(۴۳,۰۳۹,۶۸۸,۱۵۵)
سود سهام	.	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	۱,۰۹۷,۱۵۳,۳۹۴
سایر درآمدها	.	۸۵۰,۶۶۹
جمع درآمدها	۳,۹۹۴,۵۴۹,۵۷۱	(۷۵,۶۸۶,۲۴۹,۵۱۳)
هزینه‌ها:		
هزینه کارمزد ارکان	(۱۸۰,۴۷۸,۰۴۳)	(۸۲۳,۰۵۸,۹۸۲)
سایر هزینه‌ها	(۳۰۸,۴۴۹,۰۵۵)	(۲۰۳,۴۲۴,۳۱۱)
جمع هزینه‌ها	(۴۸۸,۹۲۷,۰۹۸)	(۱,۰۲۶,۴۸۳,۲۹۳)
سود خالص	۳,۵۰۵,۶۲۲,۴۷۳	(۴۷,۱۵۴,۹۳۷,۳۰۱)
بازده میانگین سرمایه‌گذاری سال (۱)	۴.۴۵٪	(۲۳.۷۳)٪
بازده سرمایه‌گذاری پایان سال (۲)	۴.۷۴٪	(۲۸.۶۸)٪
		(۵۰.۵۴)٪
		(۱۰۶.۸۶)٪

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
ریال	ریال	ریال
خالص دارایی‌ها در ابتدای دوره	۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸
واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره	.	۲۶,۵۰۷,۰۰۰,۰۰۰
واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره	(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۴,۳۶۲,۰۰۰,۰۰۰)
سود خالص سال	۳,۵۰۵,۶۲۲,۴۷۳	(۴۷,۱۵۴,۹۳۷,۳۰۱)
تعدیلات	(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	(۵۵,۴۸۸,۱۹۰,۲۶۱)
خالص دارایی‌ها در پایان دوره	۷۳,۹۵۲,۰۹۰,۷۴۱	۱۶۴,۲۵۴,۴۰۱,۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان که صندوقی با سرمایه باز در اندازه کوچک و از نوع صندوق‌های سرمایه‌گذاری بازارگردانی محسوب می‌شود در تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۱۴ با شماره ۱۱۶۳۳ نزد سازمان بورس اوراق بهادار به ثبت رسیده است. ضمناً صندوق دارای شناسه ملی به شماره ۱۴۰۰۸۱۱۳۱۹۹ می‌باشد.

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق این امیدنامه و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد: اولاً هزینه به‌کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. ثانیاً، صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. ثالثاً، امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده ۵ اساسنامه، و براساس مجوز شماره ۱۲۲/۴۵۹۰۱ سازمان بورس و اوراق بهادار دوره فعالیت تا تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۰۷ می‌باشد. مرکز اصلی صندوق در تهران به شهید بهشتی، کوچه نادر، خیابان ولیعصر، پلاک ۲۱۱۳، شرکت کارگزاری آبان می‌باشد.

۱-۲ - اطلاع‌رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت‌های صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس smart.aban.net درج گردیده است.

۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

مجمع صندوق: مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف بعلاوه یک از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رای صندوق تشکیل شده و رسمیت می‌یابد.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها، دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز صندوق، شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۲	سیدگردان آبان	۳,۰۰۰	۱۷,۵
۳	کارگزاری آبان	۱۴,۵۰۰	۸۲,۵
	جمع	۱۷,۵۰۰	۱۰۰

مدیر صندوق: شرکت کارگزاری آبان است که در تاریخ ۱۳۷۵/۰۶/۰۸ با شماره ثبت ۱۲۴۰۷۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران، شهید بهشتی، کوچه نادر، خیابان ولیعصر، پلاک ۲۱۱۳

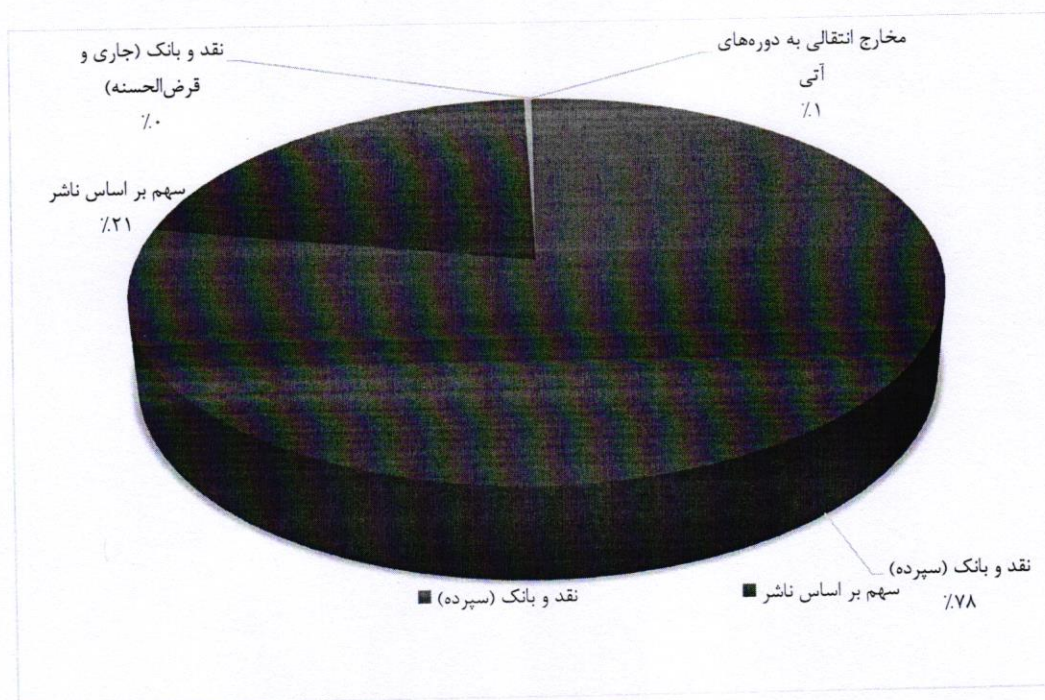
متولی صندوق: شرکت مشاوره سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از میدان توحید، خیابان توحید پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

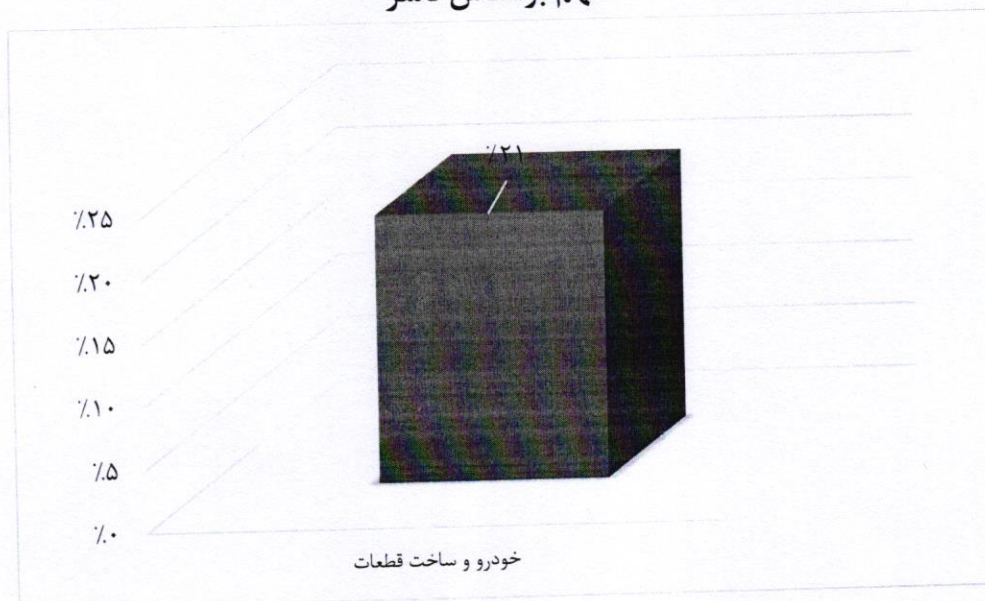
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

ترکیب دارایی‌ها



سهم بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

جدول فعالیت صندوق

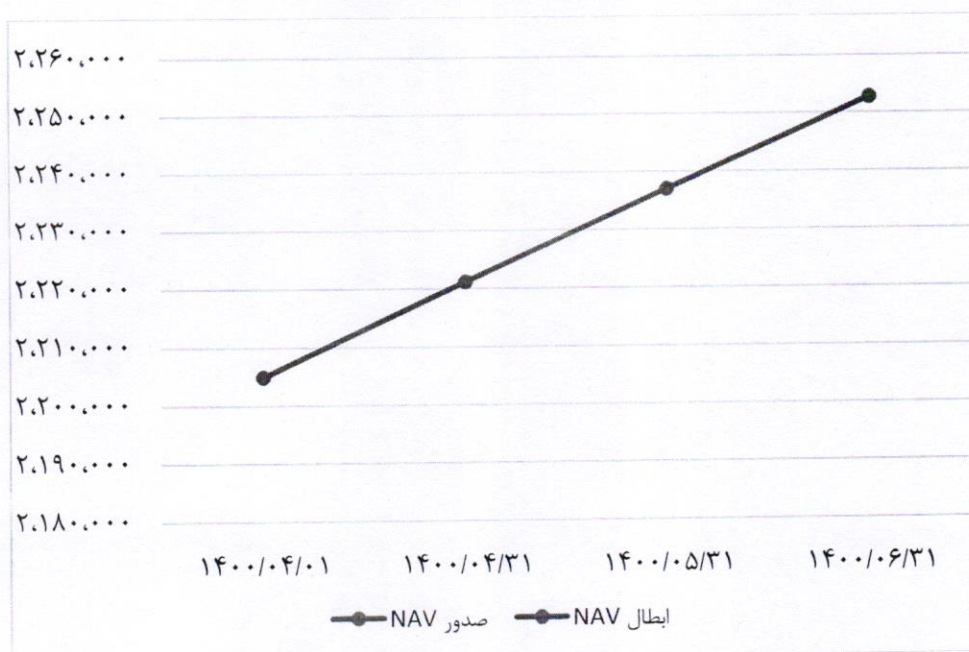
فعالیت‌های صندوق	
۶۲۸,۱۲۴	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۰۱
۶۲۷,۶۸۳	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۷۳,۹۵۲,۰۹۰,۷۴۴	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۱۱۷,۸۵۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۱,۵۶۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
%۴,۴۵	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
%۴,۷۴	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

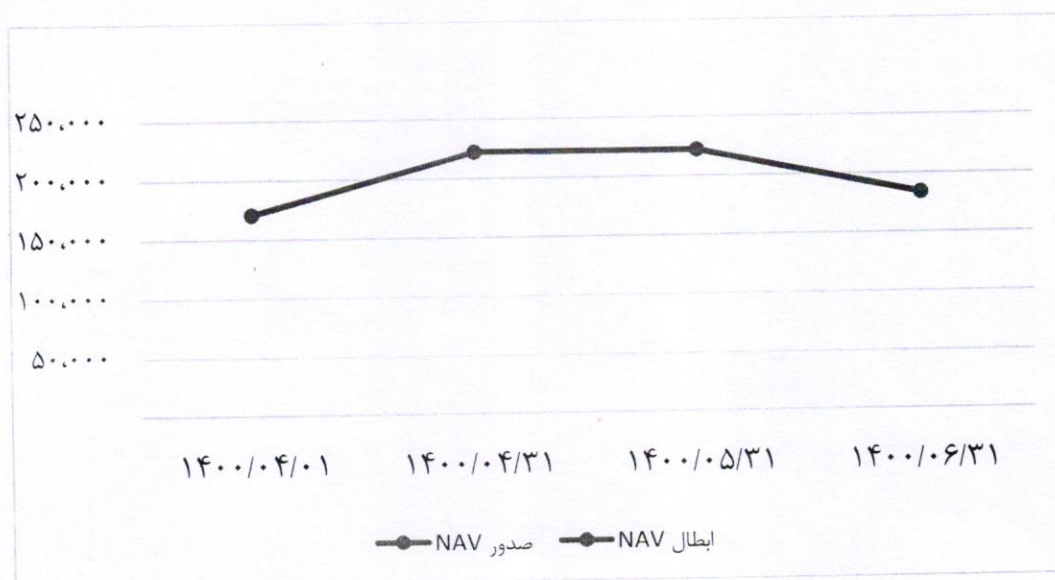
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

نمودار NAV نیلی صنعت کرمان



نمودار NAV سهم سایپا دیزل



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۴۰۰

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• سایپا دیزل:

