
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱ 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
بابک حقیقی مهمانداری شرکت کارگزاری آبان مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

۱۴۰۱/۰۳/۳۱	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۰.۸۱۸.۴۷۲.۸۳۹	۸۵.۸۱۹.۷۶۰.۰۱۵	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۸۳.۷۱۰.۸۵۸.۸۴۶	۳۶.۵۶۷.۲۲۱	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۰	۲.۷۹۲.۰۸۷.۰۴۸	حساب‌های دریافتی
۰	۶۹.۷۴۸.۶۸۵	سایر دارایی‌ها
۱۰۱.۷۶۸.۳۳۰	۹۷.۳۲۴.۳۳۰	موجودی نقد
۶۳.۳۲۴.۱۰۷	۱۰.۳۸۹.۵۴۵.۰۷۷	جاری کارگزاران
<u>۱۰۴.۶۹۴.۴۲۴.۱۲۲</u>	<u>۹۹.۲۰۵.۰۳۲.۳۷۶</u>	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۵۰۸.۷۰۷.۹۳۸	۴۹۱.۸۷۳.۰۵۹	پرداختی به ارکان صندوق
۱۶.۱۳۱.۸۶۱.۲۱۸	۰	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۰	۳۱۹.۶۵۹.۱۲۶	تسهیلات مالی دریافتی
۵۵۴.۴۳۴.۳۷۴	۱.۳۹۱.۵۱۷.۵۵۱	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
<u>۷.۱۹۵.۰۰۳.۵۳۰</u>	<u>۲.۱۰۳.۰۴۹.۷۳۶</u>	جمع بدهی‌ها
<u>۸۷.۴۹۹.۴۲۰.۵۹۲</u>	<u>۹۷.۱۰۱.۹۸۲.۶۴۰</u>	خالص دارایی‌ها
<u>۱.۰۴۱.۷۲۲</u>	<u>۱.۱۵۶.۰۴۵</u>	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰	دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	درآمدها:
۱,۵۶۱,۲۵۸,۷۲۸	(۱,۸۳۰,۱۷۲,۸۴۸)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۱,۷۱۷,۶۲۲,۶۲۳)	۴۱۰,۹۹۰,۰۶۴	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۸۰,۶۱,۵۲۸,۴۲۸	سود تقسیمی صندوق های سرمایه‌گذاری
۳,۰۶۲,۹۱۷,۸۳۱	۳۳,۱۱۷,۴۰۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
.	۵,۰۸۱,۲۶۳,۲۰۳	سایر درآمدها
۲,۹۰۶,۵۵۳,۹۳۶	۱۱,۷۵۶,۷۲۶,۲۵۶	جمع درآمدها
		هزینه‌ها:
(۴۱۴,۸۷۶,۲۵۶)	(۶۲۴,۴۱۹,۴۴۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۶۲۲,۴۱۳,۴۸۲)	(۱,۵۰۸,۰۱۷,۴۲۹)	سایر هزینه‌ها
(۱,۰۳۷,۲۸۹,۷۳۸)	(۲,۱۳۲,۴۳۶,۸۷۸)	جمع هزینه‌ها
(۱۴۹,۹۷۰,۶۳۲)	(۲۱,۷۲۷,۳۳۰)	هزینه های مالی
۱,۷۱۹,۲۹۳,۵۶۶	۹,۶۰۲,۵۶۲,۰۴۸	سود خالص
۲,۲۵%	۱۰,۵۳%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (۱)
۲,۳۸%	۹,۸۹%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (۲)

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰		
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
(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰)	.	.	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۳,۵۰۵,۶۲۲,۴۷۳	.	۹,۶۰۲,۵۶۲,۰۴۸	.	سود خالص دوره
(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	.	.	.	تعدیلات
۷۳,۹۵۲,۰۹۰,۷۴۴	۱۱۷,۸۵۸	۹۷,۱۰۱,۹۸۲,۶۴۰	۸۳,۹۹۵	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

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 ۱۲۲/۹۸۴۳۷ 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 منتهی به ۳۰ آذر 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

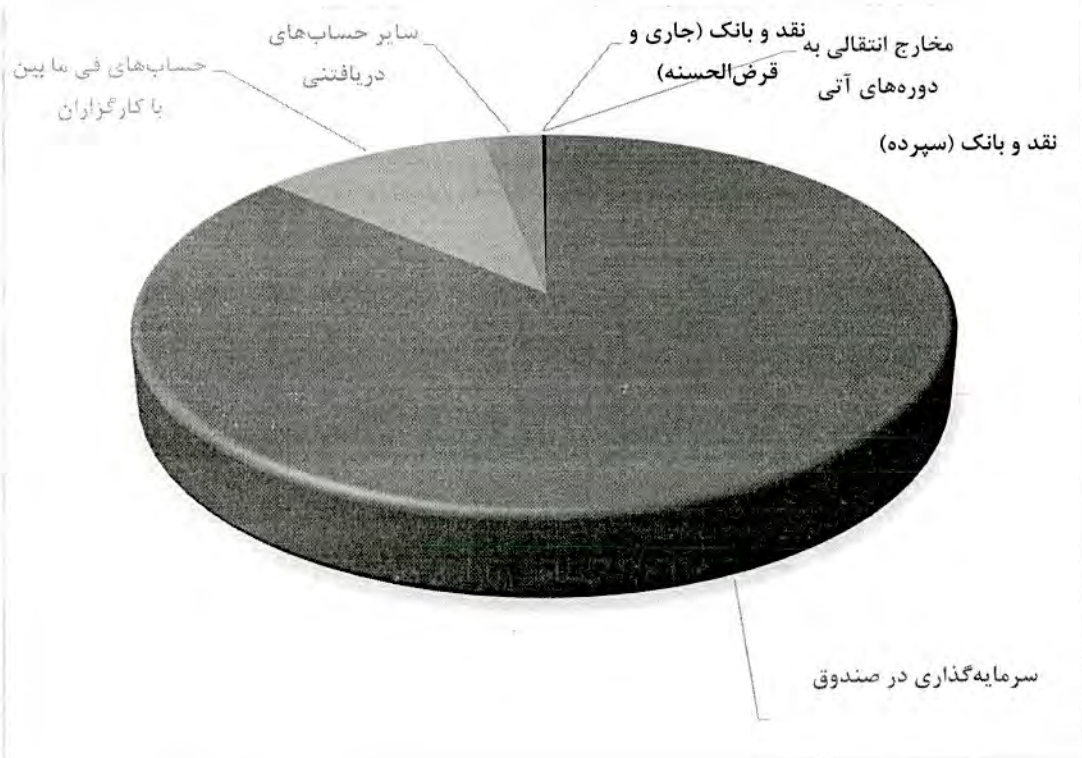
متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷ حسابرس صندوق: مؤسسه 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 آبهنسان، 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 منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

ترکیب دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

جدول فعالیت صندوق

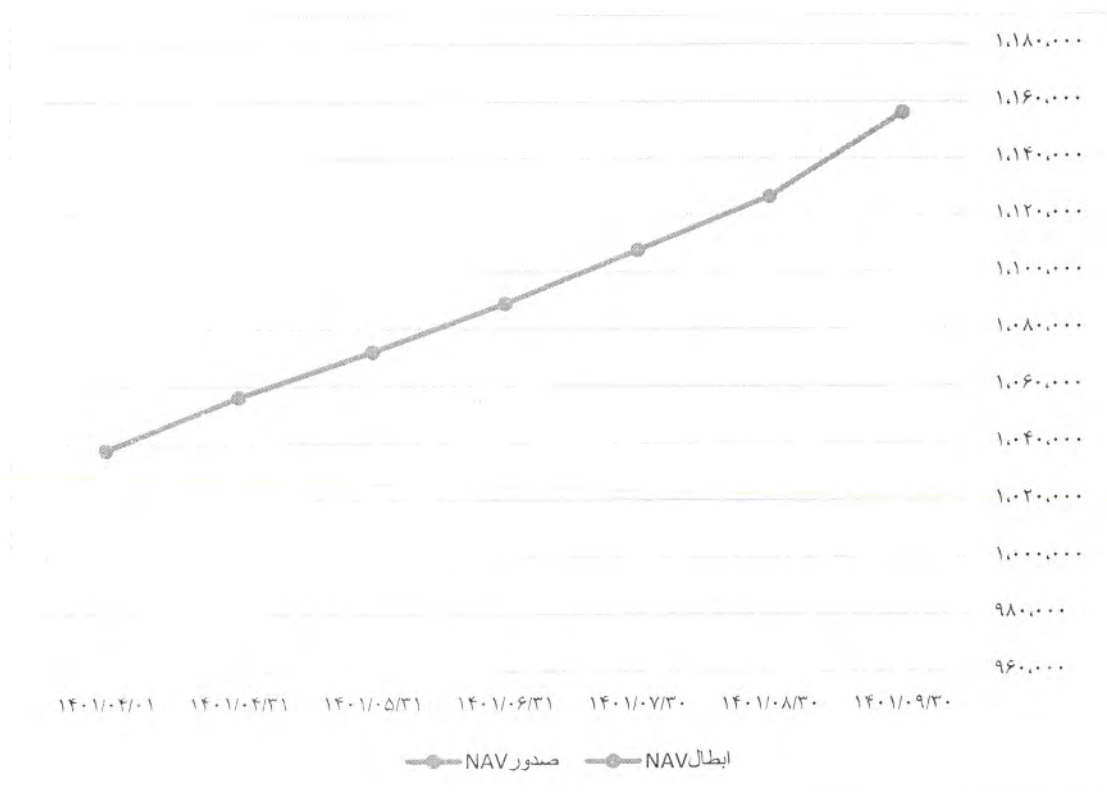
فعالیت‌های صندوق	
۱۰,۳۷,۶۷۵	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۰۱
۱,۱۵۶,۱۲۱	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۹۷,۱۰۱,۹۸۲,۶۴۰	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۸۳,۹۹۵	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۱۰,۵۸٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی
۹,۸۹٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

نمودار NAV صندوق رشد پایدار



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره منتهی به ۳۰ آذر ۱۴۰۱

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• صندوق رشد پایدار:

