
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ 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 می گردد.

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

با سپاس

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی هوشمند آبان



امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمانداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۴۰۱/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۰.۸۱۸.۴۷۲.۸۳۹	۹۴.۵۱۱.۳۵۹.۱۴۱	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۸۳.۷۱۰.۸۵۸.۸۴۶	۶۶۳.۹۵۵.۸۱۷	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
.	۲.۵۵۸.۸۵۹.۹۵۹	حساب‌های دریافتی
.	۹۰.۰۱۷.۱۵۵	سایر دارایی‌ها
۱۰۱.۷۶۸.۳۳۰	۱۰۰.۰۹۴.۳۳۰	موجودی نقد
۶۳.۳۲۴.۱۰۷	.	جاری کارگزاران
۱۰۴.۶۹۴.۴۲۴.۱۲۲	۹۷.۹۲۴.۲۸۶.۴۰۲	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
.	۵.۳۰۲.۳۳۹.۶۶۴	جاری کارگزاران
۵۰۸.۷۰۷.۹۳۸	۲۶۴.۷۱۰.۵۹۹	پرداختی به ارکان صندوق
۱۶.۱۳۱.۸۶۱.۲۱۸	.	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۵۵۴.۴۳۴.۳۷۴	۸۹۴.۷۶۵.۶۲۴	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۱۷.۱۹۵.۰۰۳.۵۳۰	۶.۴۶۱.۸۱۵.۸۸۷	جمع بدهی‌ها
۸۷.۴۹۹.۴۲۰.۵۹۲	۹۱.۴۶۲.۴۷۰.۵۱۵	خالص دارایی‌ها
۱۰۴۱.۷۲۲	۱۰۸۸.۹۰۴	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	درآمدها :
ریال	ریال	
۵,۱۲۰,۹۸۹,۳۰۲	(۷۷۹,۰۲۳,۹۰۲)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۲,۷۶۵,۹۱۲,۷۸۴)	۹۶,۹۱۴,۰۱۷	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۳,۲۰۲,۴۶۵,۸۱۰	سود سهام
۱,۶۳۹,۴۷۳,۰۵۳	۲,۰۷۵,۵۰۶,۰۸۰	سود(زیان) اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
.	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	سایر درآمدها
۳,۹۹۴,۵۴۹,۵۷۱	۴,۷۱۹,۰۲۰,۱۰۳	جمع درآمدها
		هزینه‌ها :
(۱۸۰,۴۷۸,۰۴۳)	(۲۶۴,۷۱۰,۵۹۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۳۰۸,۴۴۹,۰۵۵)	(۴۹۱,۲۵۹,۵۸۱)	سایر هزینه‌ها
(۴۸۸,۹۲۷,۰۹۸)	(۷۵۵,۹۷۰,۱۸۰)	جمع هزینه‌ها
۳,۵۰۵,۶۲۲,۴۷۳	۳,۹۶۳,۰۴۹,۹۲۳	سود (زیان) خالص
۴,۴۵٪	۴,۴۵٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (۱)
۴,۷۴٪	۴,۳۳٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال (۲)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱		سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱		
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	۸۷,۴۹۹,۴۲۰,۵۹۲	۸۳,۹۹۵	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای دوره مالی
.	.	.	.	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره مالی
(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰)	.	.	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دورهمالی
۳,۵۰۵,۶۲۲,۴۷۳	.	۳,۹۶۳,۰۴۹,۹۲۳	.	سود (زیان) خالص دوره مالی
(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	.	.	.	تعدیلات
۷۳,۹۵۲,۰۹۰,۷۴۴	۱۱۷,۸۵۸	۹۱,۴۶۲,۴۷۰,۵۱۵	۸۳,۹۹۵	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

- 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 ۱۴۰۱/۱۱/۰۷ 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 www.hooshmandfund.ir درج گردیده است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

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.

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
۱	سبدگردان آبان	۳,۰۰۰	٪ ۱۷,۱۴
۲	کارگزاری آبان	۱۴,۵۰۰	٪ ۸۲,۸۶
	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

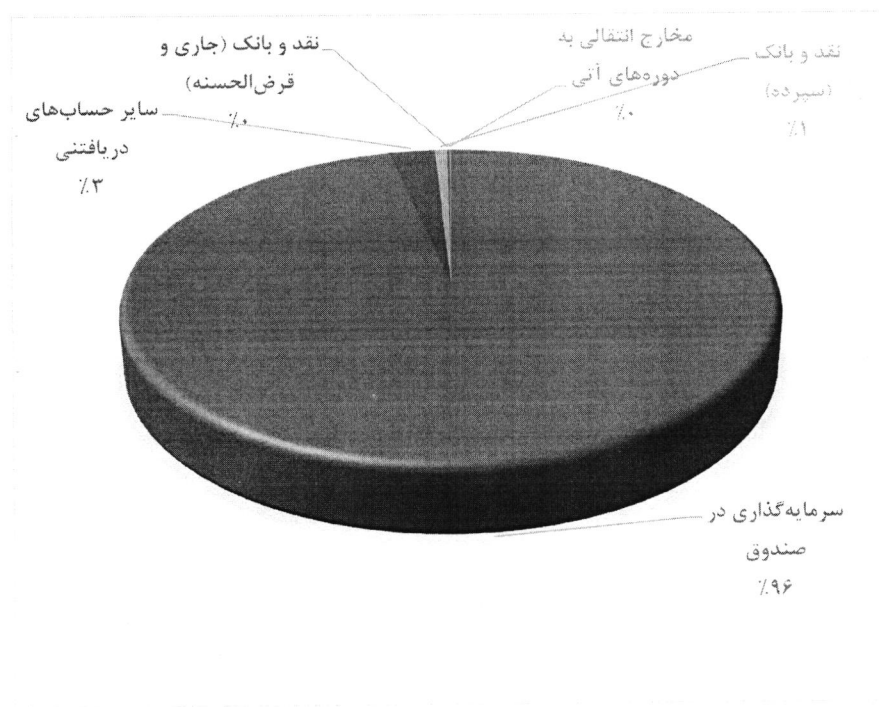
متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷
حسابرس صندوق: مؤسسه 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 پنج تن، خیابان شهید نوروزپور (نشاط)، نبش کوچه سوم غربی، شماره ۲۴.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

ترکیب دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

جدول فعالیت صندوق

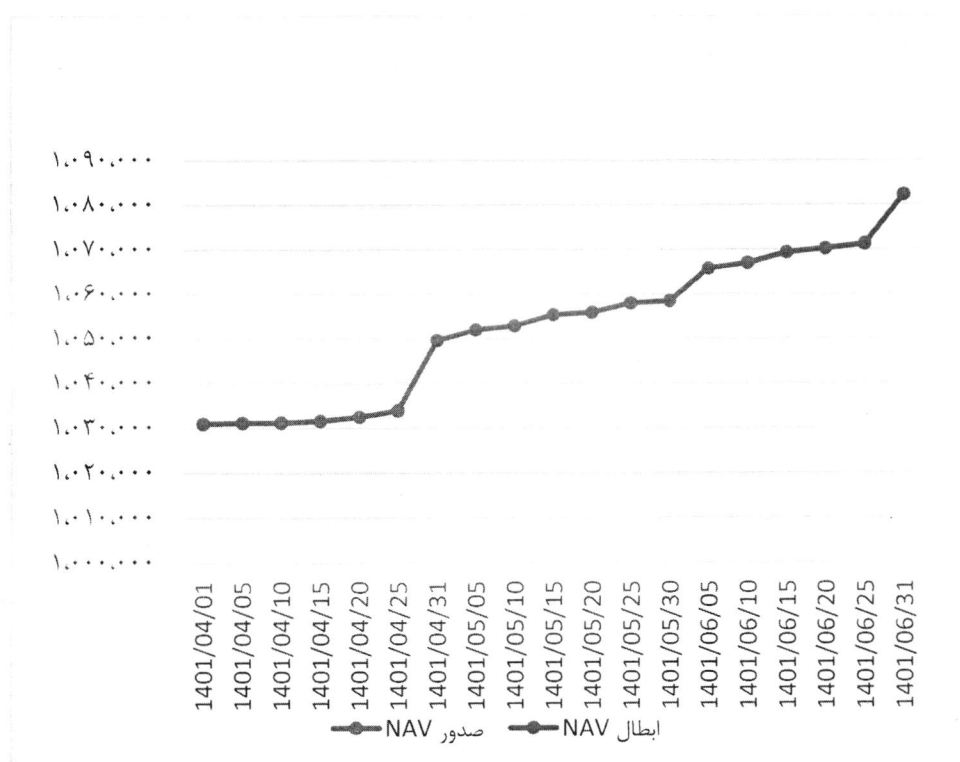
فعالیت‌های صندوق	
۱۰۰۳۷,۶۷۵	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۰۱
۱۰۰۸۸,۹۴۶	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱
۹۱,۴۶۲,۴۷۰,۵۱۵	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱
۸۳,۹۹۵	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۴,۴۵٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی
۴,۳۳٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

نمودار NAV صندوق رشد پایدار



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• صندوق رشد پایدار:

