
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۲۹ 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
۴-۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۷	• جدول فعالیت صندوق
۷	• نمودار NAV

با سپاس

امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمانداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

۱۳۹۷/۱۲/۲۹

ریال

دارایی‌ها:

۰	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۹,۷۳۰,۲۶۰,۶۶۵	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۸,۸۰۵,۳۰۲,۵۵۲	حساب‌های دریافتی
۰	جاری کارگزاران
۰	موجودی نقد
۴۱,۶۸۸,۷۸۴	سایر دارایی‌ها
۱۸,۵۷۷,۲۵۲,۰۰۱	جمع دارایی‌ها

بدهی‌ها:

۱۶,۹۲۷,۷۳۵	پرداختنی به ارکان
۵۱,۶۲۵,۶۹۷	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۶۸,۵۵۳,۴۳۲	جمع بدهی‌ها
۱۸,۵۰۸,۶۹۸,۵۶۹	خالص دارایی‌ها:
۱,۰۵۷,۶۴۰	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی ۱ ماه ۲۱ و روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

دوره مالی ۱ ماه ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷		
ریال		درآمدها:
.		سود فروش اوراق بهادار
.		زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.		سود سهام
۱,۰۳۵,۵۶۹,۶۱۷		سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
.		سایر درآمدها
۱,۰۳۵,۵۶۹,۶۱۷		جمع درآمدها
(۱۶,۹۲۷,۷۳۵)		هزینه کارمزد ارکان
(۹,۹۴۳,۳۱۳)		سایر هزینه‌ها
(۲۶,۸۷۱,۰۴۸)		جمع هزینه‌ها
۱,۰۰۸,۶۹۸,۵۶۹		سود خالص
۵۱,۰۶٪		میانگین سرمایه‌گذاری دوره ۱
۵,۴۵٪		سرمایه‌گذاری پایان دوره ۲

صورت گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی ۱ ماه ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷		
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
.	.	خالص دارایی‌های ابتدای دوره
۱۷,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۵۰۰	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
.	.	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
.	.	تقسیم سود
۱,۰۰۸,۶۹۸,۵۶۹	.	سود (زیان) خالص دوره
.	.	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۱۸,۵۰۸,۶۹۸,۵۶۹	۱۷,۵۰۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

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 ۱۲۲/۴۵۹۰۱ سازمان بورس و اوراق بهادار دوره فعالیت تا تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۰۷ می‌باشد. مرکز اصلی صندوق در تهران به نشانی خیابان ولیعصر، بالاتر از سه راه شهید بهشتی، 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.

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 می‌یابد.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ماه و ۲۱روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

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	آقای محمد صنعتی	۱۲,۵۰۰	۷۱,۴
۲	سبدرگان آبان	۳,۰۰۰	۱۷,۲
۳	کارگزاری آبان	۲,۰۰۰	۱۱,۴
	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، خیابان ولیعصر، بالاتر از سه راه شهید بهشتی، پلاک ۲۱۱۳.

متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری آرمان آتی (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۷۵/۰۶/۰۸ با شماره ثبت ۳۹۷۶۳۲ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از خیابان ولی عصر، بالاتر از بهشتی، برج سرو ساعی، طبقه ۱۷، واحد ۱۷۰۵.

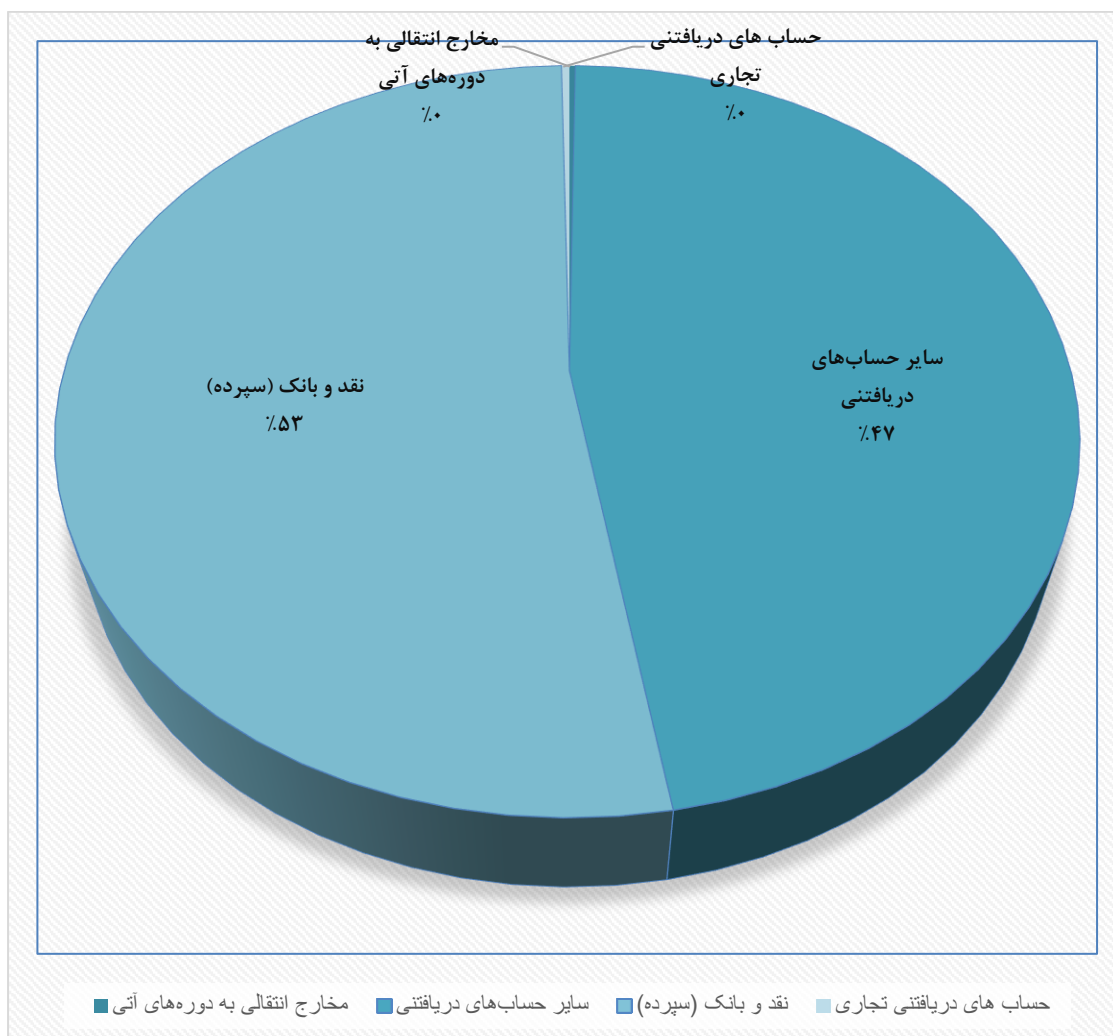
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از خیابان توحید نبش خیابان پرچم پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ماه و ۲۱روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

ترکیب دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۱ ماه و ۲۱ روز منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۷

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
NAV صدور در تاریخ ۹۷/۱۱/۰۸	۱,۰۵۴,۱۵۲
NAV صدور در تاریخ ۹۷/۱۲/۲۹	۱,۰۵۷,۶۴۰
کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۷/۱۲/۲۹	۱۸,۵۰۸,۶۹۸,۵۶۹
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۷/۱۲/۲۹	۱۷,۵۰۰
تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره	۱۷,۵۰۰
تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره	۰
بازده میانگین سرمایه‌گذاری	۵۱,۰۶٪
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی	۵,۴۵٪

نمودار NAV

