

---

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

---



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی شش ماهه منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ 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 می گردد.

شماره صفحه

۲

• صورت خالص دارایی ها

۳

• صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

۵

• تاریخچه صندوق

۶-۵

• ارکان صندوق سرمایه گذاری

۷

• نمودار ترکیب دارایی ها

۷

• ترکیب صنعت

۸

• جدول فعالیت صندوق

۹

• نمودار NAV

۱۰

• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

با سپاس

امضاء

نماینده

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی هوشمند آبان

بابک حقیقی مهمانداری



شخص حقوقی

شرکت کارگزاری آبان

ارکان صندوق

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۳۰ آذر ۱۴۰۰

۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
		<u>دارایی‌ها:</u>
۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۲۰,۶۸۴,۷۰۱,۷۲۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۶۰,۰۵۶,۹۱۰,۰۰۳	۵۸,۵۱۹,۹۱۰,۷۲۷	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۰	۵۵,۵۰۶,۹۱۲,۴۵۲	جاری کارگزاران
۱۰۵,۱۱۱,۲۲۲	۱۶۲,۸۷۵,۰۲۷	سایر دارایی‌ها
۹۸,۰۸۳,۴۹۱	۱۰۲,۹۲۹,۷۶۰	موجودی نقد
<u>۹۴,۷۷۳,۶۷۹,۸۲۲</u>	<u>۸۴,۹۷۷,۳۲۹,۶۹۰</u>	جمع دارایی‌ها
		<u>بدهی‌ها:</u>
۱,۳۰۰,۵۲۱,۶۳۳	۴۱۵,۴۵۴,۸۵۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۱۸,۹۵۲,۹۹۹,۶۵۰	۰	جاری کارگزاران
۰	۱۱,۷۱۶,۸۰۷,۶۵۷	تسهیلات مالی دریافتی
۵۸۴,۵۶۹,۲۲۹	۶۷۹,۳۰۵,۳۴۴	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
<u>۲۰,۸۳۸,۴۰۵,۷۱۱</u>	<u>۱۲,۸۱۱,۵۶۷,۸۵۳</u>	جمع بدهی‌ها
<u>۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱</u>	<u>۷۲,۱۶۵,۷۶۱,۸۳۷</u>	خالص دارایی‌ها
<u>۶۱۹,۱۳۰</u>	<u>۶۱۲,۳۱۱</u>	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	ریال	
			<b>درآمدها:</b>
(۶۲,۶۴۹,۵۴۵,۶۴۸)	(۵۱,۵۳۹,۹۰۱,۶۱۳)	۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	(۲۹۶,۴۸۱,۷۶۰)	(۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۳)	(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	.	سود سهام
۴,۸۷۰,۵۳۵,۳۹۵	۲,۱۰۵,۶۶۳,۴۲۶	۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۸۵۰,۶۶۹	۸۵۰,۶۶۹	.	سایر درآمدها
<b>(۷۵,۶۸۶,۲۴۹,۵۱۳)</b>	<b>(۴۹,۴۰۶,۸۵۷,۶۷۸)</b>	<b>۲,۹۰۶,۵۵۳,۹۳۶</b>	<b>جمع درآمدها</b>
			<b>هزینه‌ها:</b>
(۳,۶۳۰,۷۶۴,۸۰۷)	(۱,۵۵۵,۸۴۶,۱۶۸)	(۴۵۲,۱۲۴,۰۱۶)	هزینه کارمزد ارکان
(۸۱۴۳,۰۹۲۹۶)	(۳۹۲,۵۲۸,۵۷۳)	(۵۸۳,۴۳۰,۰۱۲)	سایر هزینه‌ها
.	.	(۱۵۱,۷۰۶,۳۴۲)	هزینه‌های مالی
<b>(۳,۴۴۵,۰۷۴,۱۰۳)</b>	<b>(۱,۹۴۸,۳۷۴,۷۴۱)</b>	<b>(۱,۱۸۷,۲۶۰,۳۷۰)</b>	<b>جمع هزینه‌ها</b>
<b>(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)</b>	<b>(۵۱,۳۵۵,۲۳۲,۴۱۹)</b>	<b>۱,۷۱۹,۲۹۳,۵۶۶</b>	<b>سود(زیان) خالص</b>
(۵۰,۵۴) %	(۲۸,۴۳) %	%۲,۲۵	بازده میانگین سرمایه‌گذاری دوره/سال (۱)
(۱۰۶,۸۶) %	(۳۰,۱۳) %	%۲,۳۸	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/سال (۲)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰		
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۲	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۲	۹۹,۷۴۱,۱۹۹,۱۶۸	۱۱۹,۴۱۸	خالص دارایی‌ها در ابتدای دوره/سال
۲۶,۵۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۲۶,۵۰۷	۱۷,۴۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۴۰۷	.	.	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره/سال
(۲۴,۳۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۴,۳۶۲)	.	.	(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره/سال
(۷۹,۱۳۱,۳۳۳,۶۱۶)	.	(۵۱,۳۵۵,۳۳۳,۴۱۹)	.	۱,۷۱۹,۲۹۳,۵۶۶	.	سود خالص دوره/سال
(۵۵,۴۸۸,۱۹۰,۳۶۱)	.	(۴,۴۰۷,۴۶۱,۵۷۳)	.	(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	.	تعدیلات
۷۲,۹۳۵,۳۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	۱۶۸,۰۵۴,۰۹۳,۹۹۶	۱۳۴,۶۸۰	۹۷,۹۷۱,۶۸۶,۸۹۴	۱۱۷,۸۵۸	خالص دارایی‌ها در پایان دوره/سال

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

### گزارش مالی میان دوره ای

#### گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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](http://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 مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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	سبدگردان 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 دش و همکاران است که در تاریخ ۱۳۵۸/۰۳/۰۵ به شماره ثبت ۱۹۷۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از بزرگراه شهید آبه‌شناسان، سردار جنگل شمالی، خیابان شهید پنج تن، خیابان شهید نوروزپور، کوچه سوم غربی، پلاک ۲۴.

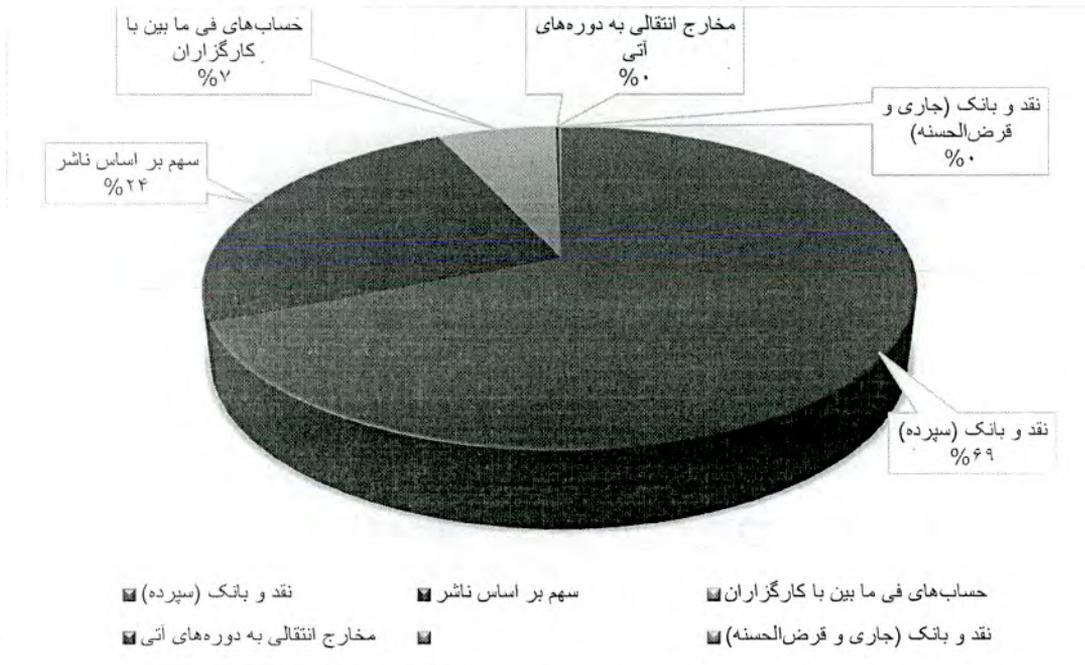
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

ترکیب دارایی‌ها



سهم بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۶۲۸.۱۲۴	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۰۱
۶۱۲.۵۷۲	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
۷۲.۱۶۵.۷۶۱.۸۳۷	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
۱۱۷.۸۵۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۱.۵۶۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
%۲.۲۵	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
%۲.۳۸	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره

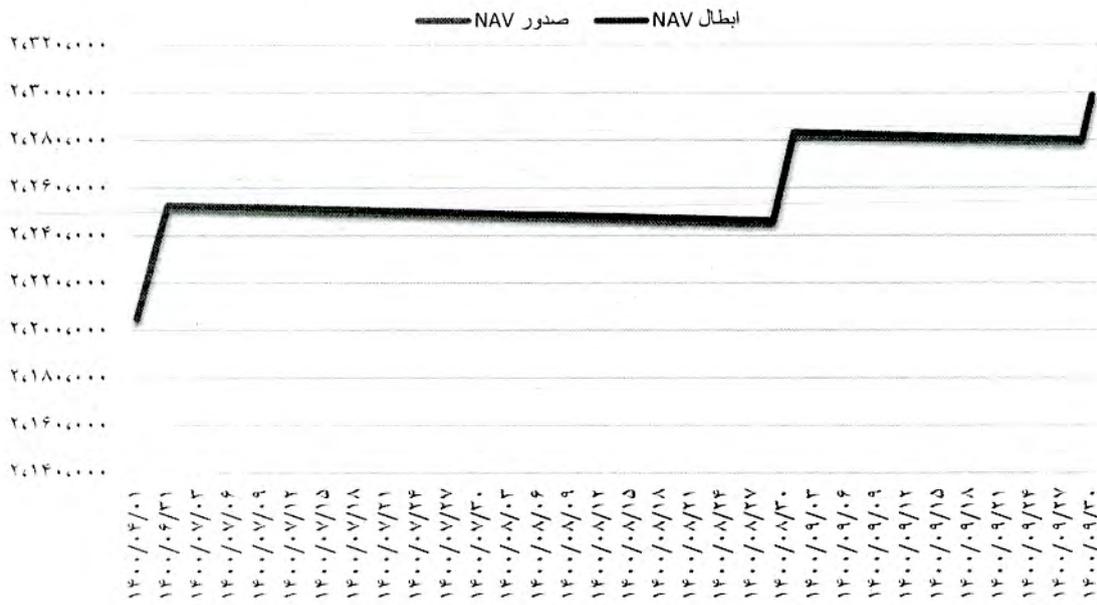
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

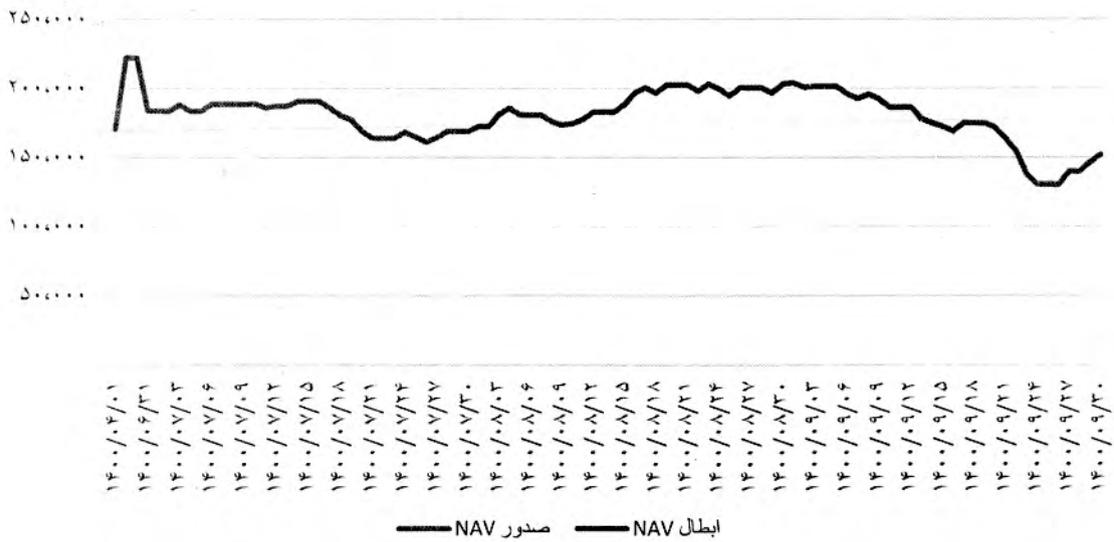
گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

نمودار NAV نیلی صنعت کرمان



نمودار NAV سهم سایپا دیزل



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۰

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• سایه دیزل:

