
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش‌های میان دوره ای عملکرد
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی نه ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ 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

شخص حقوقی

شرکت کارگزاری آبان

ارکان صندوق

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت خالص دارایی‌ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

۱۳۹۹/۰۳/۳۱	۱۳۹۹/۱۲/۳۰	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۵۳,۰۷۰,۶۶۴,۳۶۳	۸۸,۵۳۳,۶۱۱,۶۵۶	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳۶,۶۴۰,۵۲۸,۴۶۴	۶۰,۳۷۰,۰۴۰,۲۹۶	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۵۶,۰۰۸,۰۹۰	۳,۷۰۷,۵۳۰	حساب‌های دریافتی
۱۸,۰۶۶,۸۹۷,۷۱۸	.	جاری کارگزاران
۲۱۱,۴۳۹,۲۰۱	۳۲,۹۰۸,۷۳۳	سایر دارایی‌ها
۹۹,۹۴۰,۰۰۰	۹۸,۸۷۴,۰۶۱	موجودی نقد
۲۰۸,۲۴۵,۴۷۷,۸۳۶	۱۴۹,۰۳۹,۱۴۲,۲۷۶	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
.	۳۹,۳۶۹,۱۲۱,۰۲۵	جاری کارگزاران
۱,۲۴۵,۹۵۵,۵۳۱	۹۰۶,۴۷۳,۴۷۱	بدهی به ارکان صندوق
۸۱,۸۹۴	.	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۵۸۹,۶۵۲,۴۲۳	۷۰۷,۵۶۶,۳۰۶	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۱,۸۳۵,۶۸۹,۸۴۸	۴۰,۹۸۳,۱۶۰,۸۰۲	جمع بدهی‌ها
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۰۸,۰۵۵,۹۸۱,۴۷۴	خالص دارایی‌ها:
۱,۷۶۰,۰۷۹	۸۶۶,۶۶۷	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش مالی میان دوره ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

درآمدها:	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹	سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱
	ریال	ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	(۵۱,۰۷۴,۹۴۸,۹۰۶)	۴۸,۸۹۹,۰۶۲,۲۹۷	۸۱,۷۱۲,۱۸۷,۴۹۰
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۲۶,۴۸۳,۷۱۷,۵۴۷)	۱۲,۴۲۴,۱۴۲,۶۰۱	۸,۳۱۹,۳۵۱,۵۹۹
سود سهام	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۳,۶۲۶,۷۱۵,۲۶۹	۲,۲۸۶,۸۴۰,۵۷۶	۳,۱۲۷,۶۴۹,۴۵۵
سایر درآمدها	۸۵۰,۶۶۹	۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰
جمع درآمدها (زیان‌ها)	(۷۳,۶۰۸,۰۸۸,۹۱۵)	۶۴,۳۲۸,۶۴۱,۱۶۴	۹۳,۸۷۷,۷۸۴,۲۳۴
هزینه ها :			
هزینه کارمزد ارکان	(۲,۲۳۶,۷۱۶,۶۴۵)	(۸۲۹,۹۸۲,۳۲۸)	(۱,۲۷۵,۸۱۷,۳۴۶)
سایر هزینه‌ها	(۵۸۲,۶۹۹,۳۸۱)	(۴۳۸,۷۱۴,۳۰۹)	(۶۱۹,۲۹۴,۷۹۳)
جمع هزینه ها	(۲,۸۱۹,۴۱۶,۰۲۶)	(۱,۲۶۸,۶۹۶,۶۳۷)	(۱,۸۹۵,۱۱۲,۱۳۹)
سود (زیان) خالص	(۷۶,۴۲۷,۵۰۴,۹۴۱)	۶۳,۰۵۹,۹۴۴,۵۲۷	۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵
بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره / سال (۱)	۴۳.۷۰٪-	۹۳.۳۷٪	۱۰۰.۸۷٪
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره / سال (۲)	۷۰.۶۳٪-	۴۹.۴۶٪	۴۹.۹۳٪

صورت گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰		دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹		سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱	
تعداد واحدها	ریال	تعداد واحدها	ریال	تعداد واحدها	ریال
۱۱۷,۲۷۳	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۲۸,۶۵۳	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲
۱۷,۴۰۷	۱۷,۴۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۹,۴۸۹	۱۹,۴۸۹,۰۰۰,۰۰۰	۹۴,۹۰۰	۹۴,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰
(۱۰,۰۰۰)	(۱۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	۰	۰	(۶,۲۸۰)	(۶,۲۸۰,۰۰۰,۰۰۰)
۰	(۷۶,۴۲۷,۵۰۴,۹۴۱)	۰	۶۳,۰۵۹,۹۴۴,۵۲۷	۰	۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵
۰	(۲۹,۳۳۳,۳۰۱,۵۷۳)	۰	۷,۵۱۰,۷۶۱,۷۳۵	۰	(۱۱,۹۸۴,۶۶۱,۸۳۹)
۱۲۴,۶۸۰	۱۰۸,۰۵۵,۹۸۱,۴۷۴	۴۸,۱۴۲	۱۲۷,۸۵۱,۴۸۳,۹۹۴	۱۱۷,۲۷۳	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸

خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای دوره

واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره

واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره

سود خالص دوره

تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال

خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند 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.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

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	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 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 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 اول.

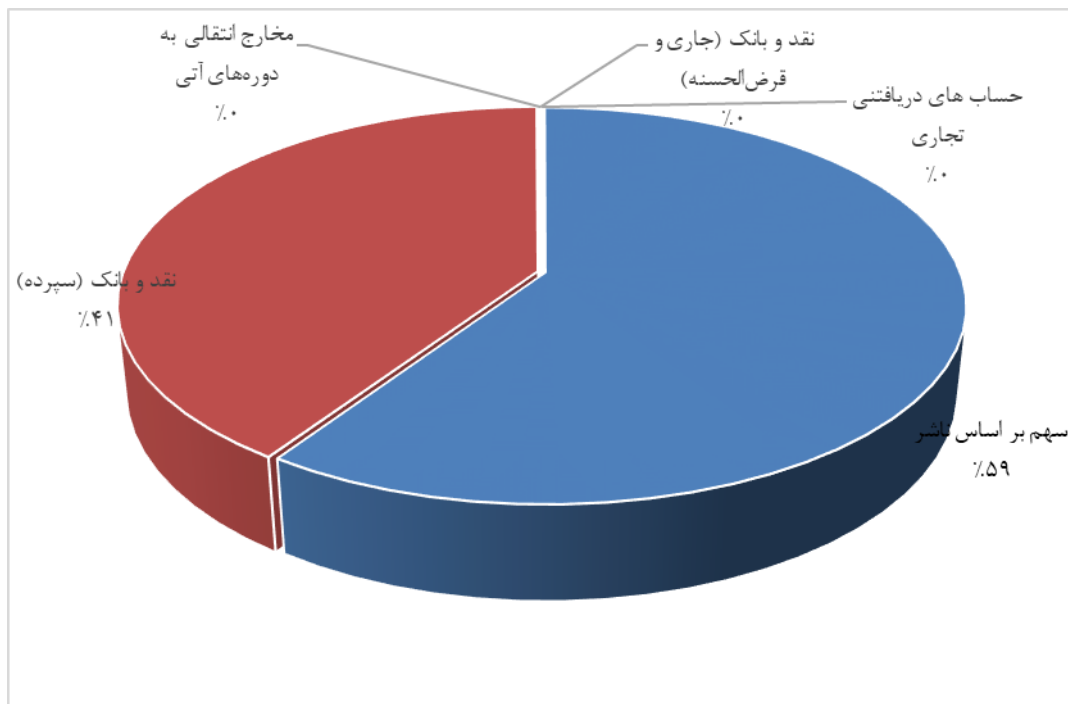
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

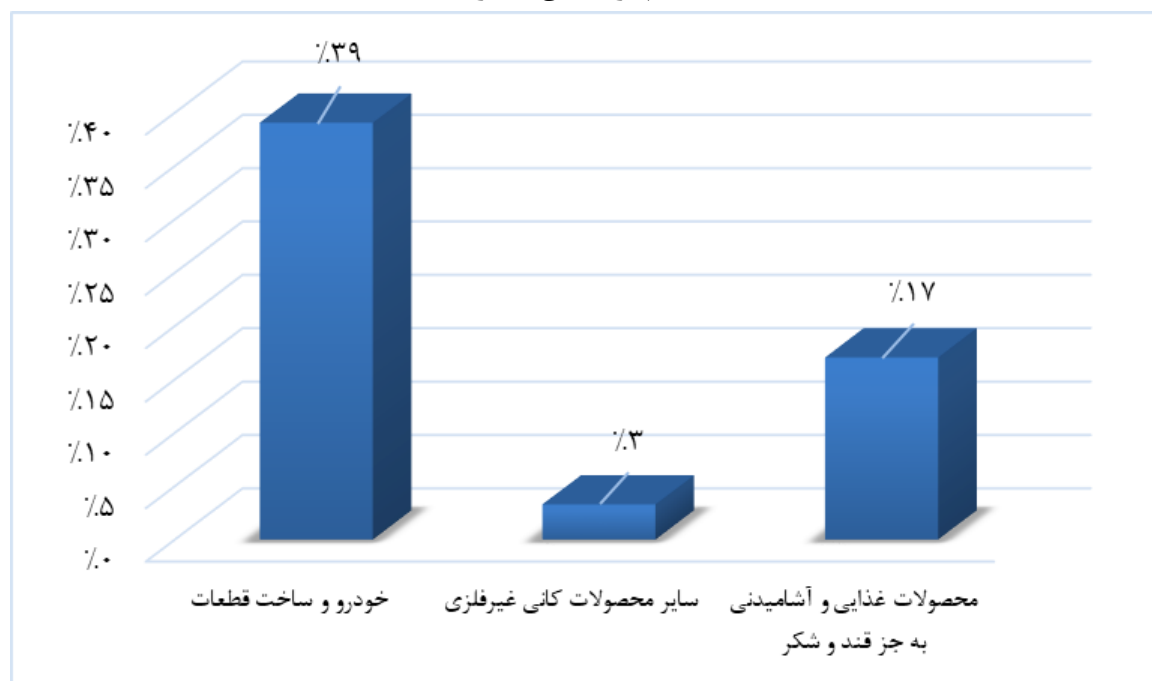
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

ترکیب دارایی‌ها



سهم بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۴/۰۱	۱,۷۶۳,۷۷۱
NAV صدور در تاریخ ۹۹/۱۲/۳۰	۸۶۷,۷۲۳
کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۹/۱۲/۳۰	۱۰۸,۰۵۵,۹۸۱,۴۷۴
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۹/۱۲/۳۰	۱۲۴,۶۸۰
تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره	۱۷,۴۰۷
تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره	۱۰,۰۰۰
بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره/ سال مالی	(۴۳,۷۰)٪
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/ سال مالی	(۷۰,۶۲)٪

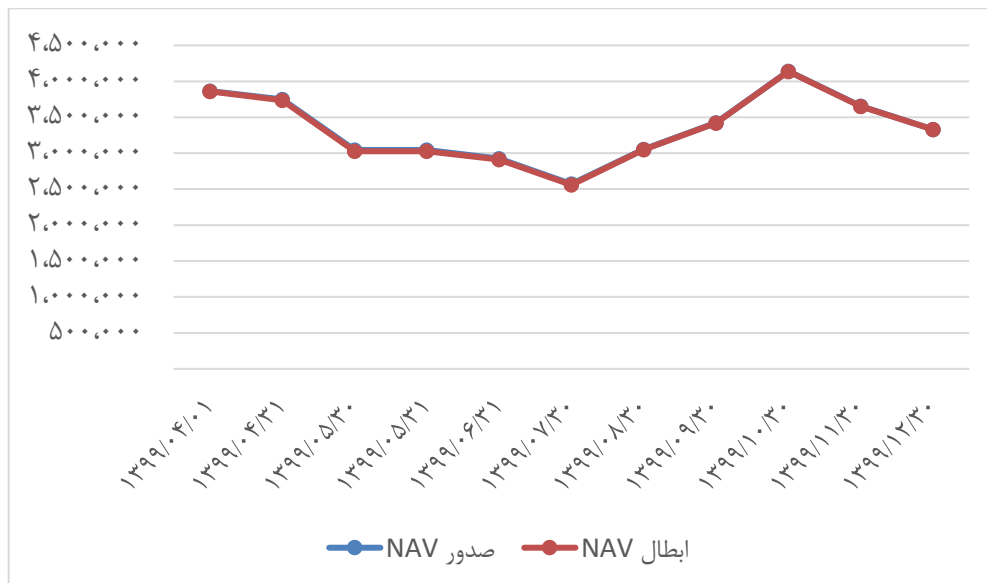
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

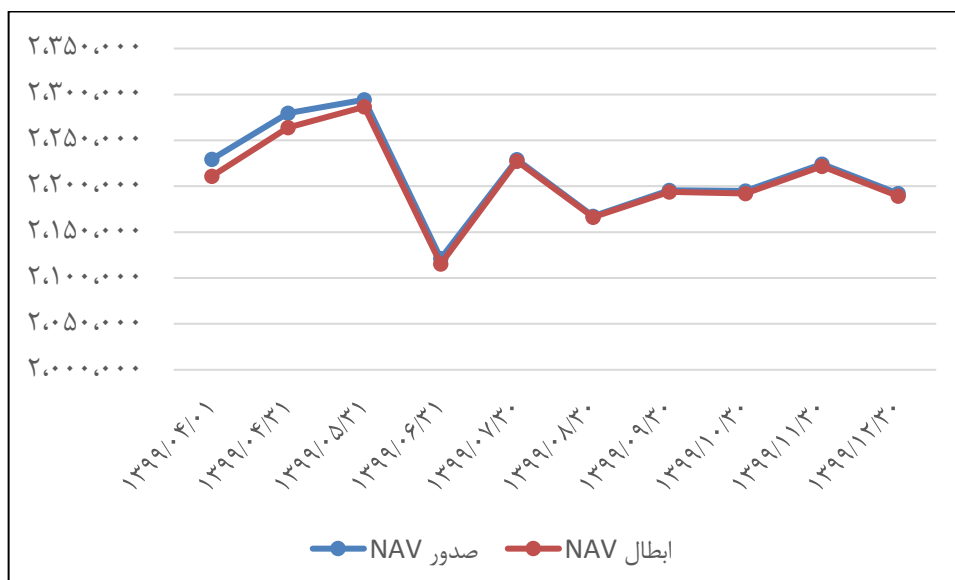
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV کارخانجات تولیدی شیشه رازی



نمودار NAV نیلی صنعت کرمان



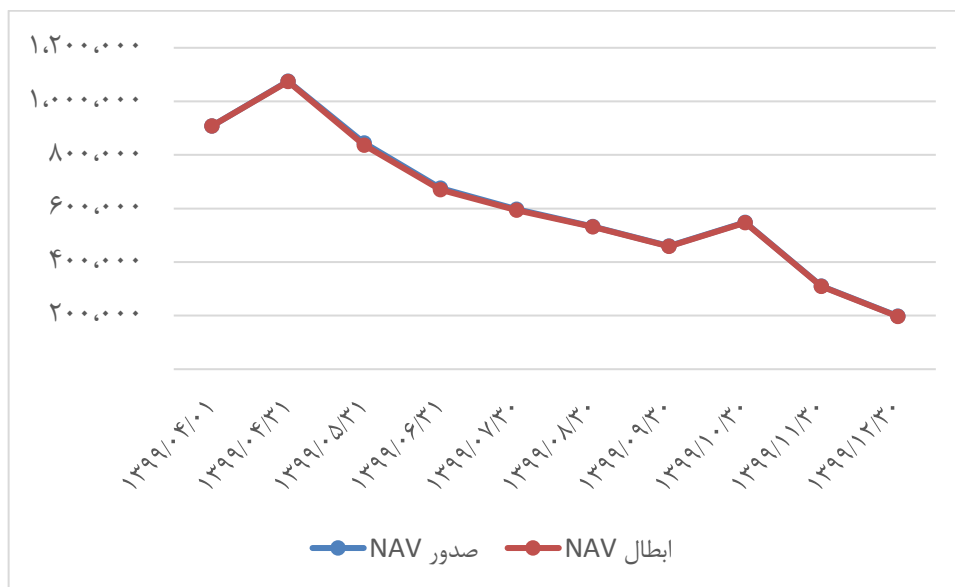
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV سهم سایپا دیزل



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

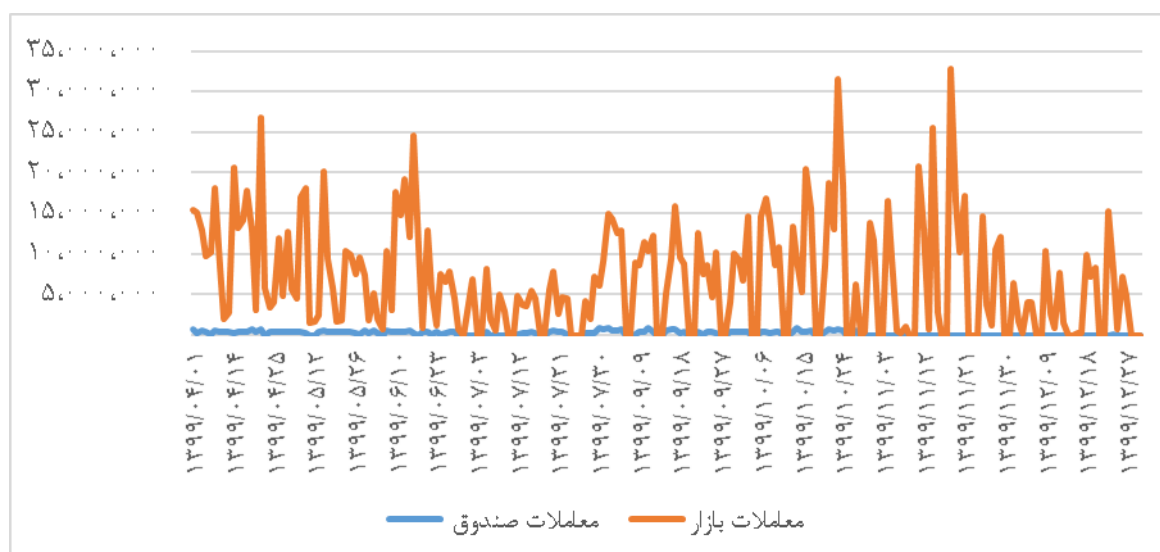
گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

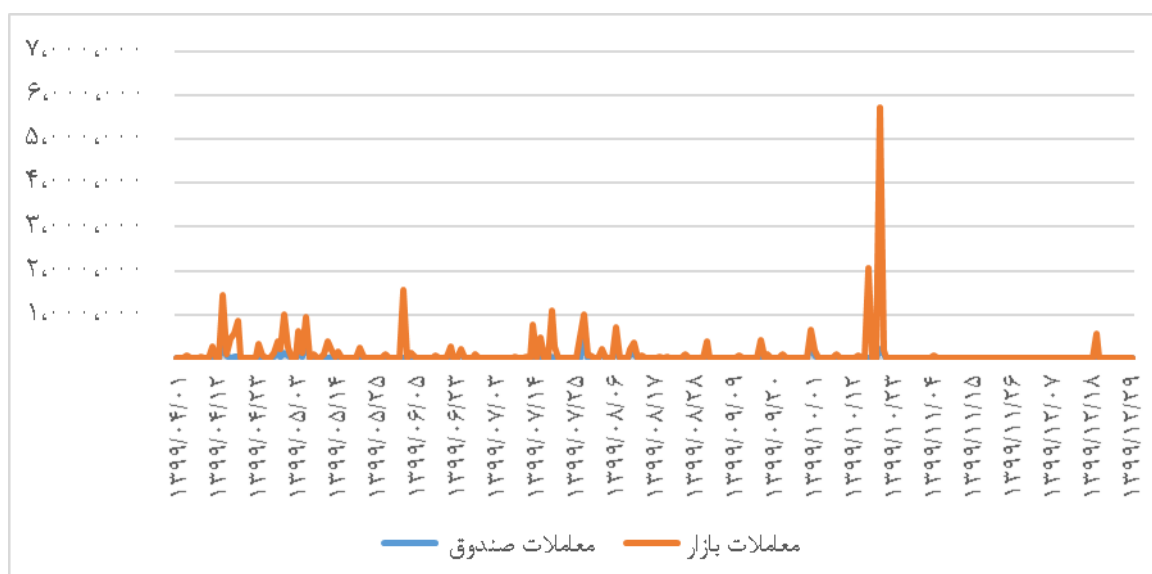
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

- کارخانجات تولیدی شیشه رازی:



- نیلی صنعت کرمان:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش‌های میان دوره ای

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۰ اسفند ماه ۱۳۹۹

• سایپا دیزل :

