
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ 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
۵	• تاریخچه صندوق
۶-۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۷	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۷	• ترکیب صنعت
۸	• جدول فعالیت صندوق
۹	• نمودار NAV
۱۰	• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی
بازارگردانی هوشمند آبان



با سپاس

امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمنداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
دارایی‌ها:		
۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	.	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۶۰,۰۵۶,۹۱۰,۰۰۳	۷۶,۱۵۵,۷۰۰,۵۶۷	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
.	۲۵۵۸	جاری کارگزاران
۱۰۵,۱۱۱,۲۲۲	۶۵,۶۰۱,۲۷۸	سایر دارایی‌ها
.	(۳۱۵,۱۹۹)	حساب‌های دریافتنی
۹۸,۰۸۳,۴۹۱	۱۰۲,۳۰۷,۸۳۰	موجودی نقد
۹۴,۷۷۳,۶۷۹,۸۲۲	۷۶,۳۲۳,۲۹۷,۰۳۴	جمع دارایی‌ها
بدهی‌ها:		
۱,۳۰۰,۵۲۱,۶۳۳	۴۵۵,۹۲۷,۸۰۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۱۸,۹۵۲,۹۹۹,۶۵۰	.	جاری کارگزاران
۵۸۴,۵۶۹,۲۲۹	۵۳۴,۷۷۰,۶۰۰	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۲۰,۸۳۸,۴۰۵,۷۱۱	۹۹۰,۶۹۸,۴۰۲	جمع بدهی‌ها
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۷۵,۳۳۲,۵۹۸,۶۳۲	خالص دارایی‌ها
۶۱۹,۱۳۰	۶۳۹,۱۸۱	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 نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

درآمدها:	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
ریال	ریال	ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱.۸۱۳.۹۰۱.۸۰۷	(۵۱.۰۷۴.۹۴۸.۹۰۶)	(۶۲.۶۴۹.۵۴۵.۶۴۸)
(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	.	(۲۶.۴۸۳.۷۱۷.۵۴۷)	(۱۸.۲۳۱.۱۰۱.۵۲۹)
سود سهام	.	۳۲۳.۰۱۱.۶۰۰	۳۲۳.۰۱۱.۶۰۰
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۴.۷۲۹.۷۵۸.۶۹۴	۳.۶۲۶.۷۱۵.۲۶۹	۴.۸۷۰.۵۳۵.۳۹۵
سایر درآمدها	.	۸۵۰.۶۶۹	۸۵۰.۶۶۹
جمع درآمدها	۶.۵۴۳.۶۶۰.۵۰۱	(۷۳.۶۰۸.۰۸۸.۹۱۵)	(۷۵.۶۸۶.۲۴۹.۵۱۳)
هزینه‌ها:			
هزینه کارمزد ارکان	(۵۶۰.۳۳۰.۹۹۳)	(۲.۲۳۶.۷۱۶.۶۴۵)	(۳.۶۳۰.۷۶۴.۸۰۷)
سایر هزینه ها	(۱.۰۹۷.۱۹۹.۱۴۷)	(۵۸۲.۶۹۹.۳۸۱)	(۸۱۴۳۰۹۲۹۶)
جمع هزینه ها	(۱.۶۵۷.۵۳۰.۱۴۰)	(۲.۸۱۹.۴۱۶.۰۲۶)	(۳.۴۴۵.۰۷۴.۱۰۳)
سود(زیان) خالص	۴.۸۸۶.۱۳۰.۳۶۱	(۷۶.۴۲۷.۵۰۴.۹۴۱)	(۷۹.۱۳۱.۳۲۳.۶۱۶)
بازده میانگین سرمایه‌گذاری دوره/سال (۱)	۶,۴۵%	-۴۳,۷%	(۵۰,۵۴) %
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/سال (۲)	۶,۴۹%	-۷۰,۶۲%	(۱۰۶,۸۶) %

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱		دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰		دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹		
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	خالص دارایی‌ها در ابتدای دوره/سال
۲۶,۵۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۲۶,۵۰۷	۱۷,۴۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۴۰۷	۰	۰	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره/سال
(۲۴,۴۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۴,۴۶۲)	(۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره/سال
(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)	۰	(۷۶,۴۲۷,۵۰۴,۹۴۱)	۰	۴,۸۸۶,۱۳۰,۳۶۱	۰	سود خالص دوره/سال
(۵۵,۴۸۸,۱۹۰,۲۶۱)	۰	(۲۹,۱۳۳,۳۰۱,۵۷۳)	۰	(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	۰	تعدیلات
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	۱۰۸,۰۵۵,۹۸۱,۴۷۴	۱۲۴,۶۸۰	۷۵,۳۳۲,۵۹۸,۶۳۲	۱۱۷,۸۵۸	خالص دارایی‌ها در پایان دوره/سال

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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 ۱۲۲/۹۸۴۳۷ سازمان بورس و اوراق بهادار دوره فعالیت تا تاریخ ۱۴۰۱/۱۱/۱۷ 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 مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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	سبگردان 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 آشناسان، سردار جنگل شمالی، خیابان شهید پنج تن، خیابان شهید نوروزپور، کوچه سوم غربی، پلاک ۲۴.

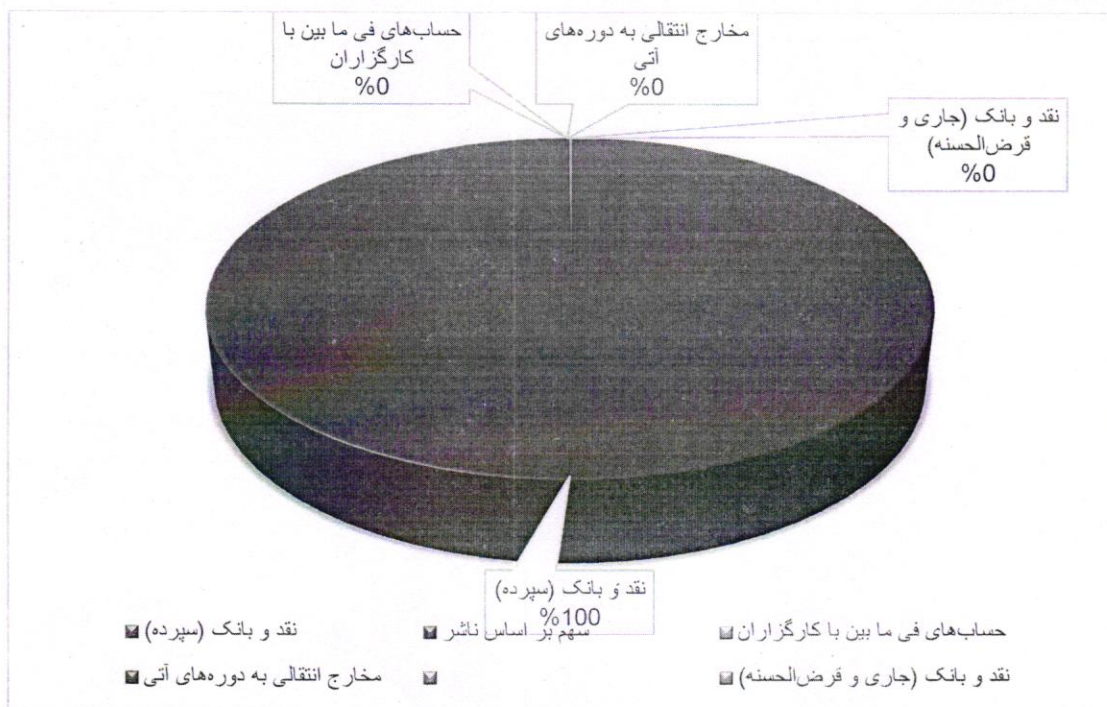
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

ترکیب دارایی‌ها



سهم براساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۶۲۸.۱۲۴	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۰۱
۶۳۹.۱۸۱	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۹
۷۵.۳۳۲.۵۹۸.۶۳۲	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۹
۱۱۷.۸۵۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۹
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۱.۵۶۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۶.۴۵٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۶.۴۹٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره

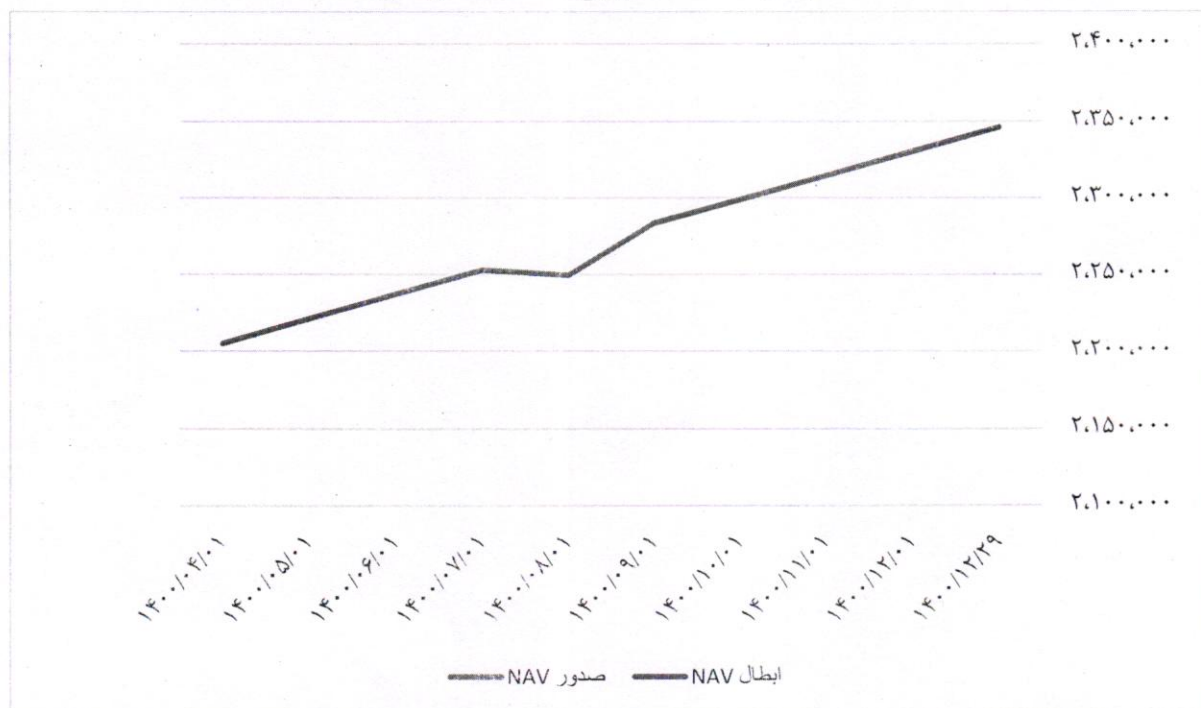
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

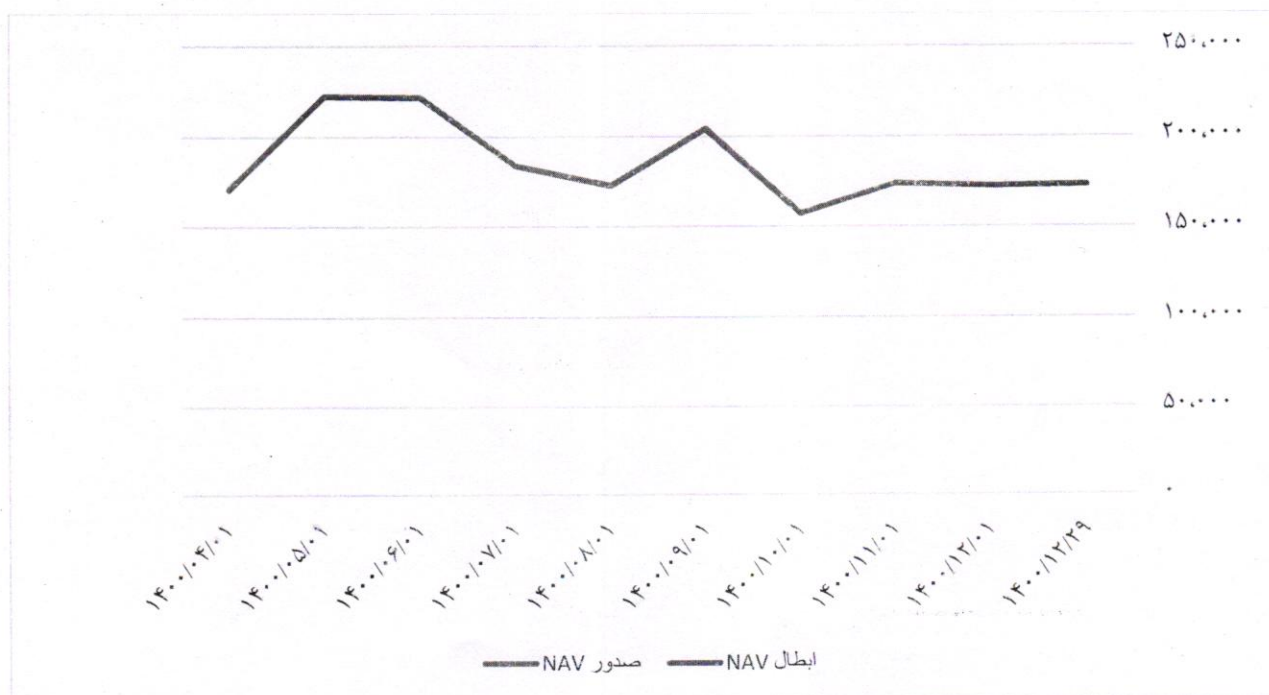
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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 نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• سایپا دیزل :

