
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ 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 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

۶

• ترکیب صنعت

۷

• جدول فعالیت صندوق

• نمودار NAV

۸-۹

• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق



امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمانداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی هوشمند آبان



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۳۴,۶۱۱,۳۴۳,۳۹۸	۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۵۹,۹۵۸,۸۲۶,۵۱۲	۸۳,۷۱۰,۸۵۸,۸۴۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
.	۶۳,۳۲۴,۱۰۷	جاری کارگزاران
۱۰,۵۴۲,۴۲۱	.	سایر دارایی‌ها
۹۸,۰۸۳,۴۹۱	۱۰۱,۷۶۸,۳۳۰	موجودی نقد
۹۴,۷۷۳,۶۷۹,۸۲۲	۱۰۴,۶۹۴,۴۲۴,۱۲۲	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۱۸,۹۵۲,۹۹۹,۶۵۰	.	جاری کارگزاران
۱,۳۰۰,۵۲۱,۶۳۳	۵۰۸,۷۰۷,۹۳۸	پرداختنی به ارکان صندوق
.	۱۶,۱۳۱,۸۶۱,۲۱۸	پرداختنی به سرمایه‌گذاران
۵۸۴,۸۸۴,۴۲۸	۵۵۴,۴۳۴,۳۷۴	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۲۰,۸۳۸,۴۰۵,۷۱۱	۱۷,۱۹۵,۰۰۳,۵۳۰	جمع بدهی‌ها
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۸۷,۴۹۹,۴۲۰,۵۹۲	خالص دارایی‌ها
۶۱۹,۱۳۰	۱,۰۴۱,۷۲۲	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	درآمدها:
ریال	ریال	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۶۲,۶۴۹,۵۴۵,۶۴۸)	۱,۸۶۳,۱۸۰,۵۶۵	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
(۱۸,۲۳۱,۱۰۱,۵۲۹)	۶۴۸,۰۴۳,۳۷۱	سود سهام
۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	.	سود(زیان) اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴,۸۷۰,۵۳۵,۳۹۵	۶,۱۶۱,۷۲۷,۸۷۹	سایر درآمدها
۸۵۰,۶۶۹	۳۱۵,۱۹۹	جمع درآمدها
(۷۵,۶۸۶,۲۴۹,۵۱۳)	۸,۶۷۳,۲۶۷,۰۱۴	هزینه ها:
(۲,۶۳۰,۷۶۴,۸۰۷)	(۸۲۹,۲۶۴,۹۸۰)	هزینه کارمزد ارکان
(۸۱۴,۳۰۹,۲۹۶)	(۱,۶۵۸,۱۳۴,۷۰۵)	سایر هزینه ها
(۳,۴۴۵,۰۷۴,۱۰۳)	(۲,۴۸۷,۳۹۹,۶۸۵)	جمع هزینه ها
(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)	۶,۱۸۵,۸۶۷,۳۲۹	سود (زیان) خالص
۵۰,۵۴/-	۸,۰۳%	بازده میانگین سرمایه گذاری (۱)
۱۰۶,۸۶/-	۷,۰۷%	بازده سرمایه گذاری پایان سال (۲)

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) ابتدای سال
تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی سال
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی سال
۲۶,۵۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۲۶,۵۰۷	۶۶,۴۹۵,۰۰۰,۰۰۰	۶۶,۴۹۵	سود (زیان) خالص سال
(۲۴,۳۶۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۲۴,۳۶۲)	(۱۰۱,۹۱۸,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰۱,۹۱۸)	تعدیلات
(۷۹,۱۳۱,۳۲۳,۶۱۶)	.	۶,۱۸۵,۸۶۷,۳۲۹	.	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) پایان سال
(۵۵,۴۸۸,۱۹۰,۲۶۱)	.	۴۲,۸۰۱,۲۷۹,۱۵۲	.	
۷۳,۹۳۵,۲۷۴,۱۱۱	۱۱۹,۴۱۸	۸۷,۴۹۹,۴۲۰,۵۹۲	۸۳,۹۹۵	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی هوشمند آبان



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد 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 smart.aban.net درج گردیده است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد 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 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	سبذگردان 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

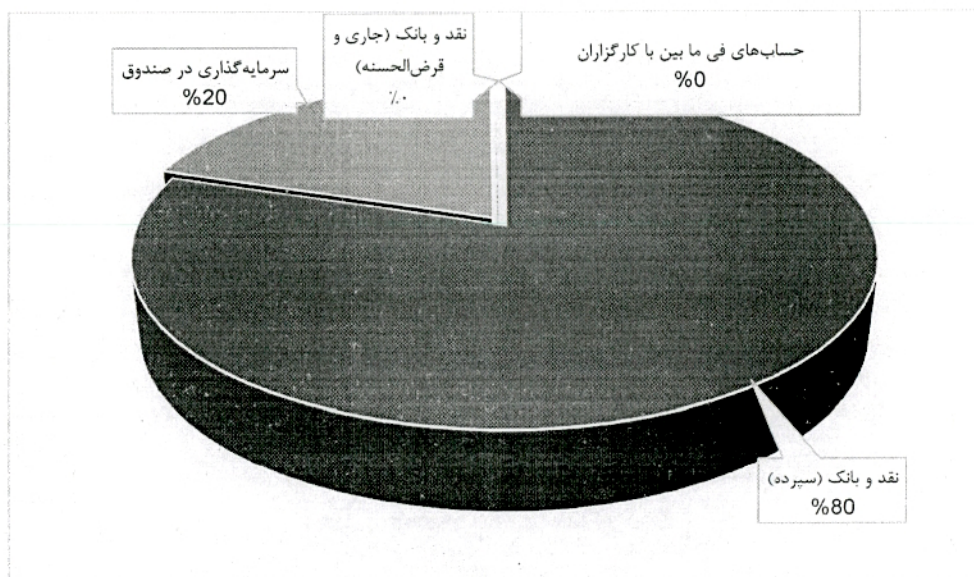
متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷
حسابرس صندوق: مؤسسه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

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

ترکیب دارایی‌ها



سهام براساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

جدول فعالیت صندوق

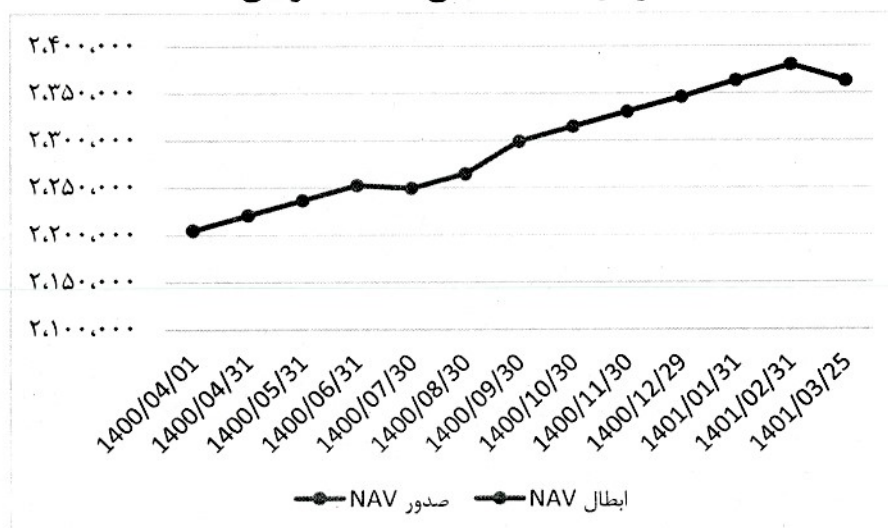
فعالیت‌های صندوق	
۶۲۸,۱۲۴	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۰/۰۴/۰۱
۱,۰۴۱,۷۳۴	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱
۸۷,۴۹۹,۴۲۰,۵۹۲	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱
۸۳,۹۹۵	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱
۶۶,۴۹۵	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۱۰۱,۹۱۸	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۸,۰۳٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال / سال مالی
۷,۰۷٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال / سال مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

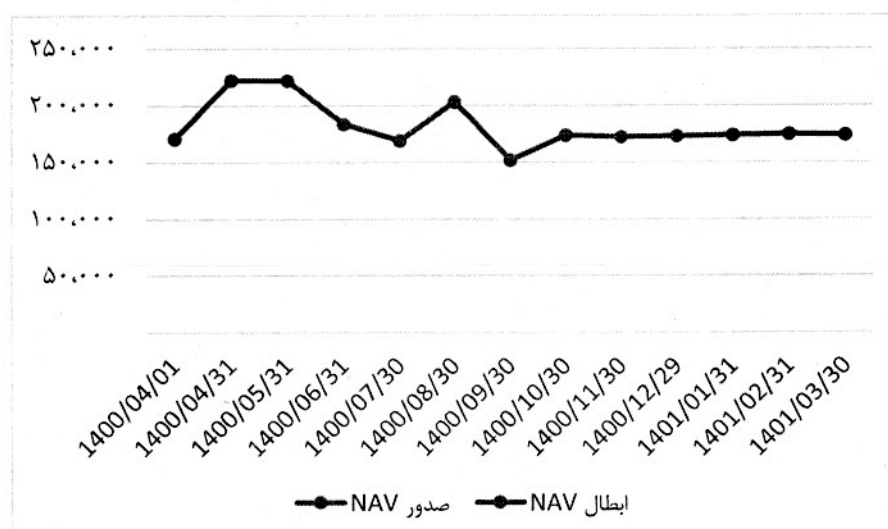
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

نمودار NAV نیلی صنعت کرمان



نمودار NAV سهم سایپا دیزل

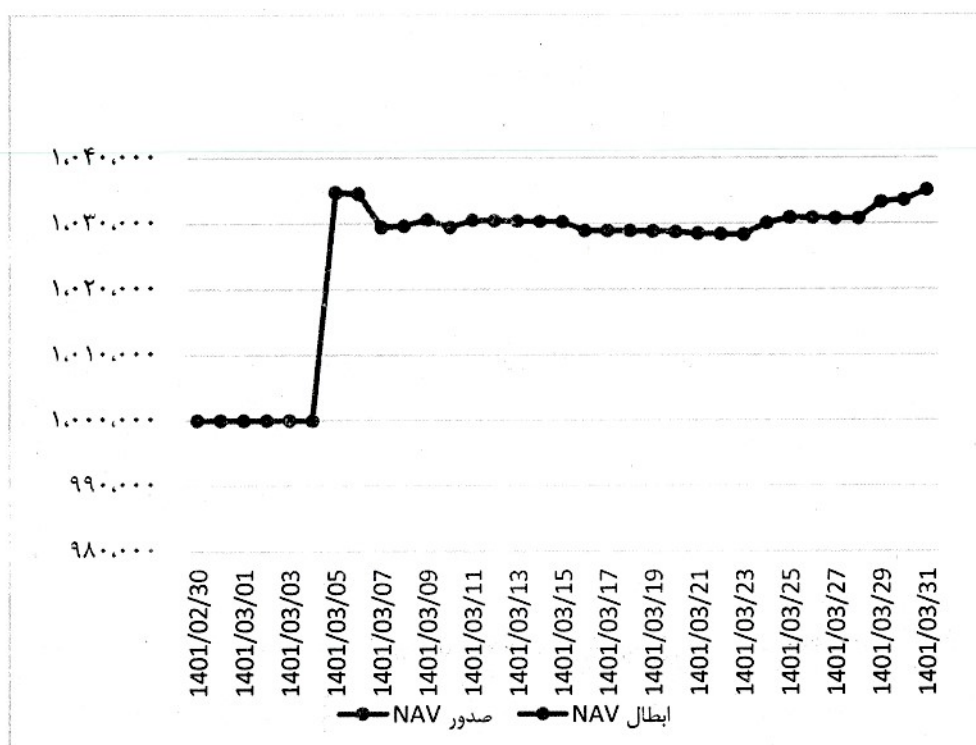


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

نمودار NAV صندوق رشد پایدار



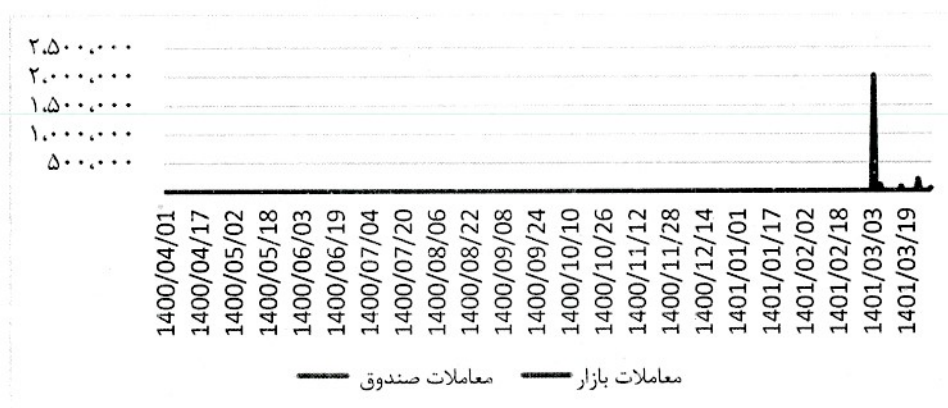
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

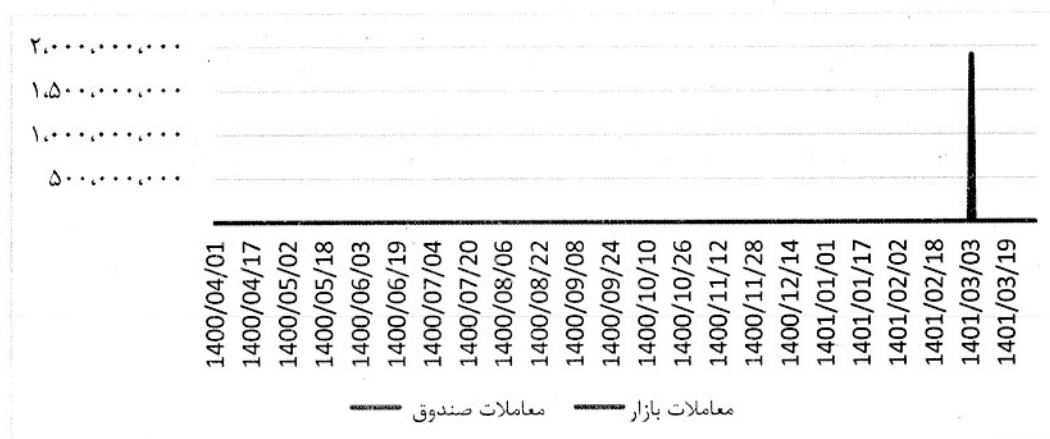
سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• صندوق رشد پایدار:



• نیلی صنعت کرمان:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

• سایپا دیزل :

