
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
مربوط به دوره مالی نه ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

مربوط به دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۷ 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
۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۶	• ترکیب صنعت
۷	• جدول فعالیت صندوق
۸	• نمودار NAV
۹	• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

با سپاس

امضاء

نماینده

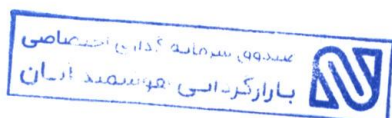
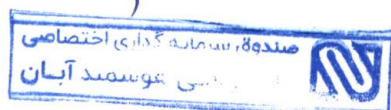
بابک حقیقی مهران‌داری

شخص حقوقی

ارکان صندوق

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

۱۳۹۸/۰۳/۳۱	۱۳۹۸/۱۲/۲۹	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۷۰,۲۰۳,۶۲۱,۲۴۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	۴۴,۶۱۲,۷۸۱,۸۹۵	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۶۷,۱۰۵,۷۲۲	۲۴۰,۷۷۷,۴۰۳	حساب‌های دریافتنی
۲۲۸,۷۳۹,۳۲۹	۸۸,۲۵۹,۷۲۱	سایر دارایی‌ها
۱,۹۱۶,۲۷۳,۵۶۲	۱۳,۹۶۸,۶۵۴,۸۱۶	جاری کارگزاران
۳۸,۰۶۹,۵۱۵,۹۵۹	۱۲۹,۱۱۴,۰۹۵,۰۷۹	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶	۸۳۲,۵۳۸,۰۶۷	بدهی به ارکان صندوق
۱۰۱,۳۹۷,۷۴۱	۴۳۰,۰۷۳,۰۱۸	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۲۲۷,۷۳۸,۲۲۷	۱,۲۶۲,۶۱۱,۰۸۵	جمع بدهی‌ها
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۱۲۷,۸۵۱,۴۸۳,۹۹۴	خالص دارایی‌ها:
۱,۳۱۸,۹۴۷	۲,۶۵۵,۲۲۰	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰	دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹	
ریال	ریال	ریال	
			درآمدها:
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸	۴۸,۸۹۹,۰۶۲,۲۹۷	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	۱۲,۴۲۴,۱۴۲,۶۰۱	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	سود سهام
۱,۵۵۰,۰۲۱۲,۸۰۹	۱,۱۴۵,۸۶۹,۲۴۰	۲,۲۸۶,۸۴۰,۵۷۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
.	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	سایر درآمدها
۸,۰۵۷,۵۴۹,۳۶۷	۲۲,۱۹۱,۶۸۳,۳۳۶	۶۴,۳۲۸,۶۴۱,۱۶۴	جمع درآمدها
(۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶)	(۴۹۲,۷۳۵,۱۱۶)	(۸۲۹,۹۸۲,۳۲۸)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۱۰,۱۷۴,۴۱۲)	(۲۷۷,۷۳۳,۳۹۶)	(۴۳۸,۷۱۴,۳۰۹)	سایر هزینه‌ها
(۲۸۶,۵۱۴,۸۹۸)	(۷۷۰,۴۶۸,۵۱۲)	(۱,۲۶۸,۶۹۶,۶۳۷)	جمع هزینه‌ها
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	۶۳,۰۵۹,۹۴۴,۵۲۷	سود خالص

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰	دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹	
ریال	ریال	ریال	
تعداد واحدها	تعداد واحدها	تعداد واحدها	
.	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	خالص دارایی‌های ابتدای دوره
۲۸,۶۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۱۲۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۹,۴۸۹,۰۰۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	۶۳,۰۵۹,۹۴۴,۵۲۷	سود خالص دوره
۱,۳۶۷,۷۴۳,۲۶۳	۱,۸۷۲,۹۴۹,۴۹۷	۷,۵۱۰,۷۶۱,۷۳۵	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۷۳,۲۱۲,۹۴۲,۰۵۳	۱۲۷,۸۵۱,۴۸۳,۹۹۴	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

- 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 می‌باید.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

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	سیدگردان 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 ۱۳۸۹/۱۲/۰۴ 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.

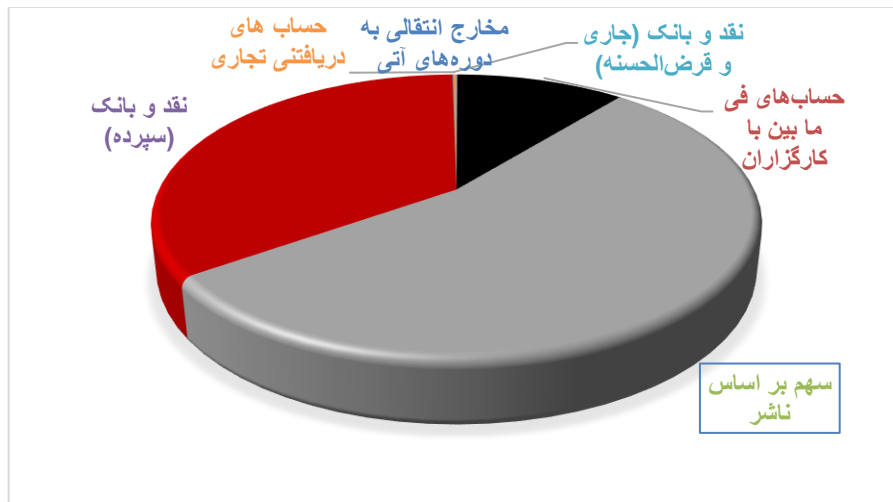
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از خیابان توحید نبش خیابان پرچم پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

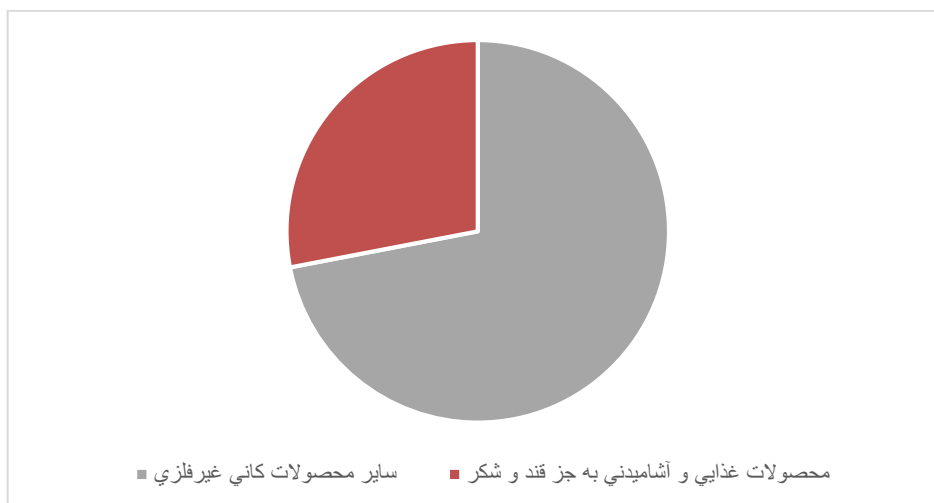
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

ترکیب دارایی‌ها



سهام بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۱,۳۱۳,۵۸۸	NAV صدور در تاریخ ۹۷/۰۴/۰۱
۲,۶۶۷,۳۵۹	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۱۲/۲۹
۱۲۷,۸۵۱,۴۸۳,۹۹۴	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۸/۱۲/۲۹
۴۸,۱۴۲	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۸/۱۲/۲۹
۱۹,۴۸۹	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۹۳,۳۷	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۴۹,۴۶	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

نمودار NAV



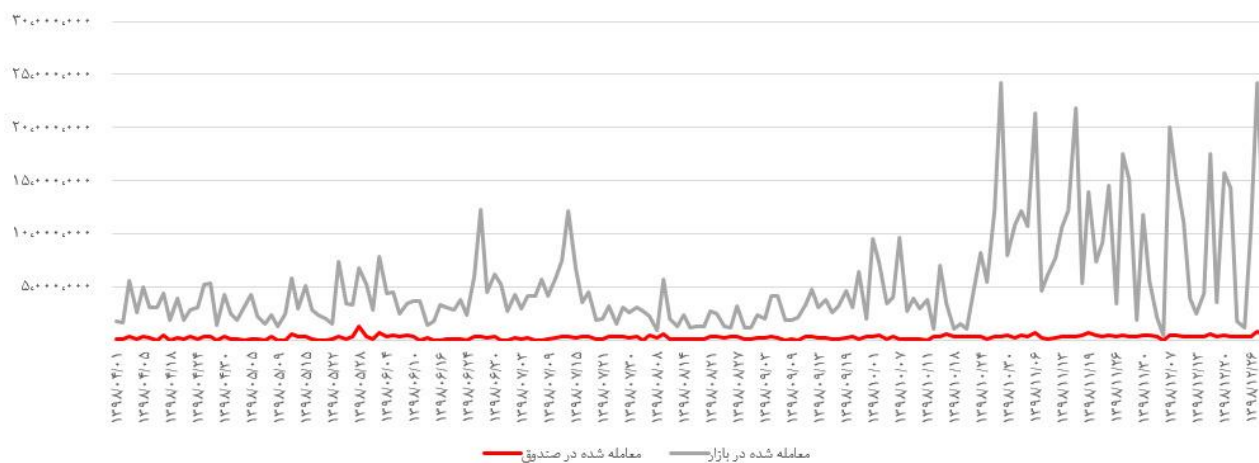
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

- کارخانجات تولیدی شیشه رازی:



- نیلی صنعت کرمان:

