

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۳۱ 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.

<u>شماره صفحه</u>	
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

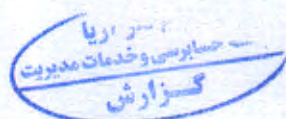
شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمانداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸

۱۳۹۸/۰۳/۳۱

ریال

	دارایی‌ها:
۳۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۶۷,۱۰۵,۷۲۲	حساب‌های دریافتی
۱,۹۱۶,۲۷۳,۵۶۲	جاری کارگزاران
.	موجودی نقد
۲۲۸,۷۳۹,۳۲۹	سایر دارایی‌ها
<u>۳۸,۰۶۹,۵۱۵,۹۵۹</u>	<u>جمع دارایی‌ها</u>
	بدهی‌ها:
۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶	پرداختنی به ارکان
۱۰۱,۳۹۷,۷۴۱	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
<u>۲۷۷,۷۳۸,۲۲۷</u>	<u>جمع بدهی‌ها</u>
<u>۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲</u>	<u>خالص دارایی‌ها:</u>
<u>۱,۳۱۸,۹۴۷</u>	<u>خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری</u>

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی ۳ ماه ۱۵ و روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸

دوره مالی ۳ ماه ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸	
ریال	
	درآمدها:
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	سود فروش اوراق بهادار
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
.	سود سهام
۱,۵۵۰,۲۱۲,۸۰۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
.	سایر درآمدها
۸,۰۵۷,۵۴۹,۳۶۷	جمع درآمدها
(۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۱۰,۱۷۴,۴۱۲)	سایر هزینه‌ها
(۲۸۶,۵۱۴,۸۹۸)	جمع هزینه‌ها
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	سود خالص
۲۸,۷۹%	میانگین سرمایه‌گذاری دوره ۱
۲۰,۷۳%	سرمایه‌گذاری پایان دوره ۲

صورت گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی ۳ ماه ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸	
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
	خالص دارایی‌های ابتدای دوره
۲۸,۶۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۸,۶۵۳
.	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
.	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
.	تقسیم سود
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	سود (زیان) خالص دوره
۱,۳۶۷,۷۴۳,۲۶۳	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸

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.

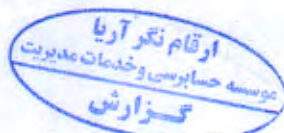
۱-۲ - اطلاع‌رسانی

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 ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد 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	سبذگردان 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 مشاوره 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.



ترکیب دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۳ ماه و ۱۵ روز منتهی به ۳۱ خرداد ۱۳۹۸

جدول فعالیت صندوق

فعالیت‌های صندوق	
۱,۰۵۴,۱۵۲	NAV صدور در تاریخ ۹۷/۱۲/۱۴
۱,۳۲۵,۱۸۷	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۰۳/۳۱
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۸/۰۳/۳۱
۲۸,۶۵۳	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۸/۰۳/۳۱
۲۸,۶۵۳	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
%۲۸,۷۹	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
%۲۰,۷۳	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

نمودار NAV

