
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان
گزارش عملکرد
برای دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی ۳ ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۰۶/۳۱ 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
۴-۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۷	• جدول فعالیت صندوق
۸	• نمودار NAV
۹	• نمودار حجم معاملات روزانه

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

در تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

۱۳۹۸/۰۳/۳۱	۱۳۹۸/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۳۷,۷۳۴,۴۸۲,۶۷۰	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	۱۶,۲۲۴,۱۹۸,۶۲۱	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۶۷,۱۰۵,۷۲۲	۵۵۵,۴۴۷,۶۷۱	حساب‌های دریافتی
۲۲۸,۷۳۹,۳۲۹	۱۵۱,۵۹۷,۹۲۶	سایر دارایی‌ها
۱,۹۱۶,۲۷۳,۵۶۲	۲,۸۹۱,۱۶۹,۷۳۲	جاری کارگزاران
۳۸,۰۶۹,۵۱۵,۹۵۹	۵۷,۵۵۶,۸۹۶,۶۲۰	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶	۳۵۱,۶۸۴,۸۳۱	بدهی به ارکان صندوق
۱۰۱,۳۹۷,۷۴۱	۱۵۶,۹۵۰,۵۵۵	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۲۷۷,۷۳۸,۲۲۷	۵۰۸,۶۳۵,۳۸۶	جمع بدهی‌ها
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۵۷,۰۴۸,۲۶۱,۲۳۴	خالص دارایی‌ها:
۱,۳۱۸,۹۴۷	۱,۶۸۸,۸۱۸	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

سال مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۴,۲۷۰,۰۰۹,۹۲۴	درآمدها:
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲	سود فروش اوراق بهادار
۰	۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳	زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱,۵۵۰,۲۱۲,۸۰۹	۵۹۷,۶۲۰,۹۰۷	سود سهام
۰	۱۰۳,۰۱۰	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۸,۰۵۷,۵۴۹,۳۶۷	۱۲,۵۹۴,۸۹۵,۵۵۶	سایر درآمدها
(۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶)	(۲۰۳,۱۳۹,۷۳۴)	جمع درآمدها
(۱۱۰,۱۷۴,۴۱۲)	(۱۳۵,۲۲۱,۸۱۷)	هزینه کارمزد ارکان
(۲۸۶,۵۱۴,۸۹۸)	(۳۳۸,۳۶۱,۵۵۱)	سایر هزینه‌ها
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۱۲,۲۵۶,۵۳۴,۰۰۵	جمع هزینه‌ها
۲۸,۷۹٪	۲۵,۲۲٪	سود خالص
۲۰,۷۳٪	۲۱,۵۳٪	میانگین سرمایه‌گذاری سال ۱
		سرمایه‌گذاری پایان سال ۲

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
ریال		ریال		
۰	۰	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	خالص دارایی‌های ابتدای دوره
۲۸,۶۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۸,۶۵۳	۵,۱۲۷,۰۰۰,۰۰۰	۵,۱۲۷	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
۰	۰	۰	۰	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۰	۰	۰	۰	تقسیم سود
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۰	۱۲,۲۵۶,۵۳۴,۰۰۵	۰	سود (زیان) خالص دوره
۱,۳۶۷,۷۴۳,۲۶۳	۰	۱,۸۷۲,۹۴۹,۴۹۷	۰	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	۵۷,۰۴۸,۲۶۱,۲۳۴	۳۳,۷۸۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

۱- اطلاعات کلی صندوق:

۱-۱- تاریخچه صندوق

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- اطلاع رسانی

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 سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور 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 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.

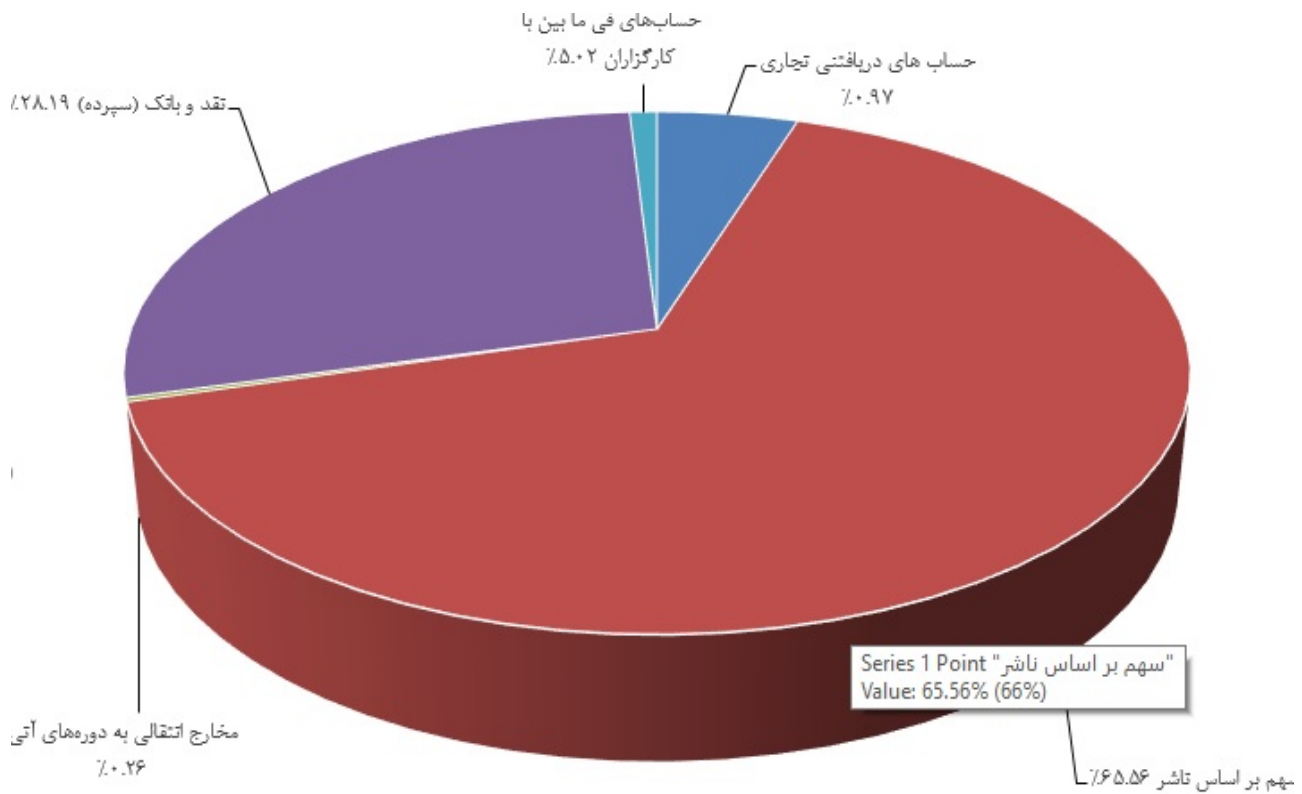
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از خیابان توحید نبش خیابان پرچم پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

ترکیب دارایی‌ها



■ حساب‌های دریافتی تجاری ■ نقد و بانک (سپرده) ■ مخارج انتقالی به دوره‌های آتی ■ سهم بر اساس ناشر ■ حساب‌های فی ما بین با کارگزاران

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

جدول فعالیت صندوق

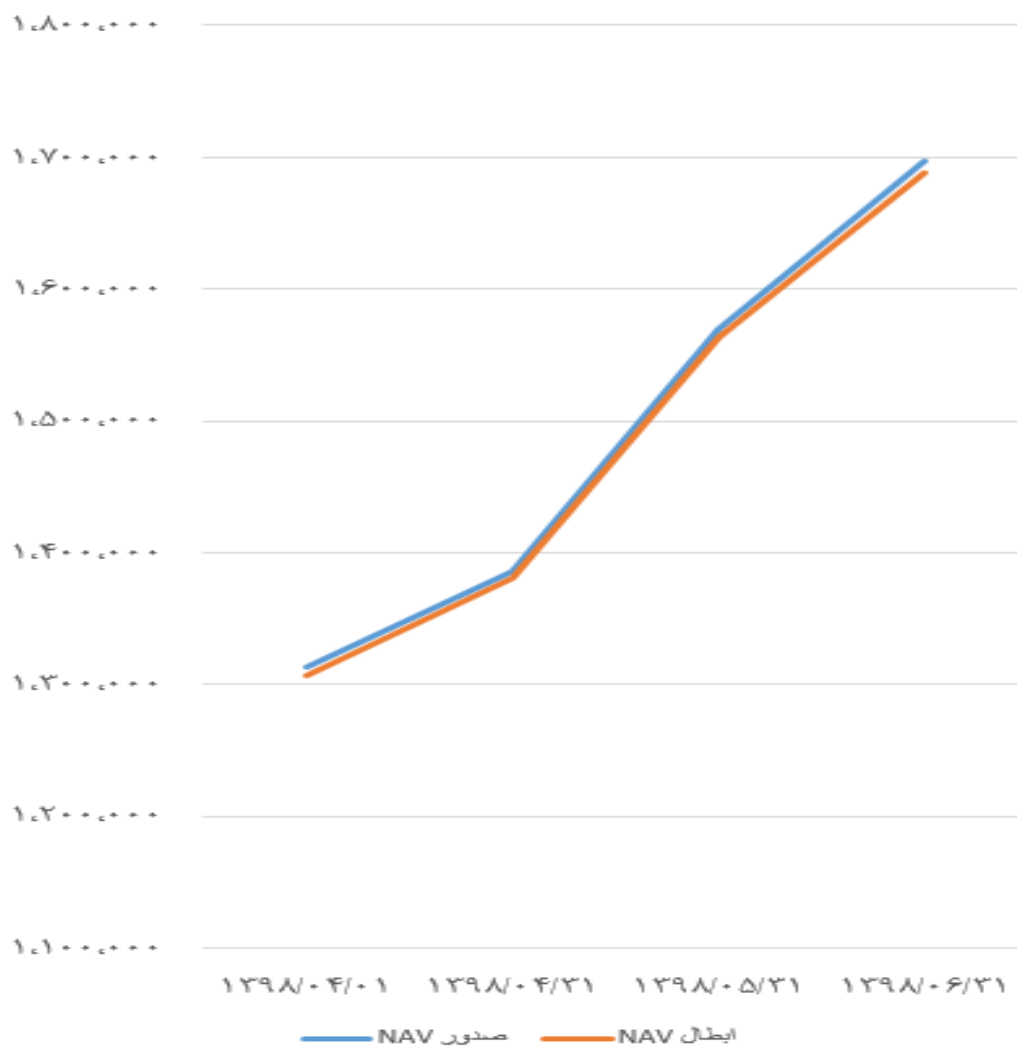
فعالیت‌های صندوق	
۱,۳۱۳,۵۸۸	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۰۴/۰۱ (ریال)
۱,۶۹۷,۷۴۳	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۰۶/۳۱ (ریال)
۵۷,۵۵۶,۸۹۶,۶۲۰	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۸/۰۶/۳۱ (ریال)
۳۳,۷۸۰	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۸/۰۶/۳۱
۰	تعداد کل واحدهای صادر شده طی سال
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی سال
%۲۵/۲۲	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
%۲۱/۵۳	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال مالی (درصد)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

نمودار NAV



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ شهریور ۱۳۹۸

نمودار حجم معاملات روزانه

