
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی ۶ ماهه و منتهی به تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۳۰ 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
۴-۵	• ارکان صندوق سرمایه‌گذاری
۶	• نمودار ترکیب دارایی‌ها
۷	• جدول فعالیت صندوق
۸	• نمودار NAV
۹	• نمودار معاملات

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 ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

۱۳۹۸/۰۳/۳۱	۱۳۹۸/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۲۲,۳۷۹,۲۶۶,۲۶۰	۵۰,۹۹۸,۴۵۵,۸۵۸	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳,۳۷۸,۱۳۱,۰۸۶	۲۵,۲۲۶,۷۳۹,۴۵۱	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۶۷,۱۰۵,۷۲۲	۳۴۳,۲۹۸,۰۰۰	حساب‌های دریافتی
۲۲۸,۷۳۹,۳۲۹	۸۶,۳۵۱,۱۷۶	سایر دارایی‌ها
۱,۹۱۶,۲۷۳,۵۶۲	۰	جاری کارگزاران
<u>۳۸,۰۶۹,۵۱۵,۹۵۹</u>	<u>۷۶,۶۵۴,۸۴۴,۴۸۵</u>	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۰	۲,۶۰۵,۱۹۶,۴۵۳	جاری کارگزاران
۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶	۶۰۴,۹۰۸,۵۹۵	بدهی به ارکان صندوق
۱۰۱,۳۹۷,۷۴۱	۲۳۱,۷۹۷,۳۸۴	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
<u>۲۷۷,۷۳۸,۲۲۷</u>	<u>۳,۴۴۱,۹۰۲,۴۳۲</u>	جمع بدهی‌ها
<u>۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲</u>	<u>۷۳,۲۱۲,۹۴۲,۰۵۳</u>	خالص دارایی‌ها:
<u>۱,۳۱۸,۹۴۷</u>	<u>۱,۷۹۵,۳۱۵</u>	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۳/۳۱	دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
۲,۷۳۷,۷۲۷,۸۳۱	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸	درآمدها:
۳,۷۶۹,۶۰۸,۷۲۷	۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	سود فروش اوراق بهادار
۰	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵	سود/زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱,۵۵۰,۲۱۲,۸۰۹	۱,۱۴۵,۸۶۹,۲۴۰	سود سهام
۰	۱۰۳,۰۱۰	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۸,۰۵۷,۵۴۹,۳۶۷	۲۲,۱۹۱,۶۸۳,۳۳۶	سایر درآمدها
(۱۷۶,۳۴۰,۴۸۶)	(۴۹۲,۷۳۵,۱۱۶)	جمع درآمدها
(۱۱۰,۱۷۴,۴۱۲)	(۲۷۷,۷۳۳,۳۹۶)	هزینه کارمزد ارکان
(۲۸۶,۵۱۴,۸۹۸)	(۷۷۰,۴۶۸,۵۱۲)	سایر هزینه‌ها
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	جمع هزینه‌ها
۲۸,۷۹٪	۳۹,۴۱٪	سود خالص
۲۰,۷۳٪	۲۹,۳۹٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری دوره
		بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/سال

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱		دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۳۹۷/۰۹/۳۰		
ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	
۰	۰	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	خالص دارایی‌های ابتدای دوره
۲۸,۶۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۸,۶۵۳	۱۲,۱۲۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۱۲۷	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
۷,۷۷۱,۰۳۴,۴۶۹	۰	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	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	۷۳,۲۱۲,۹۴۲,۰۵۳	۴۰,۷۸۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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 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 ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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	سبدردان 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.

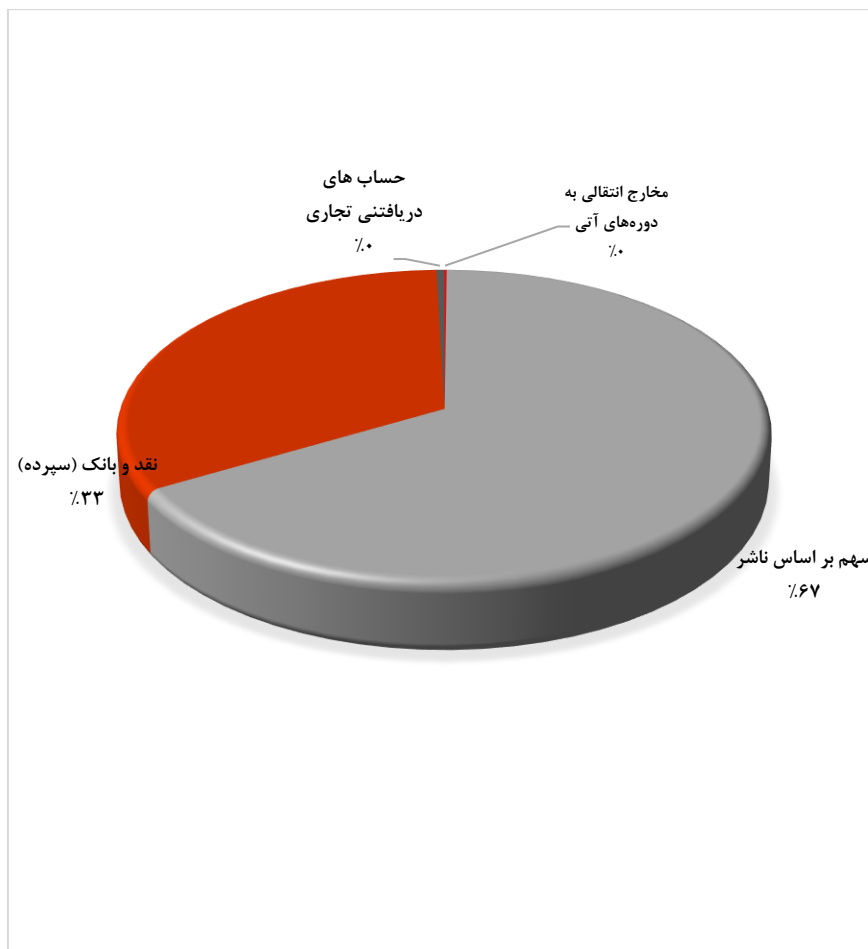
حسابرس صندوق: مؤسسه حسابرسی ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ به شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان استان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از خیابان توحید نبش خیابان پرچم پلاک ۶۸ طبقه دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

ترکیب دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

جدول فعالیت صندوق

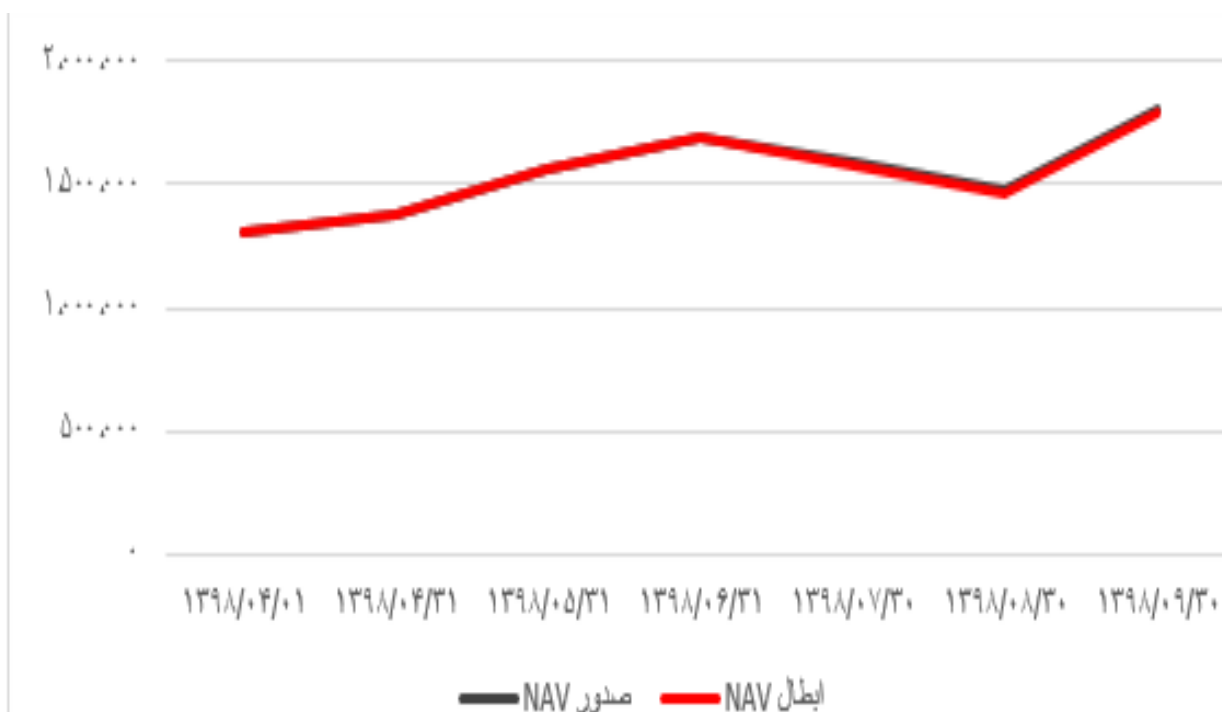
فعالیت‌های صندوق	
۱,۳۱۳,۵۸۸	NAV صدور در تاریخ ۹۷/۰۴/۰۱
۱,۸۰۵,۳۰۷	NAV صدور در تاریخ ۹۸/۰۹/۳۰
۷۳,۲۱۲,۹۴۲,۰۵۳	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۸/۰۹/۳۰
۴۰,۷۸۰	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۸/۰۹/۳۰
۱۲,۱۲۷	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
۳۹,۴۱٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
۲۹,۳۹٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

نمودار NAV



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذر ۱۳۹۸

نمودار حجم معاملات

