
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریورماه ۱۴۰۴ 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
۹-۱۳	• نمودار nav

با سپاس

امضاء
نماینده
الهام مرادی



شرکت سبدگردان آبان

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۴/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها
۲,۱۲۴,۸۰۱,۶۸۳,۲۸۰	۷,۹۷۷,۹۷۹,۷۸۶,۳۱۷	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۴,۸۴۵,۷۰۴,۰۱۴,۴۵۱	۲,۶۴۱,۴۰۵,۵۶۴,۱۳۵	سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۸۹,۱۸۹,۰۴۹,۲۲۴	۱۵۱,۳۵۸,۸۸۴,۴۰۹	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷۶,۳۲۱,۷۸۶,۶۷۰	۸۳,۰۱۸,۰۱۴,۴۹۲	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۴۶۰,۰۴۱,۸۳۶,۷۲۴	۴۲۲,۲۴۱,۹۰۲,۳۳۷	حساب‌های دریافتی
۱,۲۴۶,۳۶۵,۹۴۹	۳,۱۱۵,۷۸۶,۷۱۱	سایر دارایی‌ها
۰	۹۱۸,۶۰۶,۱۸۶,۹۱۲	جاری کارگزاران
۴۸,۰۳۹,۶۲۱	۲۹۳,۶۹۲,۳۲۶	موجودی نقد
۷,۵۹۷,۳۰۴,۷۳۶,۲۹۸	۱۲,۱۹۸,۰۱۹,۸۱۷,۶۳۹	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها
۲,۴۴۸,۵۵۵,۰۸۳,۰۵۲	۰	جاری کارگزاران
۰	۹۲۰,۷۰۷,۸۰۵,۶۳۳	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۸,۵۳۷,۹۰۸,۷۷۳	۱۷,۷۳۰,۰۴۶,۱۵۶	پرداختی به ارکان صندوق
۱۹۵,۲۸۰,۹۱۲,۷۲۸	۴۸۷,۵۱۸,۷۷۵,۳۰۳	تسهیلات مالی
۷۷,۶۴۴,۹۸۶,۹۰۱	۹۴۵,۸۰۶,۴۳۳,۲۸۸	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۳۴۷,۳۴۰,۲۰۴,۵۴۲	۴۸۹,۳۲۴,۳۱۴,۲۲۱	پیش دریافت‌ها
۳,۴۵۴,۱۰۹,۰۵۲,۹۵۳	۲,۸۶۱,۰۸۷,۳۷۴,۶۰۱	جمع بدهی‌ها
۴,۱۴۳,۲۴۳,۷۲۲,۹۶۶	۹,۳۳۶,۹۳۲,۴۴۳,۰۳۸	خالص دارایی‌ها
۲,۰۳۶,۷۲۹	۱,۰۹۴,۶۷۱	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	درآمدها
ریال	ریال	سود فروش اوراق بهادار
۶.۸۶۳.۲۱۰.۴۹۲	۳۷۰.۶۵۵.۷۵۳.۵۰۸	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳۳۴.۳۸۳.۳۱۳.۳۲۸	(۱.۲۲۲.۰۷۰.۰۰۱.۵۰۲)	سودسهم
.	۱۰۷.۱۵۹.۲۵۲.۳۴۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب و سپرده بانکی
۱۱.۴۸۳.۶۷۲.۹۶۴	۷.۰۳۴.۷۶۹.۲۱۶	درآمد حاصل از بازارگردانی
۵.۸۹۵.۸۲۴.۷۴۸	۳۳۰.۰۸۶.۵۲۴.۰۲۲	سایر درآمدها
۸.۸۲۵.۰۸۸	۵۴۹.۱۰۷.۹۳۲	جمع درآمدها(زیان)
۳۵۸.۶۳۴.۸۴۶.۶۲۰	(۴۰۶.۵۸۴.۵۹۴.۴۷۵)	هزینه ها
ریال	ریال	هزینه کارمزد ارکان
(۳.۴۲۸.۵۰۸.۲۲۸)	(۱۴.۲۱۲.۹۲۹.۶۹۹)	هزینه بازارگردانی اوراق بهادار
.	(۲۲۹.۹۹۲.۵۷۹.۰۷۹)	سایر هزینه ها
(۱.۴۸۶.۴۵۲.۸۹۶)	(۲.۳۶۷.۵۸۰.۶۳۹)	سود (زیان) قبل از هزینه های مالی
۳۵۳.۷۱۹.۸۸۵.۴۹۶	(۶۵۳.۱۵۷.۶۸۳.۸۹۲)	هزینه های مالی
.	(۳۰.۷۳۳.۳۶۹.۷۹۳)	سود (زیان)خالص
۳۵۳.۷۱۹.۸۸۵.۴۹۶	(۶۸۳.۸۹۱.۰۵۳.۶۸۵)	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره(۱)
%۱۸.۲۴	(%/۷/۴۰)	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره(۲)
%۱۶.۸۰	(%/۷/۲۰)	

صورت گردش خالص دارایی ها

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۶/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه گذاری) ابتدای دوره
ریال	ریال	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره
۱.۷۵۱.۸۲۶.۵۸۶.۴۰۱	۴.۱۴۳.۲۴۳.۷۲۲.۹۶۶	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره
.	۷.۳۵۵.۴۴۸.۰۰۰.۰۰۰	سود(زیان) خالص
.	(۸۶۰.۲۶۷.۰۰۰.۰۰۰)	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۳۵۳.۷۱۹.۸۸۵.۴۹۶	(۶۸۳.۸۹۱.۰۵۳.۶۸۵)	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره
.	(۶۱۷.۶۰۱.۲۲۶.۲۴۳)	
۲.۱۰۵.۵۴۶.۴۷۱.۸۹۷	۹.۲۳۶.۹۳۲.۴۴۲.۰۲۸	
۱.۲۵۴.۵۶۲	۸.۵۲۹.۴۴۵	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان که صندوقی با سرمایه باز 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 ۱۴۰۴

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 می‌باید.

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: موسسه حسابرسی بهراد مشار است که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۳/۰۶ با شماره ثبت ۱۳۸۹۸ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر، کوچه نورزدهم، پلاک ۵، طبقه اول، واحد ۱۰۱.

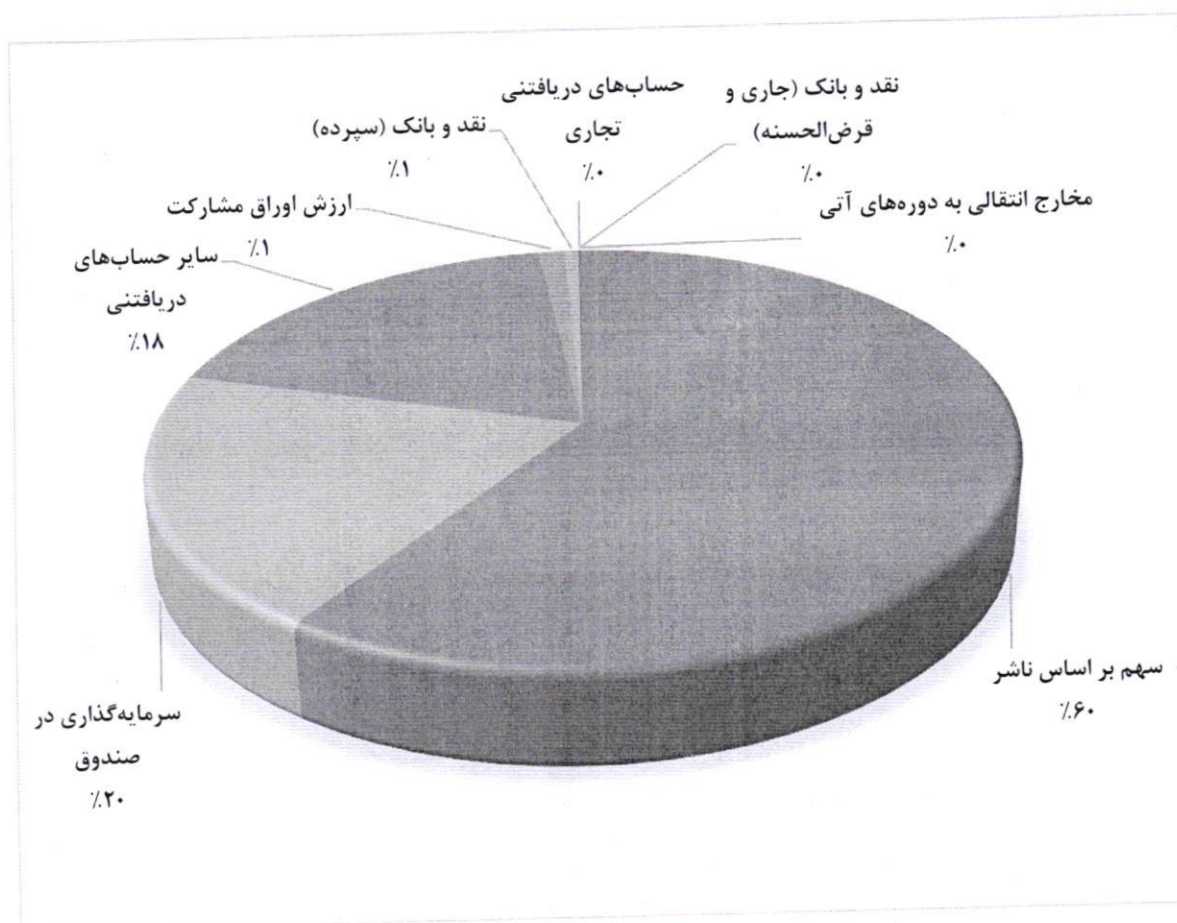
حسابرس صندوق: موسسه حسابرسی رازداراست که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ به شماره ثبت ۱۱۷۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است تهران، میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر (بخارست)، کوچه نورزدهم، پلاک ۱۸، واحد ۱۴ (طبقه ۷).

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

ترکیب دارایی

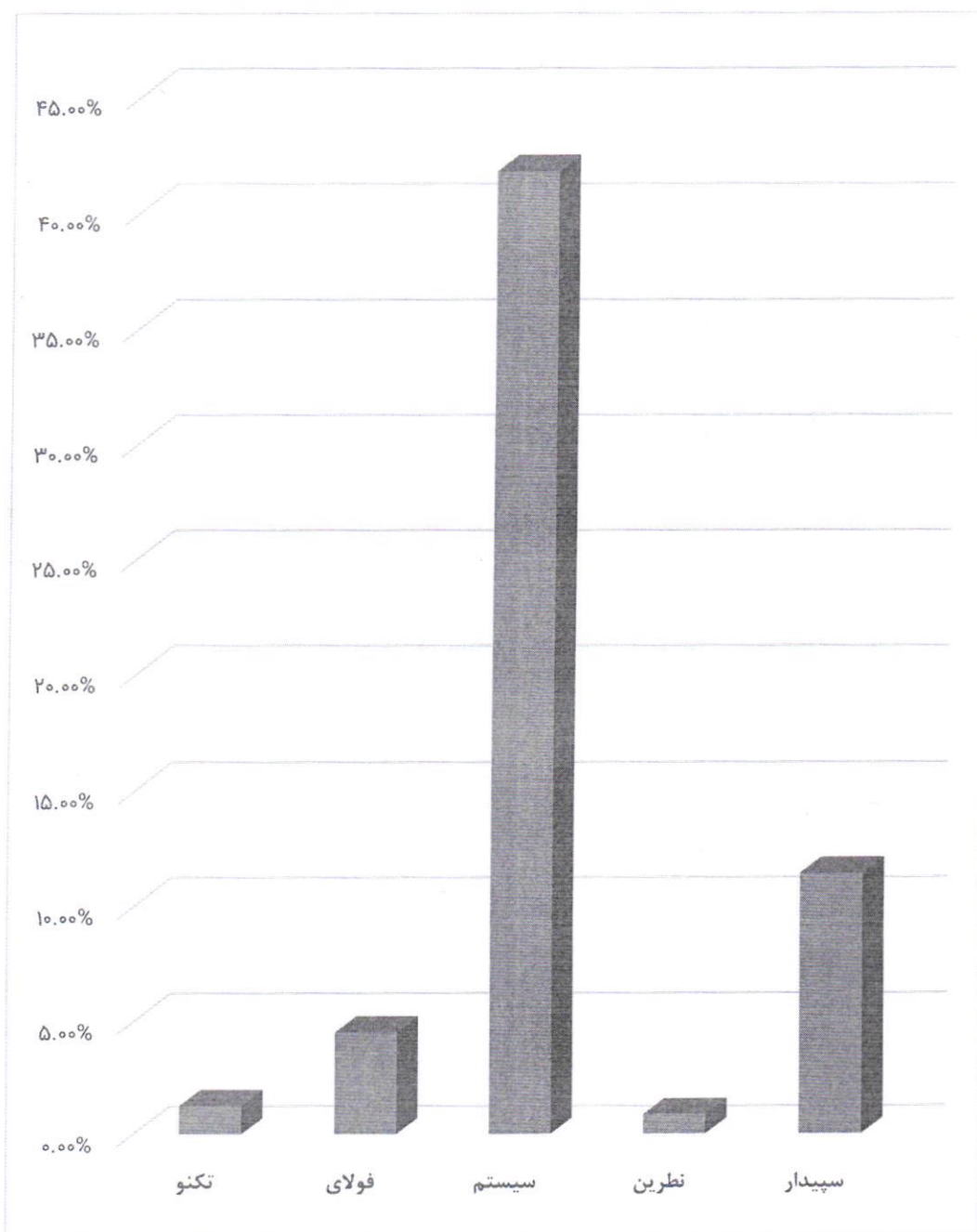


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

سهام براساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

جدول فعالیت صندوق

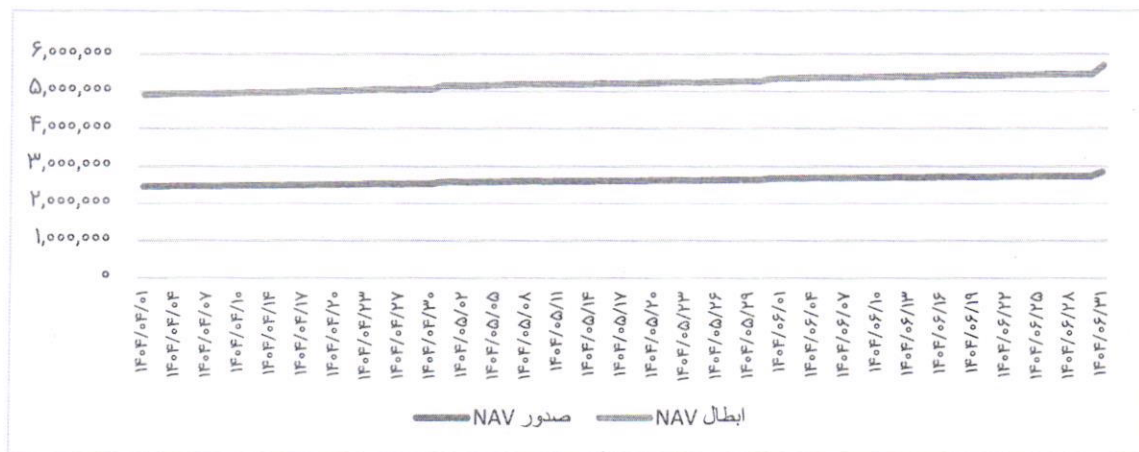
فعالیت‌های صندوق	
NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۱,۰۹۶,۱۹۰
NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۳/۰۶/۳۱	۱,۶۸۰,۲۳۶
کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۹,۳۳۶,۹۳۲,۴۴۳,۰۳۸
