

---

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

---



## گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳ 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                            |

با سپاس

امضاء  
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی  
بازارگردانی هوشمند آبان

نماینده

الهام مرادی

شخص حقوقی

شرکت سبدگردان آبان

ارکان صندوق

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

| ۱۴۰۲/۰۳/۳۱             | ۱۴۰۳/۰۳/۳۱               |                                             |
|------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|
| ریال                   | ریال                     |                                             |
|                        |                          | <b>دارایی‌ها:</b>                           |
| ۰                      | ۱,۱۹۵,۶۶۷,۲۰۹,۹۲۷        | سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام         |
| ۹۴,۴۰۵,۰۸۹,۸۷۶         | ۴۰۵,۷۷۳,۹۳۵,۶۰۵          | سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری      |
| ۰                      | ۰                        | سرمایه‌گذاری در اوراق بدهی                  |
| ۲۲,۴۱۱,۹۷۲             | ۱۴۴,۳۹۱,۳۱۸,۸۰۲          | سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی   |
| ۶,۸۰۵,۱۱۴,۱۱۲          | ۱۳,۹۰۰,۱۶۱,۳۴۰           | حساب‌های دریافتی                            |
| ۶۰۴,۱۱۰,۸۱۱            | ۴۶۷,۶۸۰,۶۷۷              | سایر دارایی‌ها                              |
| ۹۲,۴۱۰,۸۳۰             | ۹۹,۹۵۰,۷۳۱               | موجودی نقد                                  |
| ۰                      | ۱۴۱,۵۲۵,۰۱۰              | جاری کارگزاران                              |
| <u>۱۰۱,۹۲۹,۱۳۷,۶۰۱</u> | <u>۱,۷۶۰,۴۴۱,۷۸۲,۰۹۲</u> | <b>جمع دارایی‌ها</b>                        |
|                        |                          | <b>بدهی‌ها:</b>                             |
| ۴,۱۰۰,۰۹۶,۷۷۲          | ۰                        | جاری کارگزاران                              |
| ۷۶۱,۴۰۴,۲۸۳            | ۴,۳۶۰,۲۹۵,۷۹۴            | پرداختی به ارکان صندوق                      |
| ۰                      | ۰                        | پرداختی به سرمایه‌گذاران                    |
| ۰                      | ۰                        | تسهیلات مالی دریافتی                        |
| ۱,۶۴۵,۰۹۰,۶۴۱          | ۴,۲۵۴,۸۹۹,۸۹۷            | سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر               |
| <u>۶,۵۰۶,۵۹۱,۶۹۶</u>   | <u>۸,۶۱۵,۱۹۵,۶۹۱</u>     | <b>جمع بدهی‌ها</b>                          |
| <u>۹۵,۴۲۲,۵۴۵,۹۰۵</u>  | <u>۱,۷۵۱,۸۲۶,۵۸۶,۴۰۱</u> | <b>خالص دارایی‌ها</b>                       |
| <u>۱,۳۰۳,۸۰۰</u>       | <u>۱,۳۹۶,۳۶۵</u>         | <b>خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری</b> |



**صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان**

**گزارش عملکرد**

**سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳**

| سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ | سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ | درآمدها:                                     |
|------------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|
| ریال                         | ریال                         | سود (زیان) فروش اوراق بهادار                 |
| (۱.۹۰۱.۳۹۴.۵۳۵)              | ۱۱.۹۴۵.۹۲۵.۰۴۶               | سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار         |
| ۴۱۳.۴۱۳.۸۳۲                  | ۳۷۶.۳۳۷.۰۰۷.۹۹۰              | سود تقسیمی صندوق های سرمایه‌گذاری            |
| ۱۷.۰۷۳.۴۸۶.۰۵۳               | ۱۴.۱۲۱.۷۹۴.۰۱۱               | سود سهام                                     |
| ۳۷.۸۹۷.۱۲۱                   | ۷۱.۲۰۵.۱۹۲.۰۰۰               | سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب |
| ۹.۰۹۴.۲۹۰.۲۶۷                | ۱۱.۲۷۴.۶۵۶.۳۰۴               | درآمد حاصل از بازارگردانی                    |
| ۲۴.۷۱۷.۶۹۲.۷۳۸               | ۵۱۳.۸۷۲.۶۸۰.۵۵۶              | جمع درآمدها                                  |
|                              |                              | هزینه‌ها:                                    |
| (۱.۳۹۸.۵۷۲.۴۹۲)              | (۷.۴۳۴.۲۴۷.۲۳۶)              | هزینه کارمزد ارکان                           |
| (۲.۶۲۸.۴۹۳.۴۵۴)              | (۴.۶۱۶.۰۸۳.۱۴۲)              | سایر هزینه‌ها                                |
| (۴.۰۲۷.۰۶۵.۹۴۶)              | (۱۲.۰۵۰.۳۳۰.۳۷۸)             | جمع هزینه‌ها                                 |
| (۱۲۵.۱۲۸.۲۲۶)                | (۲۷.۳۲۳.۲۹۶)                 | هزینه های مالی                               |
| ۲۰.۵۶۵.۴۹۸.۵۶۶               | ۵۰۱.۷۹۵.۰۲۶.۸۸۲              | سود خالص                                     |
| ۲۲,۶۶%                       | ۴۴,۷۰%                       | بازده میانگین سرمایه‌گذاری (۱)               |
| ۲۱,۵۶%                       | ۲۸,۷۵%                       | بازده سرمایه‌گذاری پایان سال (۲)             |

| سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ |                            | سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ |                            |                                                  |
|------------------------------|----------------------------|------------------------------|----------------------------|--------------------------------------------------|
| ریال                         | تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری | ریال                         | تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری |                                                  |
| ۸۷.۴۹۹.۴۲۰.۵۹۲               | ۸۳.۹۹۵                     | ۹۵.۴۲۲.۵۴۵.۹۰۵               | ۷۳.۱۸۸                     | خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای سال |
| ۳۹.۶۷۵.۰۰۰.۰۰۰               | ۳۹.۶۷۵                     | ۱.۱۸۱.۳۷۴.۰۰۰.۰۰۰            | ۱.۱۸۱.۳۷۴                  | واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی سال             |
| (۵۰.۴۸۲.۰۰۰.۰۰۰)             | (۵۰.۴۸۲)                   | .                            | .                          | واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی سال            |
| ۱۴.۷۱۵.۵۳۰.۸۷۲               | .                          | ۵۰۱.۷۹۵.۰۲۶.۸۸۲              | .                          | سود خالص                                         |
| (۱.۸۳۵.۳۷۳.۲۵۳)              | .                          | (۲۶.۷۶۴.۹۸۶.۳۸۶)             | .                          | تعدیلات                                          |
| ۸۹.۵۷۲.۵۷۸.۲۱۱               | ۷۳.۱۸۸                     | ۱.۷۵۱.۸۲۶.۵۸۶.۴۰۱            | ۱,۲۵۴,۵۶۲                  | خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان سال  |

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

### گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

#### 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 کوبین 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](http://www.hooshmandfund.ir) درج گردیده است.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

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 آبخناسان، سردار جنگل شمالی، خیابان پنج تن، خیابان شهید نوروزپور (نشاط)، نبش کوچه سوم غربی، شماره ۲۴.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

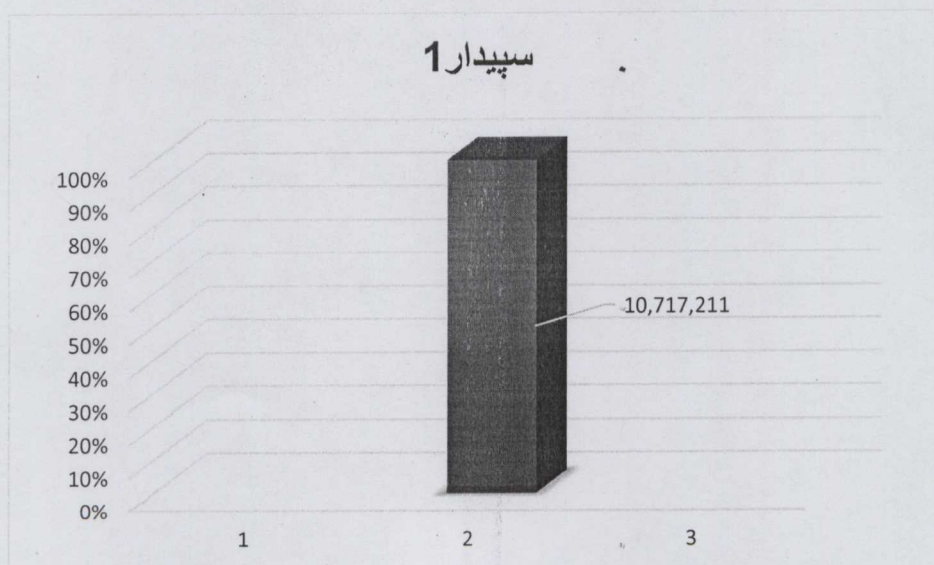
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

ترکیب دارایی



سهام براساس ناشر





صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

جدول فعالیت صندوق

| فعالیت‌های صندوق  |                                                                     |
|-------------------|---------------------------------------------------------------------|
| ۱.۳۰۳.۷۲۸         | NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۰۱                                        |
| ۱.۳۹۷.۸۸۱         | NAV صدور در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱                                        |
| ۱.۷۵۱.۸۲۶.۵۸۶.۴۰۱ | کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱                          |
| ۱.۲۵۴.۵۶۲         | تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ |
| ۱.۱۸۱.۳۷۴         | تعداد کل واحدهای صادر شده طی سال مالی                               |
|                   | تعداد کل واحدهای باطل شده طی سال مالی                               |
| ۴۴,۷۰٪            | بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال مالی                           |
| ۲۸,۷۵٪            | بازده سرمایه‌گذاری پایان سال مالی                                   |

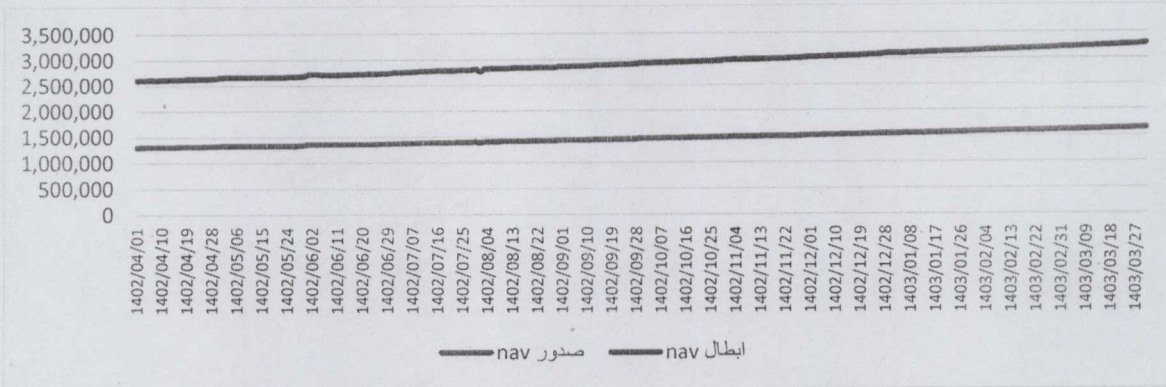


## سندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

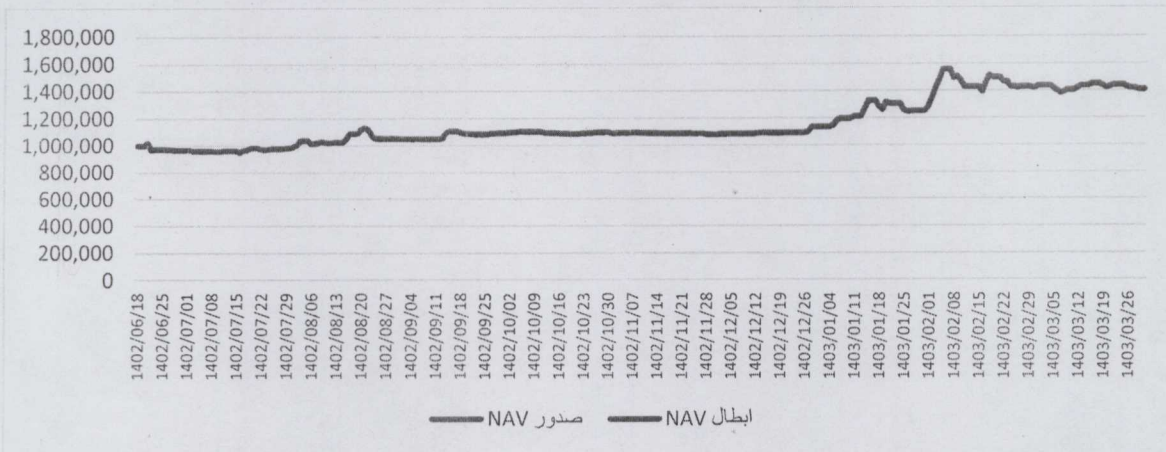
### گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

### نمودار NAV رشد:



### نمودار NAV سپیدارا:



### نمودار NAV پتروآبان:

