
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

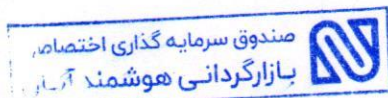
سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به سال مالی منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ 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 می‌گردد.

شماره صفحه	
۲	• صورت خالص دارایی‌ها
۳	• صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها
۴	• تاریخچه صندوق
۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۶	• ترکیب صنعت
۷	• جدول فعالیت صندوق
۸-۹	• نمودار NAV
۱۰-۱۱	• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

با سپاس



امضاء

نماینده

بابک حقیقی مهمانداری

شخص حقوقی

شرکت کارگزاری آبان

ارکان صندوق

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

سال مالی منتهی به ۳۱/۰۳/۱۳۹۹	سال مالی منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۰	
ریال	ریال	درآمدها:
۸۱,۷۱۲,۱۸۷,۴۹۰	(۶۲,۶۴۹,۵۴۵,۶۴۸)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۸,۳۱۹,۳۵۱,۵۹۹	(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	سود (زیان) تحقق تلافیه نگهداری اوراق بهادار
۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	سود سهام
۲,۱۲۷,۶۴۹,۴۵۵	۴,۸۷۰,۵۲۵,۳۹۵	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت با علی الحساب
۱۰۳,۰۱۰	۸۵۰,۶۶۹	سایر درآمدها
۹۳,۸۷۷,۷۸۴,۲۳۴	(۷۵,۶۸۶,۲۴۹,۵۱۳)	جمع درآمدها (زیان‌ها)
		هزینه‌ها:
(۱,۳۷۵,۸۱۷,۳۴۶)	(۲,۶۳۰,۷۶۴,۸۰۷)	هزینه کارمزد ارکان
(۶۱۹,۲۹۴,۷۹۳)	(۸۱۴,۳۰۹,۲۹۶)	سایر هزینه‌ها
(۱,۸۹۵,۱۱۲,۱۳۹)	(۳,۴۴۵,۰۷۴,۱۰۳)	جمع هزینه‌ها
۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)	سود (زیان) خالص
۱۰۰,۸۷%	۵۰,۵۴%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره (سال ۱)
۴۹,۹۳%	۱۰۶,۸۶%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (سال ۲)

صورت گردش حالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۳۱/۰۳/۱۳۹۹		سال مالی منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۰		
ریال	تعداد واحدها	ریال	تعداد واحدها	
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	۲۰,۶۴۰,۹۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای سال
۹۴,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴,۹۰۰	۲۶,۵۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۲۶,۵۰۷	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی سال
(۶,۲۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۶,۲۸۰)	(۲۴,۳۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۴,۳۶۲)	واحدهای سرمایه‌گذاری انقضاء شده طی سال
۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	.	(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)	.	سود خالص سال
(۱۱,۹۸۴,۶۶۱,۸۳۹)	.	(۵۵,۴۸۸,۱۹۰,۲۶۱)	.	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صندوق و انقضاء
۲۰,۶۴۰,۹۷۸,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۷۲,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان سال

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

- 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 و 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 درج گردیده است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

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	۳,۰۰۰	۱۷,۲
۲	کارگزاری آبان	۱۴,۵۰۰	۸۲,۸
	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 ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است میدان توحید، خیابان توحید پلاک ۶۸ طبقه اول.

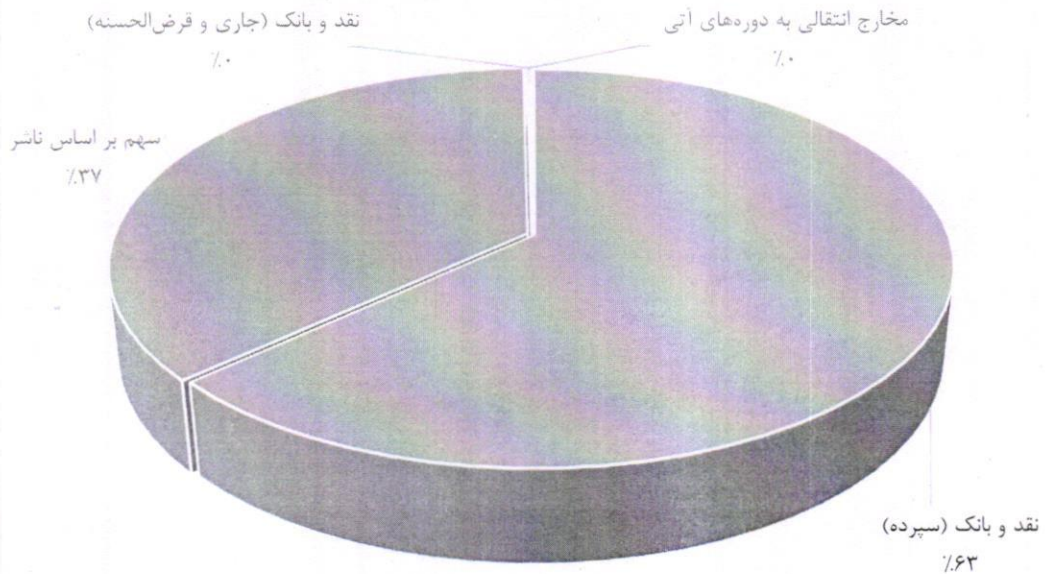
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

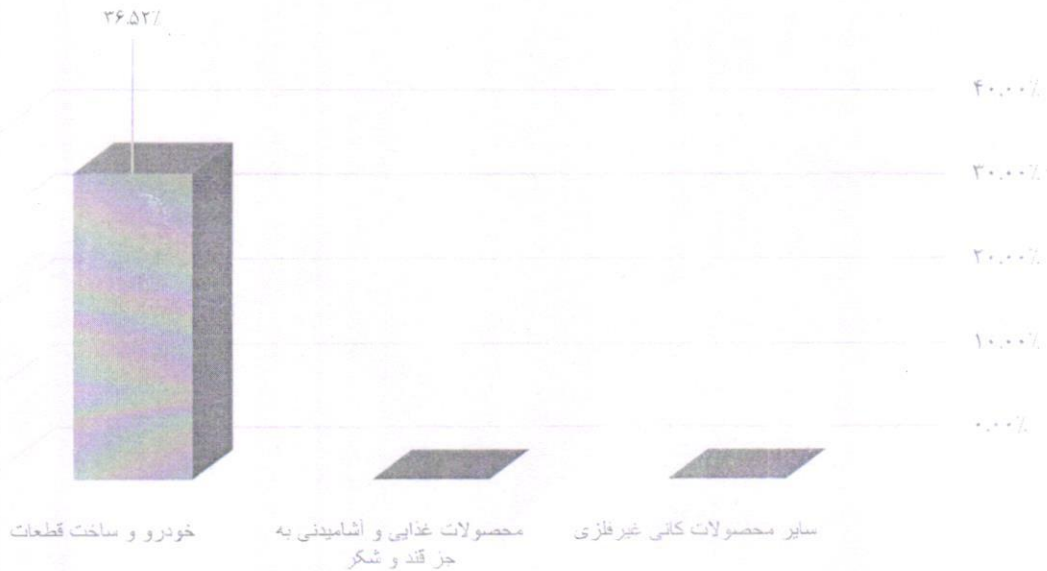
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

ترکیب دارایی‌ها



سهام بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۱.۷۶۳.۷۷۱	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۴/۰۱
۶۱۹.۵۶۱	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
۷۳.۹۳۵.۲۷۴.۱۱۱	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
۱۱۹.۴۱۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۰/۰۳/۳۱
۲۶.۵۰۷	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۲۴.۳۶۲	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
(۵۰.۵)%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره / سال مالی
(۱۰۶.۸۶)%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره / سال مالی

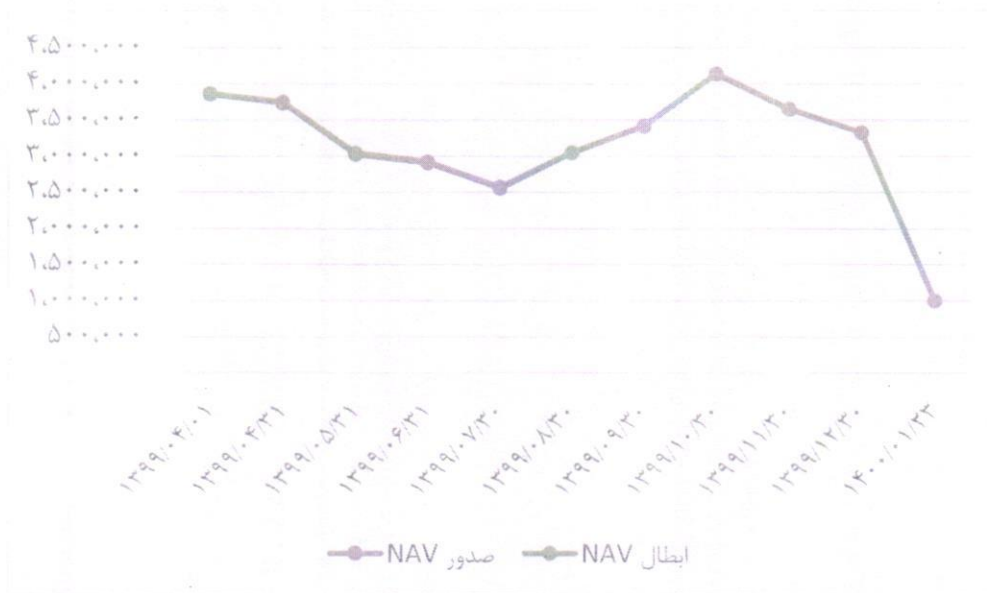
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

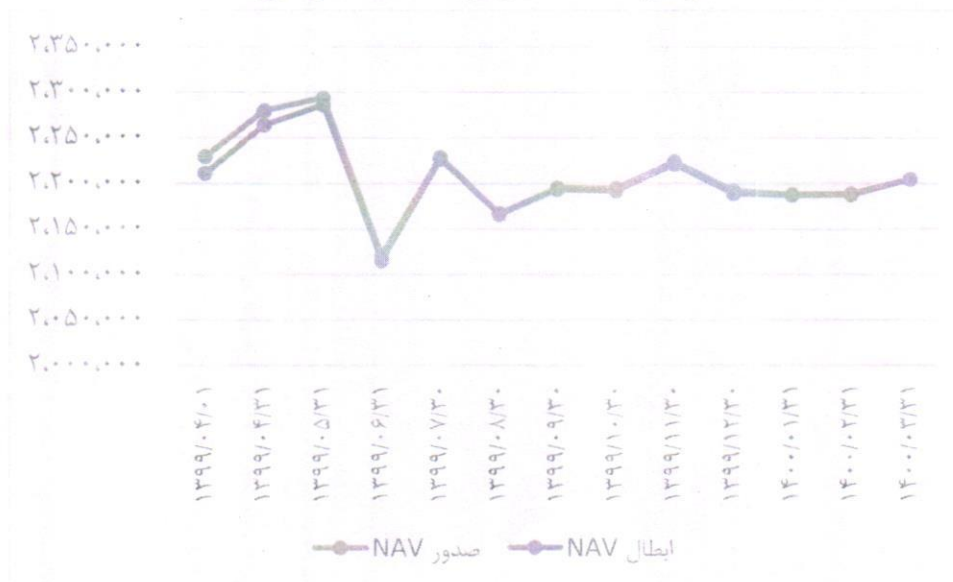
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

نمودار NAV کارخانجات تولیدی شیشه رازی



نمودار NAV نیلی صنعت کرمان



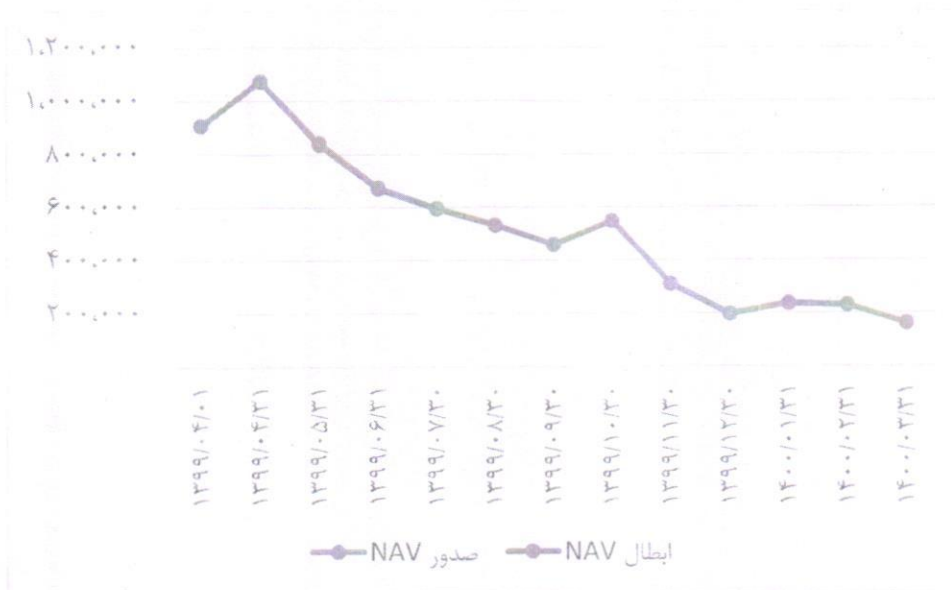
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

نمودار NAV سهم سایپا دیزل



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

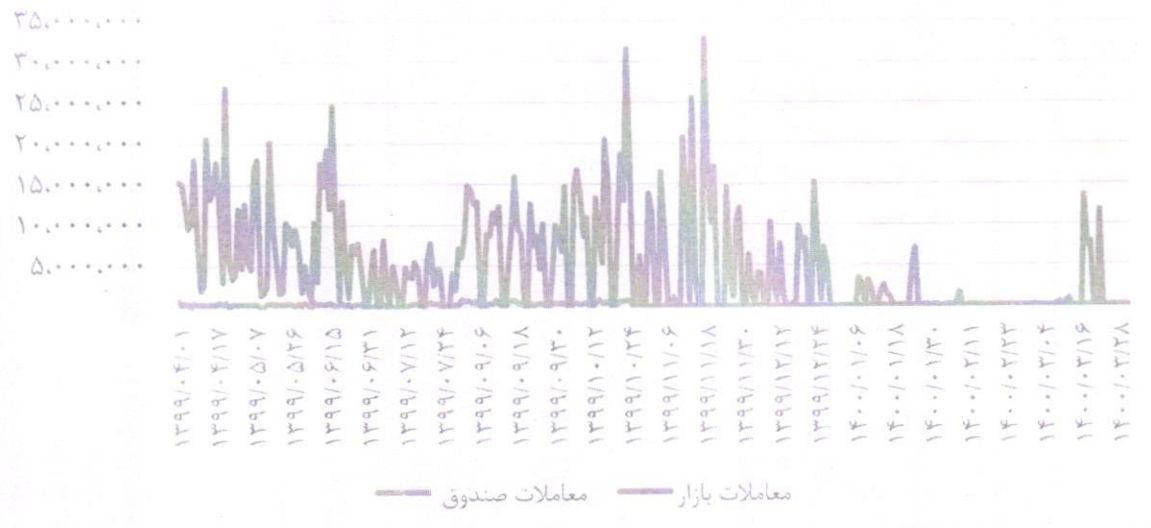
گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

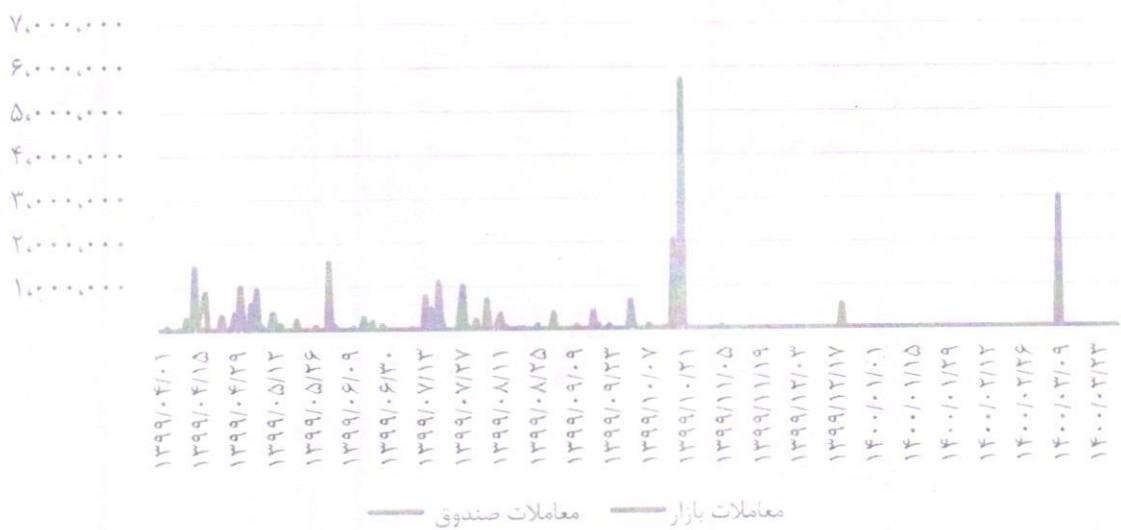
سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• کارخانجات تولیدی شیشه رازی:



• نیلی صنعت کرمان:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های پایان دوره ای

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۰

• سایپا دیزل :