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۱	۸,۵۲۹,۴۴۵
تعداد کل واحدهای صادر شده طی سال	۷,۳۵۵,۴۴۸
تعداد کل واحدهای باطل شده طی سال	۸۶۰,۲۶۷
بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال	(٪ ۷/۴۰)
بازده سرمایه‌گذاری پایان سال	(٪ ۷/۲۰)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

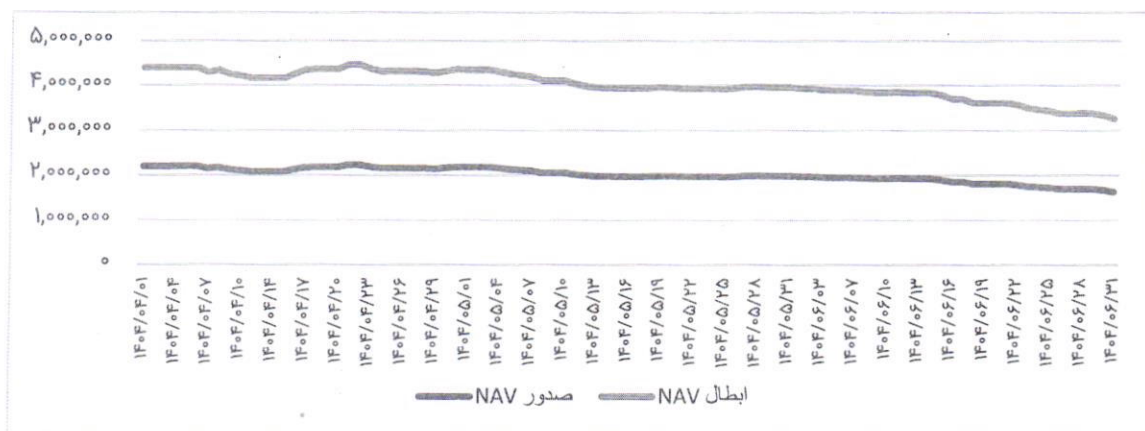
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

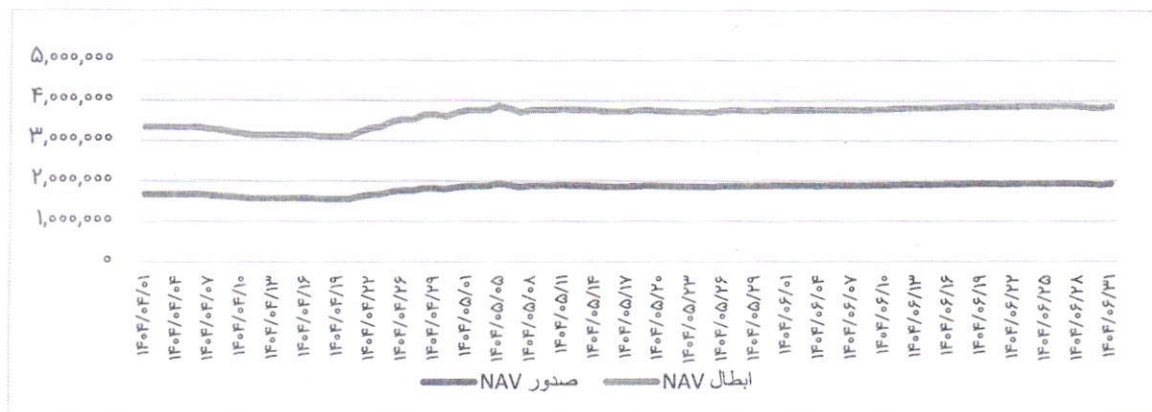
نمودار NAV رشد:



نمودار NAV سپیدار:



نمودار NAV پتروآبان:

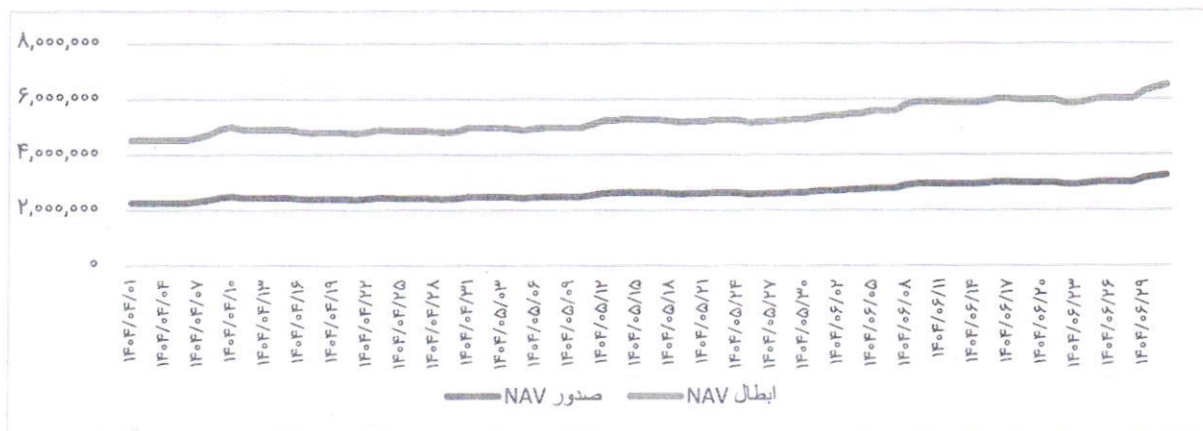


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

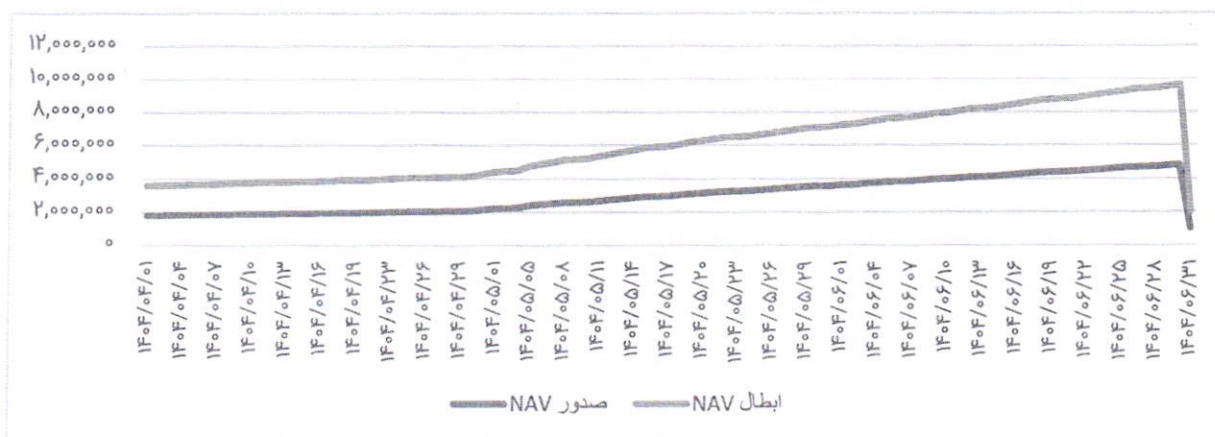
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

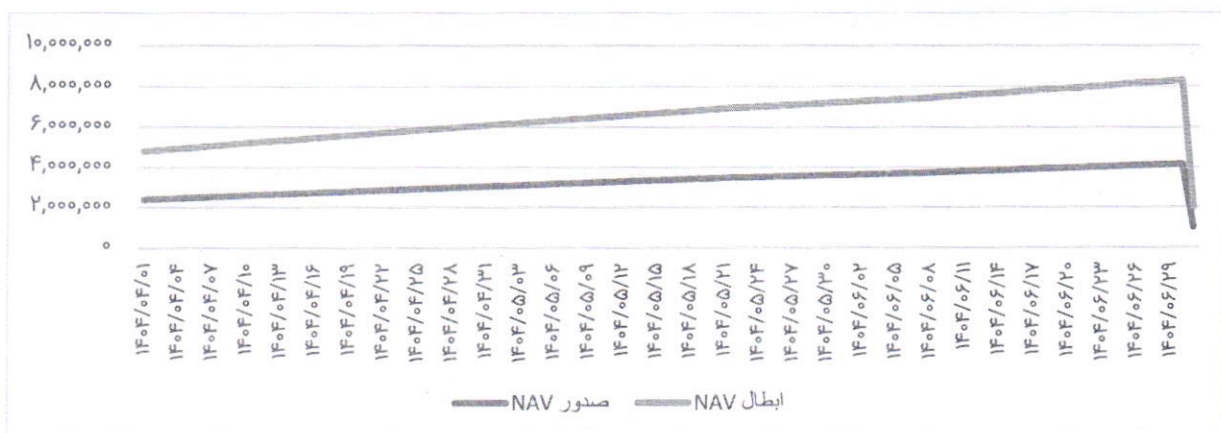
نمودار NAV درخشان آبان:



نمودار NAV صگل ۰۷۱:



نمودار NAV شهیدرو ۰۵۲:

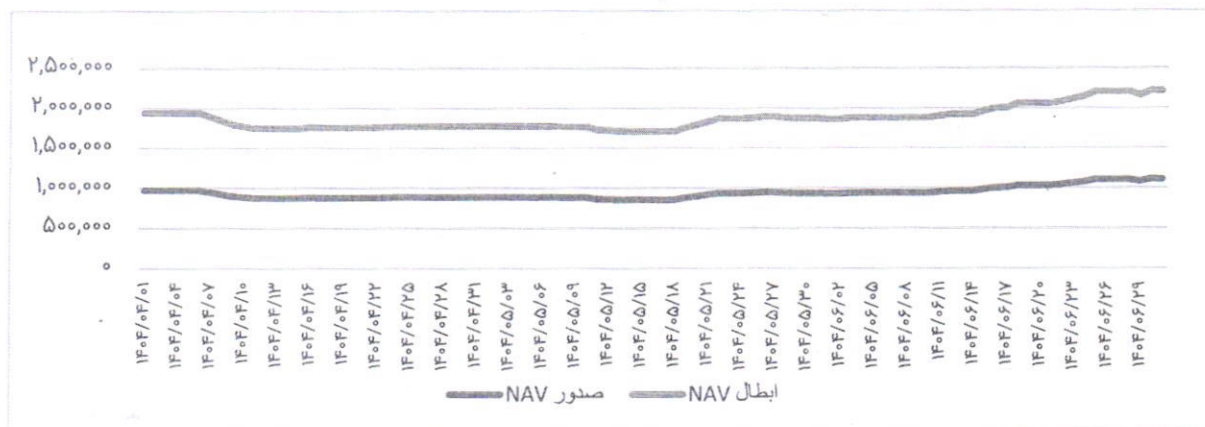


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

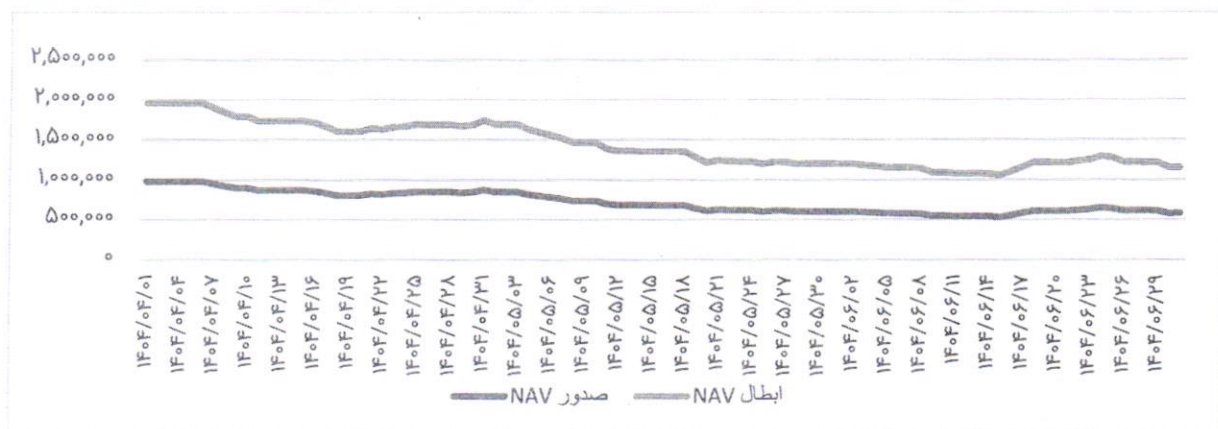
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

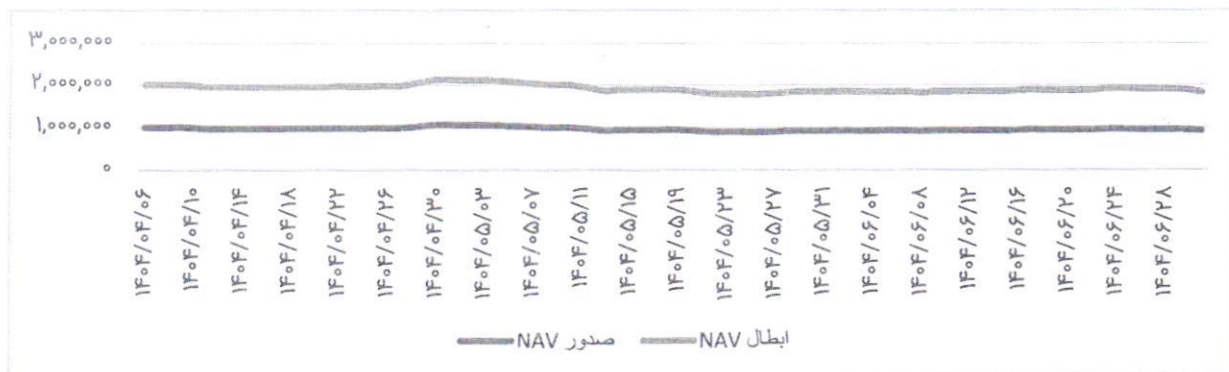
نمودار NAV تکنو:



نمودار NAV نظرین:



نمودار NAV سیستم:

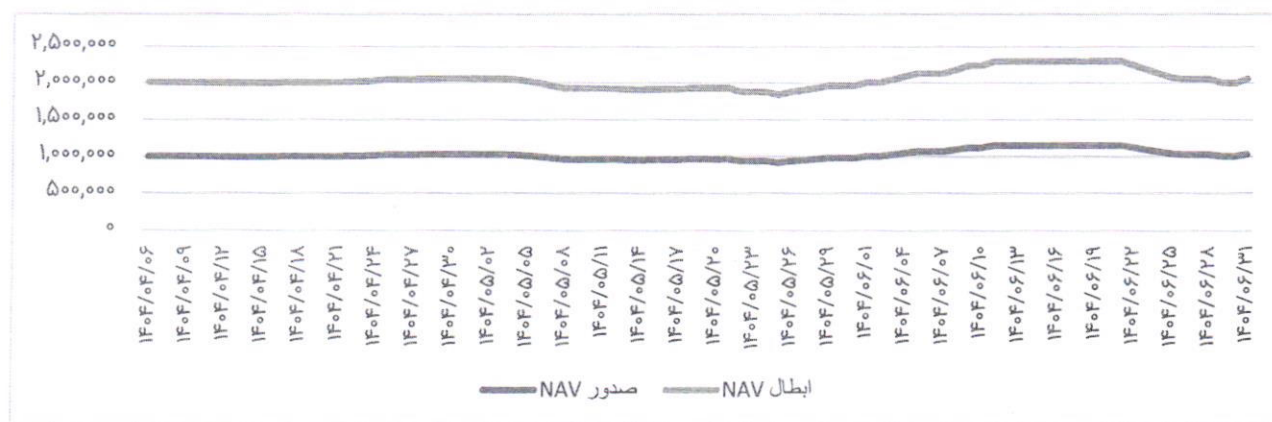


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

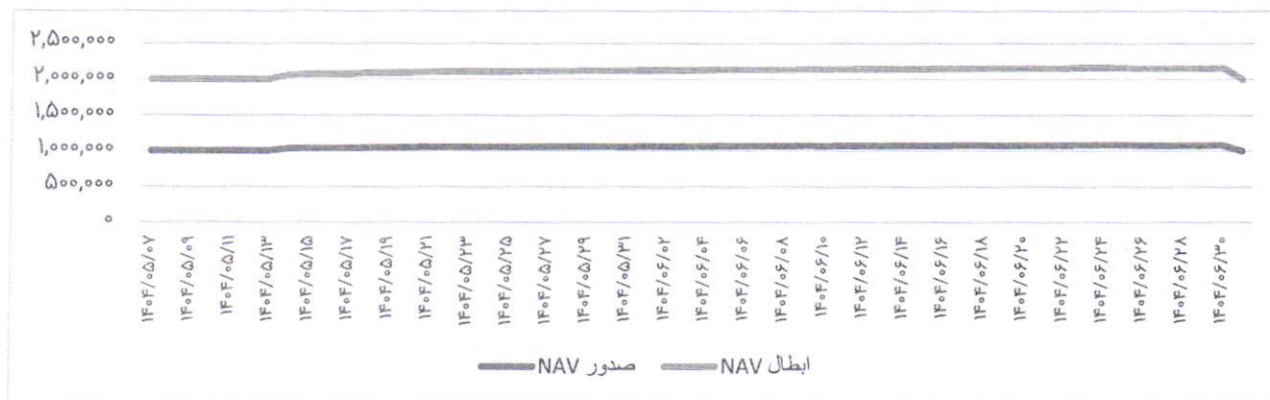
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

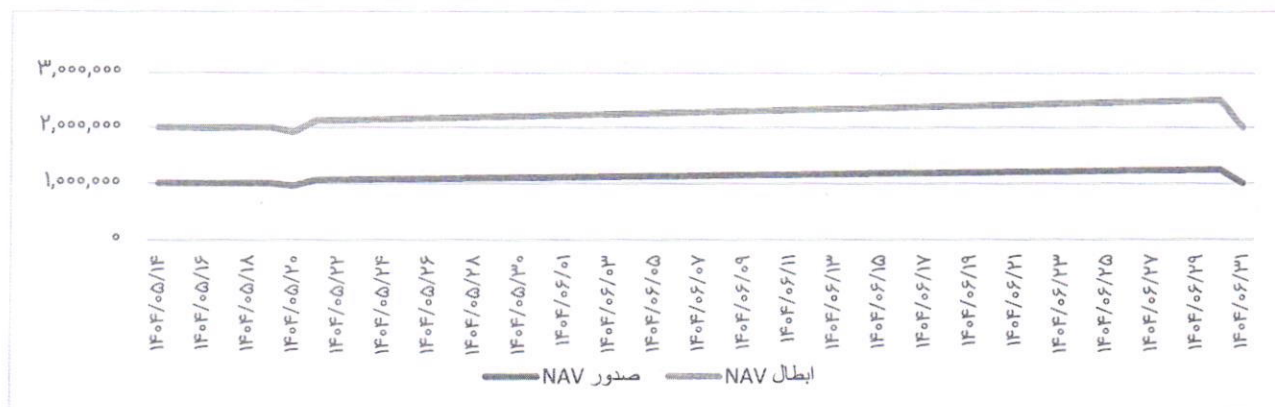
نمودار NAV فولادی:



نمودار NAV پولادی:



نمودار NAV لفاف صنعت:

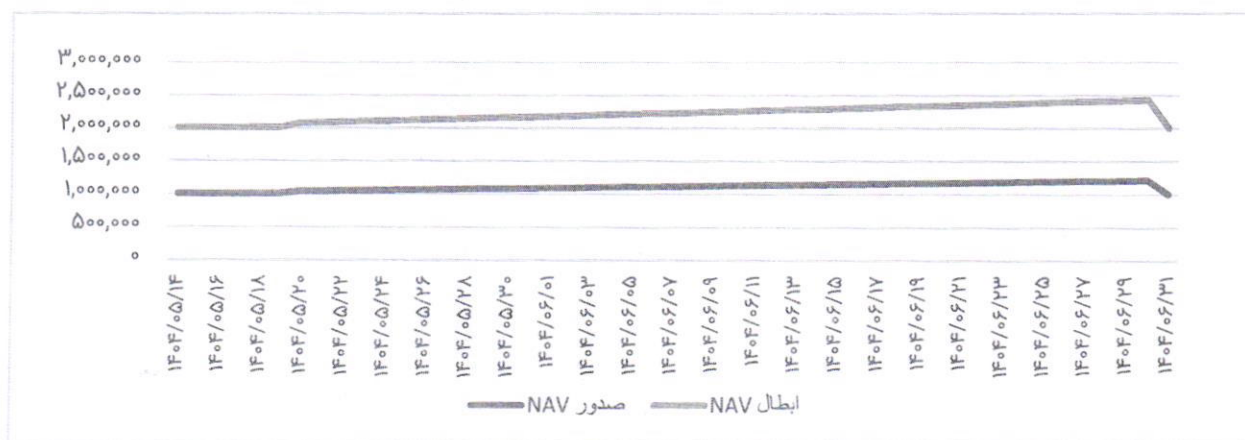


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

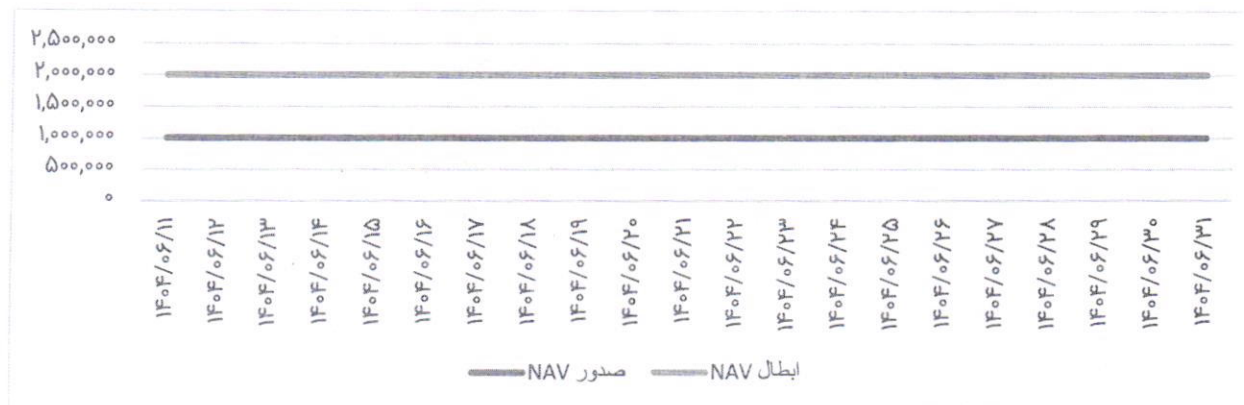
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۴

نمودار NAV آناهیتا:



نمودار NAV اوراق شهرداری (قطار شهری):



نمودار NAV اوراق شهرداری (اتوبوسرانی):

