
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
مربوط به سال مالی منتهی به تاریخ ۳۱ خرداد ۱۳۹۹

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به سال مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۳/۳۱ 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
۸-۹	• نمودار NAV
۱۰-۱۱	• مقایسه حجم معاملات بازار و صندوق

با سپاس

امضاء

نماینده

بابک حقیقی مهمانداری



ارکان صندوق

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۳۱ خرداد ۱۳۹۹

۱۳۹۸/۰۳/۳۱	۱۳۹۹/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۵۳,۰۷۰,۶۶۴,۳۶۳	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	۱۳۶,۷۴۰,۴۶۸,۴۶۴	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۶۷,۱۰۵,۷۲۲	۱۵۶,۰۰۸,۰۹۰	حساب‌های دریافتی
۱,۹۱۶,۲۷۳,۵۶۲	۱۸,۰۶۶,۸۹۷,۷۱۸	جاری کارگزاران
۲۲۸,۷۳۹,۳۲۹	۲۱۰,۶۳۴,۰۷۴	سایر دارایی‌ها
۳۸,۰۶۹,۵۱۵,۹۵۹	۲۰۸,۲۴۴,۶۷۲,۷۰۹	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶	۱,۲۴۵,۹۵۵,۵۳۱	بدهی به ارکان صندوق
.	۸۱,۸۹۴	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۱۰۱,۳۹۷,۷۴۱	۵۸۸,۸۴۷,۲۹۶	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۲۲۷,۷۳۸,۲۲۷	۱,۸۳۴,۸۸۴,۷۲۱	جمع بدهی‌ها
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	خالص دارایی‌ها:
۱,۳۱۸,۹۴۷	۱,۷۶۰,۰۷۹	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

برای سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	درآمدها:
۲۰,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۸۱,۷۱۲,۱۸۷,۴۹۰	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۸,۳۱۹,۳۵۱,۵۹۹	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۰	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	سود سهام
۱,۵۵۰,۲۱۲,۸۰۹	۳,۱۲۷,۶۴۹,۴۵۵	سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب
۰	۱۰۳,۰۱۰	سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۸,۰۵۷,۵۴۹,۳۶۷	۹۳,۸۷۷,۷۸۴,۲۳۴	جمع درآمدها
		هزینه ها :
(۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶)	(۱,۳۷۵,۸۱۷,۳۴۶)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۱۰,۱۷۴,۴۱۲)	(۶۱۹,۳۹۴,۷۹۳)	سایر هزینه‌ها
(۲۸۶,۵۱۴,۸۹۸)	(۱,۹۹۵,۱۱۲,۱۳۹)	جمع هزینه ها
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	سود خالص
۲۸,۷۹٪	۹۳,۳۷٪	یازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال (۱)
۲۰,۷۳٪	۴۹,۴۶٪	یازده سرمایه‌گذاری پایان سال (۲)

صورت گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	تعداد واحدها
۰	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳
۲۸,۶۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۹۴,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴,۹۰۰
۰	(۶,۳۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۶,۳۸۰)
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	۰
۱,۳۶۷,۷۴۳,۲۶۳	(۱۱,۹۸۶,۶۶۱,۸۳۹)	۰
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

- 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 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 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

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

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، شهید بهشتی، کوچه نادر، خیابان ولیعصر، 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.

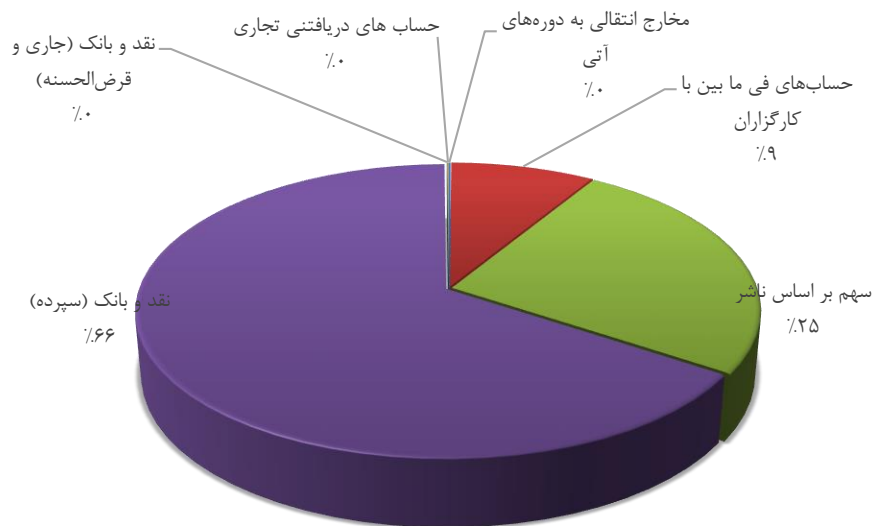
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از میدان توحید، خیابان توحید پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

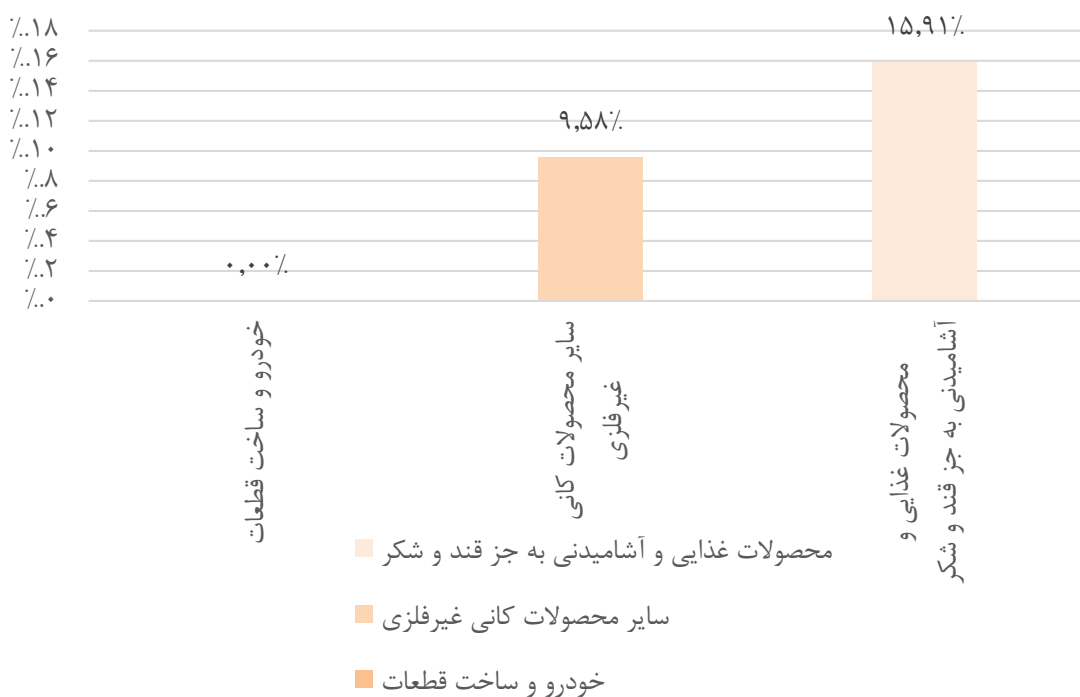
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

ترکیب دارایی‌ها



سهم براساس ناشر



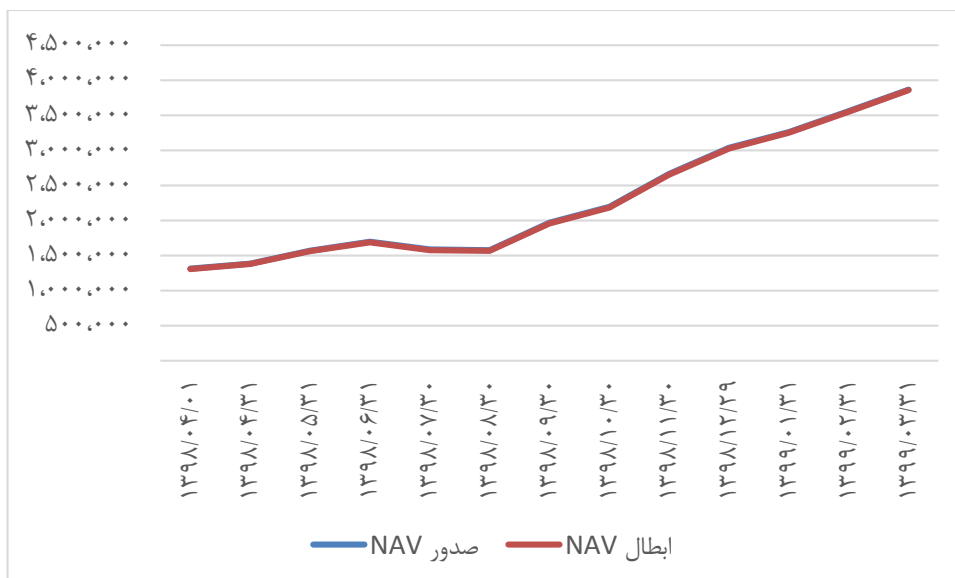
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

جدول فعالیت صندوق

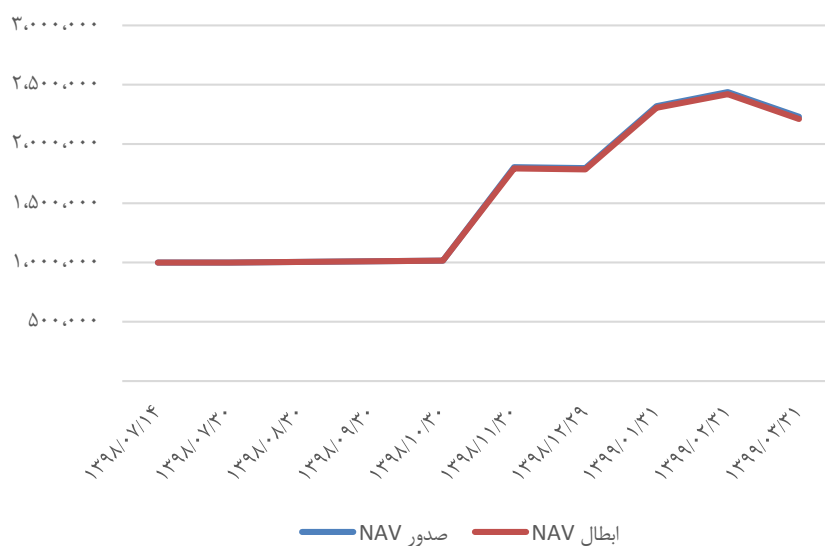
فعالیت‌های صندوق	
۱.۳۱۳.۵۸۸	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۰۴/۰۱
۱.۷۶۳.۶۸۹	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۳/۳۱
۲۰۶.۴۰۹.۷۸۷.۹۸۸	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۹/۰۳/۳۱
۱۱۷.۲۷۳	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۹/۰۳/۳۱
۹۴.۹۰۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
(۶.۲۸۰)	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۹۳,۳۷٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۴۹,۴۶٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV کارخانجات تولیدی شیشه رازی



نمودار NAV نیلی صنعت کرمان

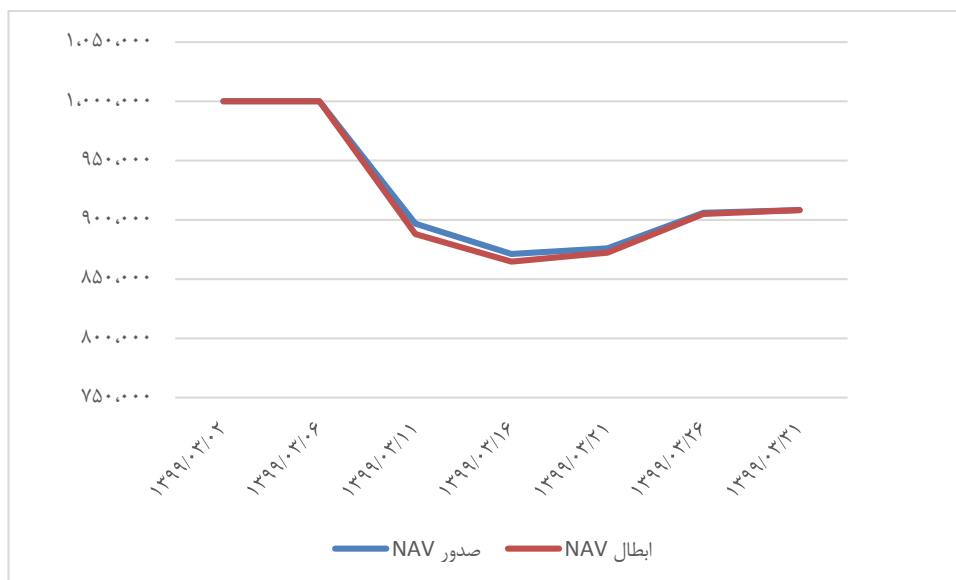


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV سهم سایپا دیزل



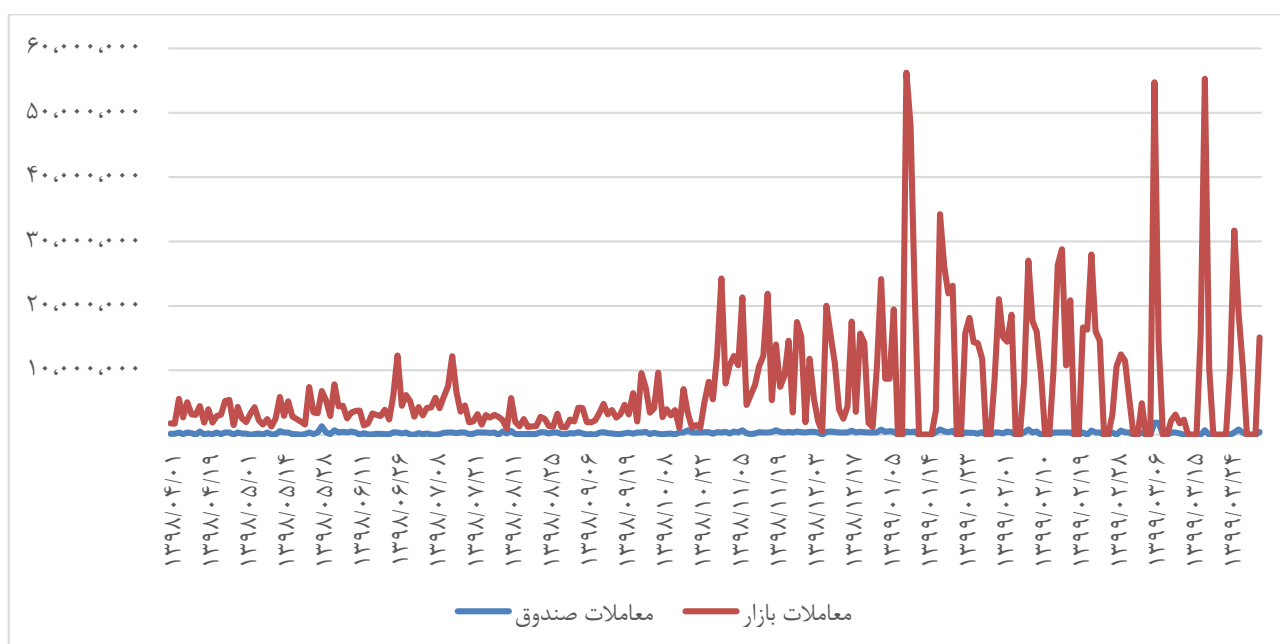
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

- کارخانجات تولیدی شیشه رازی:

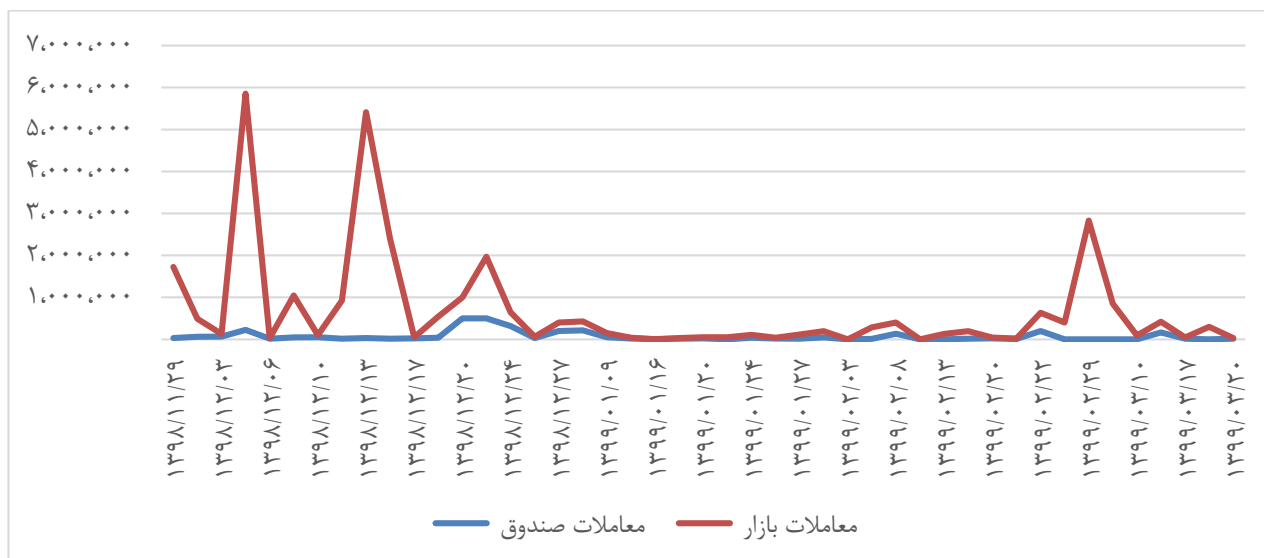


- نیلی صنعت کرمان:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۳۹۹



• سایپا دیزل :

