

---

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

---



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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

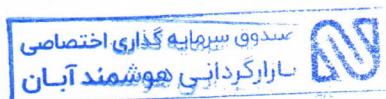
• جدول فعالیت صندوق

۸

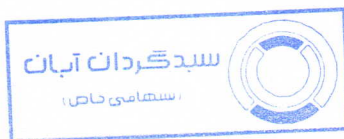
• نمودار NAV

۹

• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق



با سپاس



امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

الهام مرادی

شرکت سبذگردان آبان

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

۱۴۰۱/۰۳/۳۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	
ریال	ریال	
		<b>دارایی‌ها:</b>
۲۰,۸۱۸,۴۷۲,۸۳۹	۸۰,۷۵۱,۶۲۵,۳۵۸	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۸۳,۷۱۰,۸۵۸,۸۴۶	۵,۶۴۲,۵۸۰,۰۵۳	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۰	۴,۹۴۴,۱۰۷,۲۲۶	حساب‌های دریافتی
۰	۲۵,۹۹۳,۶۹۰	سایر دارایی‌ها
۱۰۱,۷۶۸,۳۳۰	۹۴,۴۹۴,۳۳۰	موجودی نقد
۶۳,۳۲۴,۱۰۷	۱۷,۳۵۳	جاری کارگزاران
<b>۱۰۴,۶۹۴,۴۲۴,۱۲۲</b>	<b>۹۱,۴۵۸,۸۱۸,۰۱۰</b>	<b>جمع دارایی‌ها</b>
		<b>بدهی‌ها:</b>
۵۰,۸۰۷,۰۷۰,۹۳۸	۴۹۳,۷۷۲,۸۴۴	پرداختی به ارکان صندوق
۱۶,۱۳۱,۸۶۱,۲۱۸	۰	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۰	۲۱۹,۶۵۹,۱۲۶	تسهیلات مالی دریافتی
۵۵۴,۴۳۴,۳۷۴	۱,۳۹۲,۴۶۶,۹۵۵	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
<b>۷,۱۹۵,۰۰۳,۵۳۰</b>	<b>۱,۸۸۶,۲۳۹,۷۹۹</b>	<b>جمع بدهی‌ها</b>
<b>۸۷,۴۹۹,۴۲۰,۵۹۲</b>	<b>۸۹,۵۷۲,۵۷۸,۲۱۱</b>	<b>خالص دارایی‌ها</b>
<b>۱,۰۴۱,۷۲۲</b>	<b>۱,۲۲۳,۸۷۰</b>	<b>خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری</b>

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

### گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹	
ریال	ریال	درآمدها:
۱,۸۱۳,۹۰۱,۸۰۷	(۳,۵۴۲,۰۰۵,۸۱۱)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
.	۳۳۹,۹۱۳,۲۷۵	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۱۳,۷۱۰,۷۶۱,۷۲۸	سود تقسیمی صندوق های سرمایه‌گذاری
۴,۷۲۹,۷۵۸,۶۹۴	۳۶,۶۵۲,۵۹۲	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
.	۷۱۱,۱۲۵,۲۸۳	درآمد حاصل از بازارگردانی
.	۱۲۳,۱۵۸,۰۹۸	سایر درآمدها
۶,۵۴۳,۶۶۰,۵۰۱	۱۷,۷۷۸,۶۰۵,۱۶۵	جمع درآمدها
		هزینه‌ها:
(۵۶۰,۳۳۰,۹۹۳)	(۹۹۹,۲۶۹,۸۶۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۹۲۵,۴۲۸,۶۸۲)	(۱,۹۹۳,۴۶۲,۸۶۴)	سایر هزینه‌ها
(۱,۴۸۵,۷۵۹,۶۷۵)	(۲,۹۹۲,۷۳۲,۷۳۳)	جمع هزینه‌ها
(۱۷۱,۷۷۰,۴۶۵)	(۷۰,۳۴۱,۵۶۰)	هزینه های مالی
۴,۸۸۶,۱۳۰,۳۶۱	۱۴,۷۱۵,۵۳۰,۸۷۲	سود خالص
۶,۴۵%	۱۶,۳۴%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (۱)
۶,۴۹%	۱۶,۴۳%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (۲)

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹		دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹		
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
.	.	۳۹,۶۷۵,۰۰۰,۰۰۰	۳۹,۶۷۵	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۱,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱,۵۶۰)	(۵۰,۴۸۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۵۰,۴۸۲)	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۴,۸۸۶,۱۳۰,۳۶۱	.	۱۴,۷۱۵,۵۳۰,۸۷۲	.	سود خالص دوره
(۱,۹۲۸,۸۰۵,۸۴۰)	.	(۱,۸۳۵,۳۷۳,۲۵۳)	.	تعدیلات
۷۵,۳۳۲,۵۹۸,۶۳۲	۱۱۷,۸۵۸	۸۹,۵۷۲,۵۷۸,۲۱۱	۷۳,۱۸۸	خالص دارایی‌ها(واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

### گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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 ۱۲۲/۱۲۰۳۵۸ در ۱۴۰۱/۱۱/۰۵ سازمان بورس و اوراق بهادار دوره فعالیت تا تاریخ ۱۴۰۶/۱۰/۱۰ می‌باشد. مرکز اصلی صندوق در تهران به نشانی شهید بهشتی، کوچه نادر، خیابان ولیعصر، پلاک ۲۱۱۳، 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](http://www.hooshmandfund.ir) درج گردیده است.

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

### گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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	۱۷۳۲۵	٪ ۹۹
۲	کارگزاری آبان	۱۷۵	٪ ۱
	جمع	۱۷،۵۰۰	٪ ۱۰۰

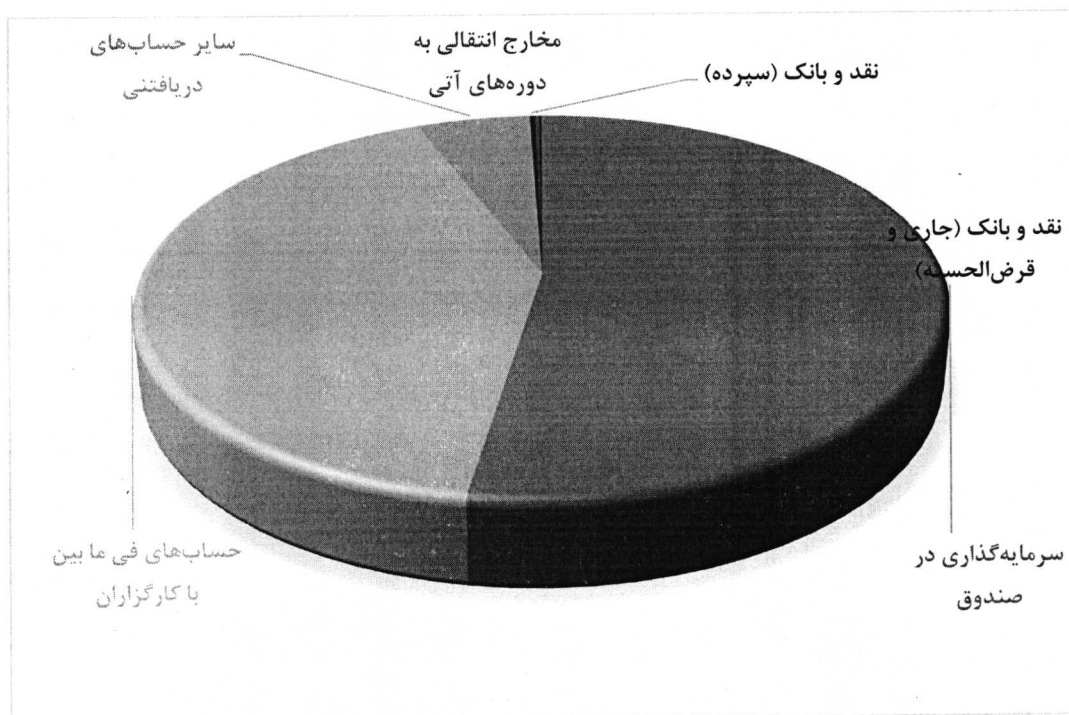
مدیر صندوق: شرکت سبذگردان آبان است که در تاریخ ۱۳۹۷/۰۳/۱۹ با شماره ثبت ۵۲۷۰۹۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران محله آرژانتین-ساعی، خیابان شهید خالد اسلامبولی، خیابان شهید مسعود احمدیان (پانزدهم) پلاک ۲۴، ساختمان نیکان، طبقه ششم واحد ۶۰۱. متولی صندوق: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

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

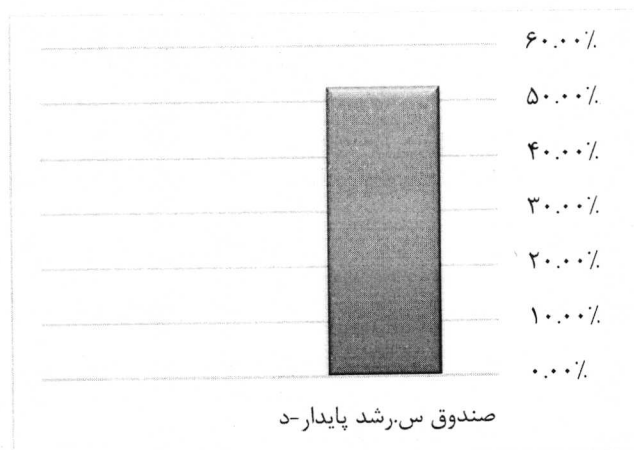
### گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

### ترکیب دارایی‌ها



### سهام براساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۱,۰۳۷,۶۷۵	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۰۱
۱,۲۲۳,۹۵۲	NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹
۸۹,۵۷۲,۵۷۸,۲۱۱	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹
۷۳,۱۸۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹
۳۹,۶۷۵	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
(۵۰,۴۸۲)	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۱۶,۳۴٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی
۱۶,۴۳٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال / دوره مالی

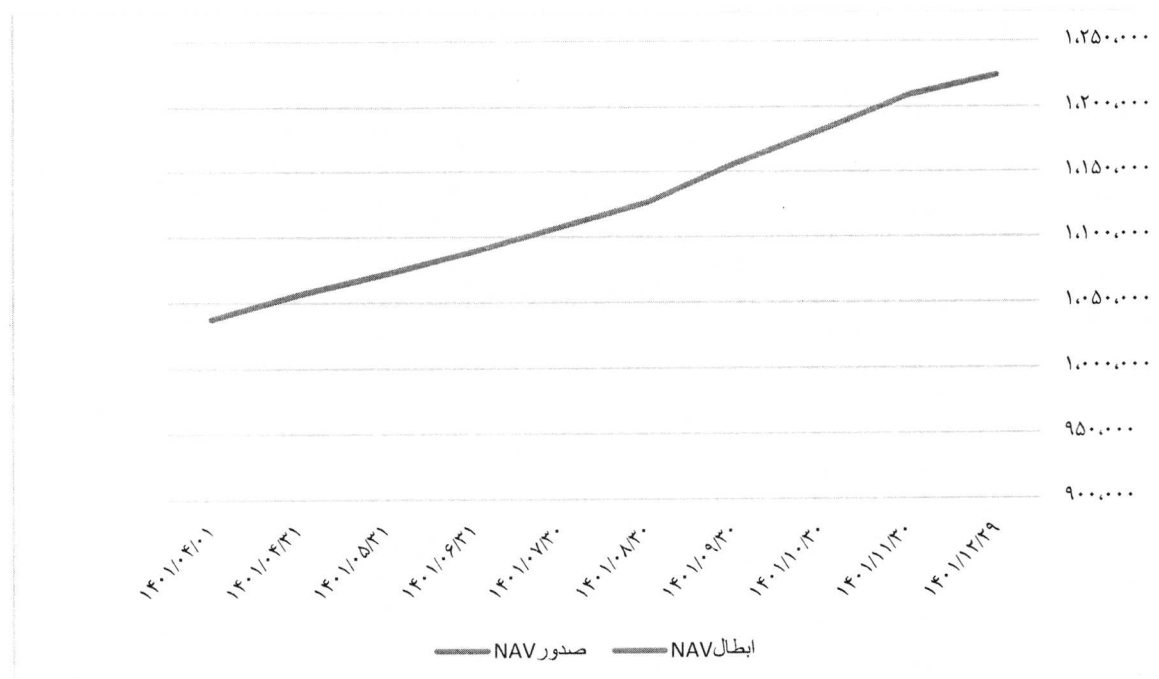


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

**نمودار NAV صندوق رشد پایدار**



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

• صندوق رشد پایدار:

