
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

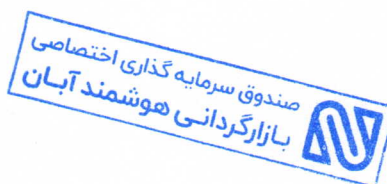
دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲ 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



امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

الهام مرادی

شرکت سیدگردان آبان

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۱۴۰۲/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
.	۷۴۱,۵۶۵,۵۵۴,۳۲۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶	۲۶۱,۲۳۵,۵۶۴,۰۰۷	سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲۲,۴۱۱,۹۷۲	۱۴۶,۵۱۶,۵۱۷,۹۲۳	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۶,۸۰۵,۱۱۴,۱۱۲	۶,۲۵۵,۰۰۵,۸۷۹	حساب‌های دریافتی
۶۰۴,۱۱۰,۸۱۱	۵۰۱,۵۵۴,۱۶۶	سایر دارایی‌ها
۹۲,۴۱۰,۸۳۰	۹۴,۳۲۲,۰۳۰	موجودی نقد
.	۲۳,۷۳۳,۵۸۸,۵۷۹	جاری کارگزاران
۱۰۱,۹۲۹,۱۳۷,۶۰۱	۱,۱۷۹,۹۰۲,۱۰۶,۹۰۸	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۴,۱۰۰,۰۹۶,۷۷۲	.	جاری کارگزاران
۷۶۱,۴۰۴,۲۸۳	۱,۳۱۹,۸۶۶,۹۵۹	پرداختی به ارکان صندوق
.	.	پرداختی به سرمایه‌گذاران
.	.	تسهیلات مالی دریافتی
۱,۶۴۵,۰۹۰,۶۴۱	۱,۷۴۷,۳۲۱,۹۸۸	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۶,۵۰۶,۵۹۱,۶۹۶	۳,۰۶۷,۱۸۸,۹۴۷	جمع بدهی‌ها
۹۵,۴۲۲,۵۴۵,۹۰۵	۱,۱۷۶,۸۳۴,۹۱۷,۹۶۱	خالص دارایی‌ها
۱,۳۰۳,۸۰۰	۹۹۲,۱۳۸	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	درآمدها:
ریال	ریال	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۷۷۹۰۰۲۳۰۹۰۲)	(۴۰۱۸۲۰۴۲۵۰۸۷۷)	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۹۶۰۹۱۴۰۰۱۷	(۹۰۸۰۴۰۸۹۹۰۹۹۴)	سود تقسیمی صندوق های سرمایه‌گذاری
۳۰۲۰۴۶۵۰۸۱۰	۸۰۷۴۵۰۶۴۱۰۷۲۴	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳۲۰۶۴۶۰۱۲۱	۳۳۴۰۵۸۰۸۲۳	درآمد حاصل از بازارگردانی
۲۰۴۲۰۸۵۹۰۹۵۹	۱۰۶۲۹۰۰۶۷۰۹۳۱	سایر درآمدها
۱۲۳۰۱۵۸۰۰۹۸	.	جمع درآمدها
۴۰۷۱۹۰۰۲۰۰۱۰۳	(۳۰۲۷۸۰۵۵۷۰۳۹۳)	هزینه‌ها:
		هزینه کارمزد ارکان
(۲۶۴۰۷۱۰۵۹۹)	(۱۰۰۰۲۰۵۵۹۰۶۳۵)	سایر هزینه‌ها
(۴۹۱۰۲۵۹۰۵۸۱)	(۸۰۵۰۸۱۳۰۹۹۷)	جمع هزینه‌ها
(۷۵۵۰۹۷۰۰۱۸۰)	(۱۰۸۰۸۰۳۷۳۰۶۳۲)	هزینه های مالی
.	.	سود خالص
۳۰۹۶۳۰۴۹۰۹۲۳	(۵۰۸۶۰۹۳۱۰۰۲۵)	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (۱)
۴۰۴۵٪	٪(۱۰۰۲۴)	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (۲)
۴۰۳۳٪	٪(۰۰۲۸)	

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال
۸۷۰۴۹۹۰۴۲۰۰۵۹۲	۸۳۰۹۹۵		۹۵۰۴۲۲۰۵۴۵۰۹۰۵	۷۳۰۱۸۸	
.	.		۱۰۱۱۲۰۹۷۳۰۰۰۰۰۰۰	۱۰۱۱۲۰۹۷۳	
.	.		.	.	
۳۰۹۶۳۰۴۹۰۹۲۳	.		(۵۰۸۶۰۹۳۱۰۰۲۵)	.	
.	.		(۲۶۰۴۷۳۰۶۹۶۰۹۱۹)	.	
۹۱۰۴۶۲۰۴۷۰۰۵۱۵	۸۳۰۹۹۵		۱۰۱۷۶۰۸۳۴۰۹۱۷۰۹۶۱	۱۰۱۸۶۰۱۶۱	

خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای دوره مالی

واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره

واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره

سود خالص

تعدیلات

خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

۱-۱- 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 ۱۲۲/۱۲۰۳۵۸ در ۱۴۰۱/۱۱/۰۵ سازمان بورس و اوراق بهادار دوره فعالیت تا تاریخ ۱۴۰۶/۱۰/۱۰ می‌باشد. مرکز اصلی صندوق در تهران به نشانی میدان آرژانتین خیابان خالد اسلامبولی خیابان پانزدهم (شهید احمدیان) پلاک ۲۴ واحد ۶۰۱، 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 سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

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	۱۷۳۲۵	٪ ۹۹
۲	کارگزاری آبان	۱۷۵	٪ ۱
	جمع	۱۷،۵۰۰	٪ ۱۰۰

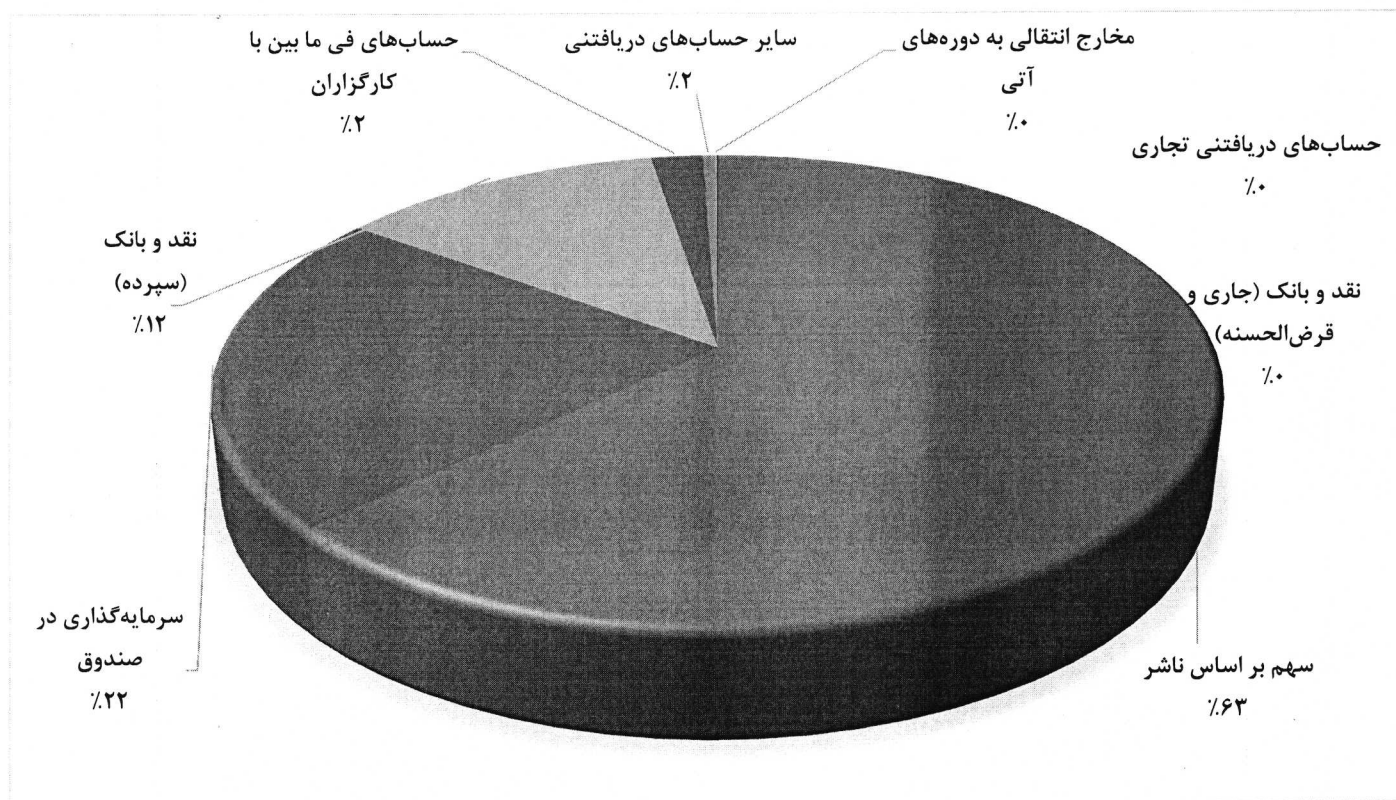
مدیر صندوق: شرکت سبدگردان آبان است که در تاریخ ۱۳۹۷/۰۳/۱۹ با شماره ثبت ۵۲۷۰۹۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران محله آرژانتین-ساعی، خیابان شهید خالد اسلامبولی، خیابان شهید مسعود احمدیان (پانزدهم) پلاک ۲۴، ساختمان نیکان، طبقه ششم واحد ۶۰۱. متولی صندوق: 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 آبه‌شناسان، سردار جنگل شمالی، خیابان پنج تن، خیابان شهید نوروزپور (نشاط)، نبش کوچه سوم غربی، شماره ۲۴.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

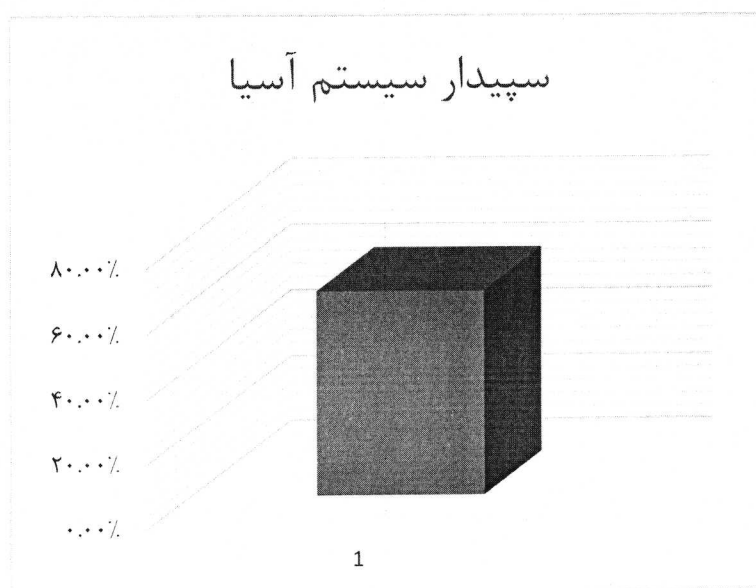
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

ترکیب دارایی



سهام براساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

جدول فعالیت صندوق

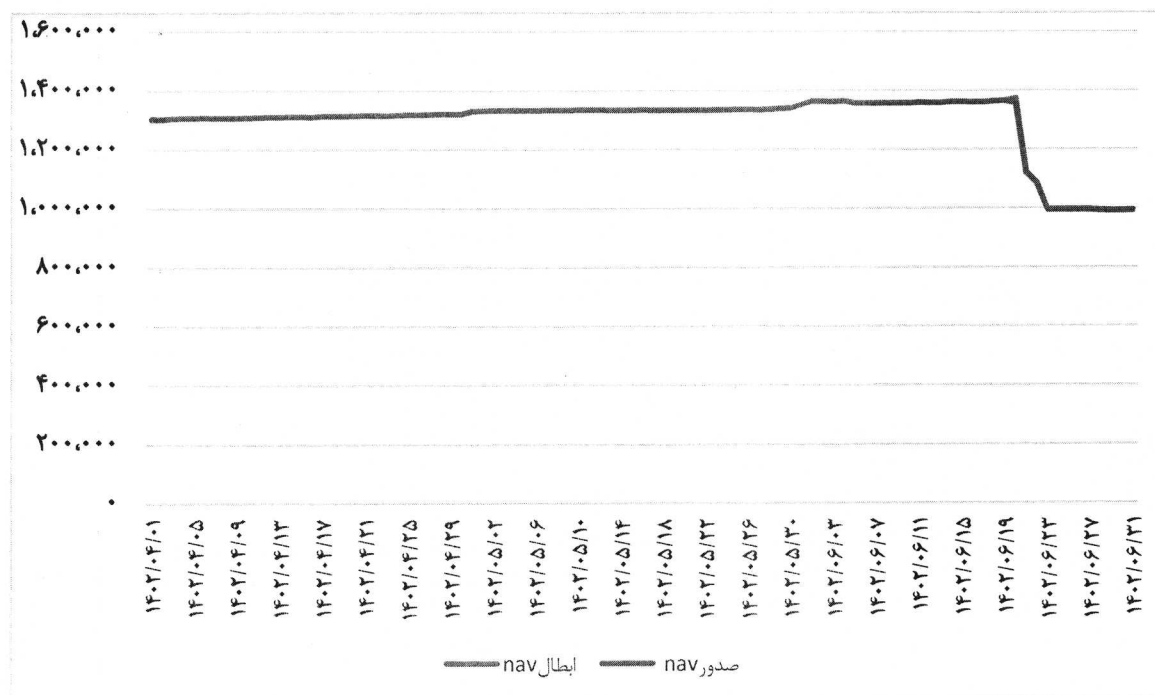
فعالیت‌های صندوق	
۹۹۳,۱۳۵	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۳۱
۱,۳۰۳,۸۹۷	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱
۱,۱۷۶,۸۳۴,۹۱۷,۹۶۱	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۳۱
۱,۱۸۶,۱۶۱	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۳۱
۱,۱۱۲,۹۷۳	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
(۱,۲۴)%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره
(۰,۲۸)%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

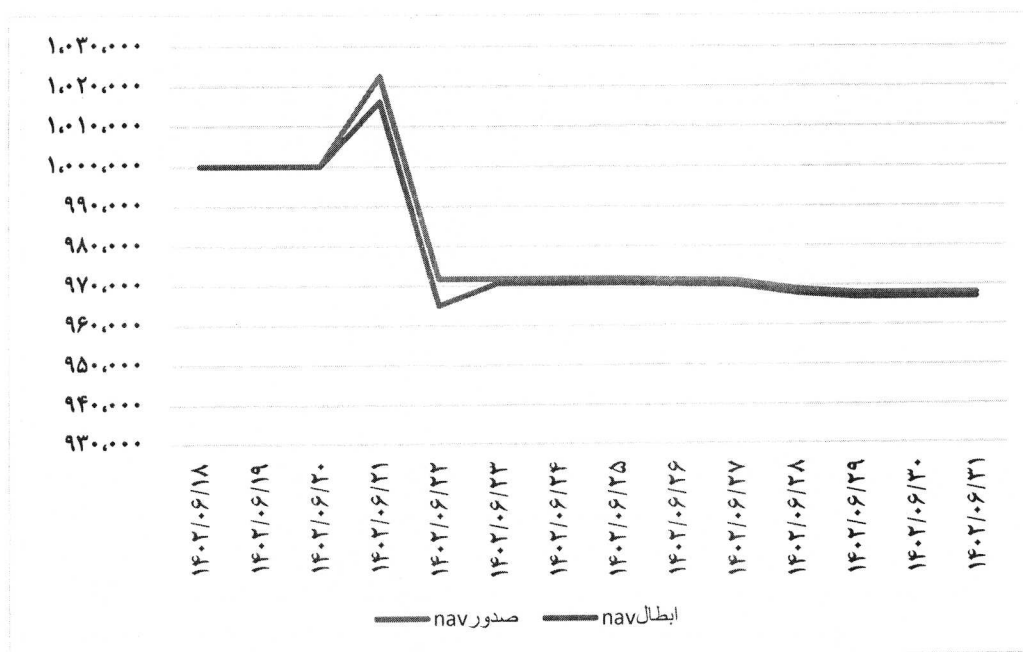
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

نمودار NAV رشد:



نمودار NAV سپیدار:



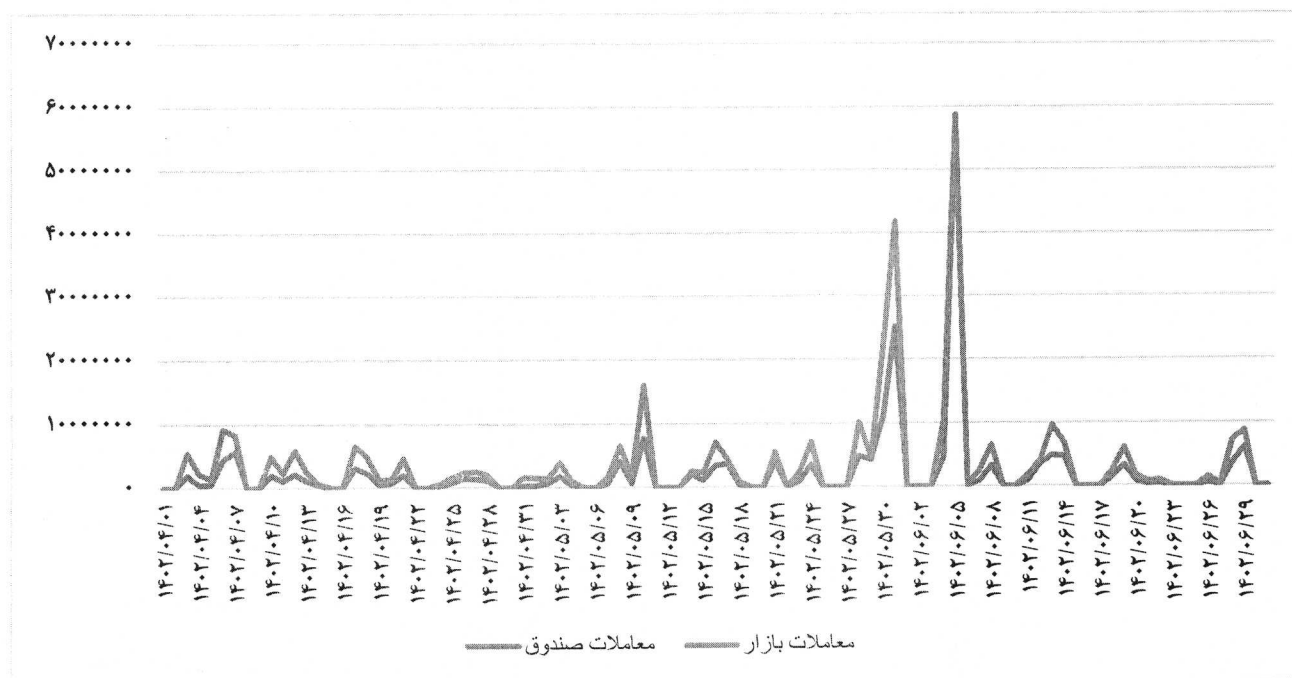
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۲

نمودار مقایسه حجم معاملات (صندوق، سهم) و بازار

• صندوق رشد پایدار آبان:



• سهم سپیدار سیستم آسیا:

