
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی سه ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۶/۳۱ 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.

<u>شماره صفحه</u>	
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



نماینده
بابک حقیقی مهمان‌داری

شخص حقوقی
شرکت کارگزاری آبان

ارکان صندوق
مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

۱۳۹۹/۰۳/۳۱	۱۳۹۹/۰۶/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۵۳,۰۷۰,۶۶۴,۳۶۳	۱۴۹,۱۵۴,۲۷۵,۶۲۲	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳۶,۷۴۰,۴۶۸,۴۶۴	۲۷,۲۶۸,۳۳۰,۳۳۷	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۵۶,۰۰۸,۰۹۰	۱۵۶,۰۰۸,۰۹۰	حساب‌های دریافتی
۱۸,۰۶۶,۸۹۷,۷۱۸	۰	جاری کارگزاران
۲۱۱,۴۳۹,۲۰۱	۱۳۸,۸۵۰,۳۰۴	سایر دارایی‌ها
۲۰۸,۲۴۵,۴۷۷,۸۳۶	۱۷۶,۷۱۷,۴۶۴,۳۵۳	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۰	۹,۹۹۴,۶۶۷,۸۹۶	جاری کارگزاران
۱,۲۴۵,۹۵۵,۵۳۱	۱,۹۷۵,۸۴۳,۷۱۹	بدهی به ارکان صندوق
۸۱,۸۹۴	۰	پرداختنی به سرمایه‌گذاران
۵۸۹,۶۵۲,۴۲۳	۴۹۲,۵۵۱,۱۲۴	سایر حسابهای پرداختنی و ذخایر
۱,۸۳۵,۶۸۹,۸۴۸	۱۲,۴۶۳,۰۶۲,۷۳۹	جمع بدهی‌ها
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۶۴,۲۵۴,۴۰۱,۶۱۴	خالص دارایی‌ها:
۱,۷۶۰,۰۷۹	۱,۳۴۴,۳۶۴	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 ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱	درآمدها:
ریال	ریال	ریال	
۸۱,۷۱۲,۱۸۷,۴۹۰	۴,۲۷۰,۰۰۹,۹۲۴	(۴,۵۰۹,۷۸۱,۵۱۶)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۸,۳۱۹,۳۵۱,۵۹۹	۷,۰۴۳,۶۴۳,۲۸۲	(۴۳,۰۳۹,۶۸۸,۱۵۵)	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۶۸۳,۵۱۸,۴۳۳	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	سود سهام
۳,۱۲۷,۶۴۹,۴۵۵	۵۹۷,۶۲۰,۹۰۷	۱,۰۹۷,۱۵۳,۳۹۴	سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۰,۳۱۰	۱۰۳,۰۱۰	۸۵۰,۶۶۹	سایر درآمدها
۹۳,۸۷۷,۷۸۴,۲۳۴	۱۲,۵۹۴,۸۹۵,۵۵۶	(۴۶,۱۲۸,۴۵۴,۰۰۸)	جمع درآمدها
هزینه ها :			
(۱,۲۷۵,۸۱۷,۳۴۶)	(۲۰۳,۱۳۹,۷۳۴)	(۸۲۳,۰۵۸,۹۸۲)	هزینه کارمزد ارکان
(۶۱۹,۲۹۴,۷۹۳)	(۱۳۵,۲۲۱,۸۱۷)	(۲۰۳,۴۲۴,۳۱۱)	سایر هزینه‌ها
(۱,۸۹۵,۱۱۲,۱۳۹)	(۳۳۸,۳۶۱,۵۵۱)	(۱,۰۲۶,۴۸۳,۲۹۳)	جمع هزینه ها
۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	۱۲,۲۵۶,۵۳۴,۰۰۵	(۴۷,۱۵۴,۹۳۷,۳۰۱)	سود خالص
۱۰۰.۸۷٪	۲۵.۲۲٪	(۲۳.۷۳)٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان سال (۱)
۴۹.۹۳٪	۲۱.۵۳٪	(۲۸.۶۸)٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان سال (۲)

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱		دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۶/۳۱		دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱		
ریال	تعداد واحدها	ریال	تعداد واحدها	ریال	تعداد واحدها	
۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	۳۷,۷۹۱,۷۷۷,۷۳۲	۲۸,۶۵۳	۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) ابتدای دوره
۹۴,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۴,۹۰۰	۵,۱۲۷,۰۰۰,۰۰۰	۵,۱۲۷	۴,۹۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۴,۹۰۷	واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۶,۲۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۶,۲۸۰)	۰	۰	۰	۰	واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	۰	۱۲,۲۵۶,۵۳۴,۰۰۵	۰	(۴۷,۱۵۴,۹۳۷,۳۰۱)	۰	سود خالص دوره
(۱۱,۹۸۴,۶۶۱,۸۳۹)	۰	۱,۸۷۲,۹۴۹,۴۹۷	۰	۹۲,۵۵۰,۹۲۷	۰	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۵۷,۰۴۸,۲۶۱,۲۳۴	۳۳,۷۸۰	۱۶۴,۲۵۴,۴۰۱,۶۱۴	۱۲۲,۱۸۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور 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

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور 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

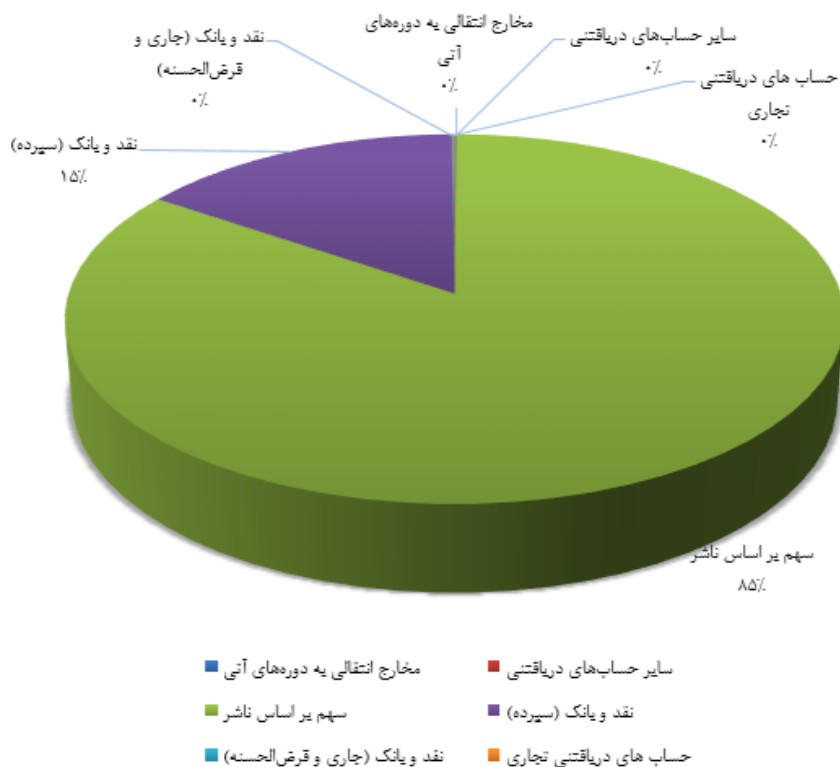
متولی صندوق: شرکت مشاوره سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷ حسابرس صندوق: 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 دوم.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

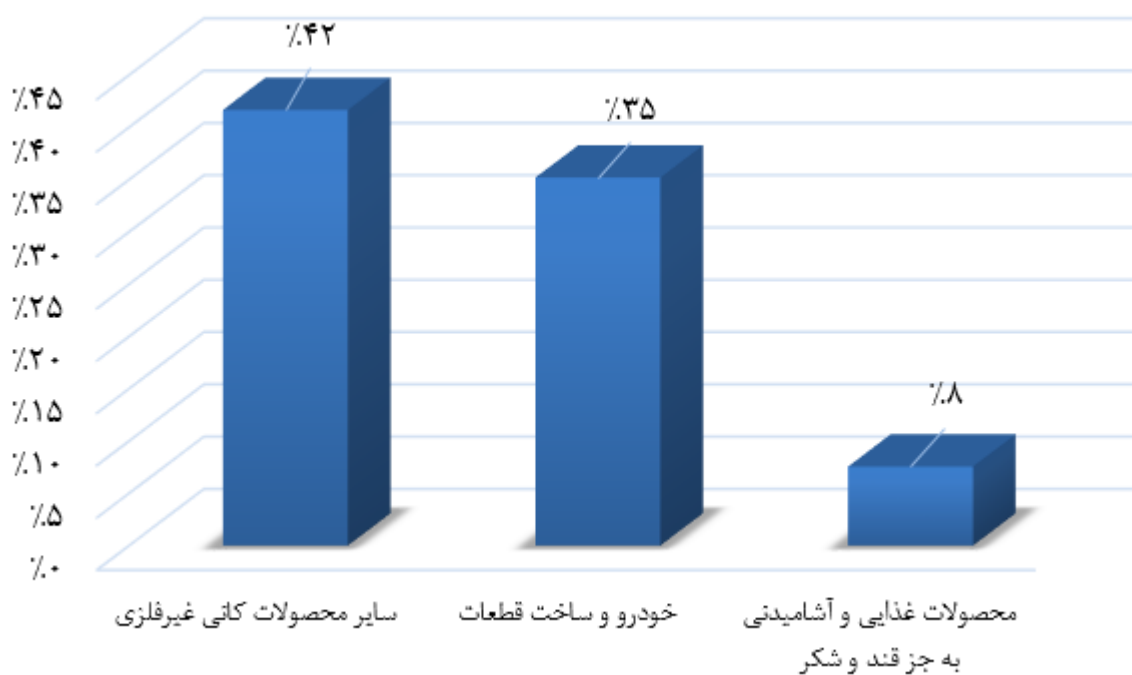
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

ترکیب دارایی‌ها



سهم بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

جدول فعالیت صندوق

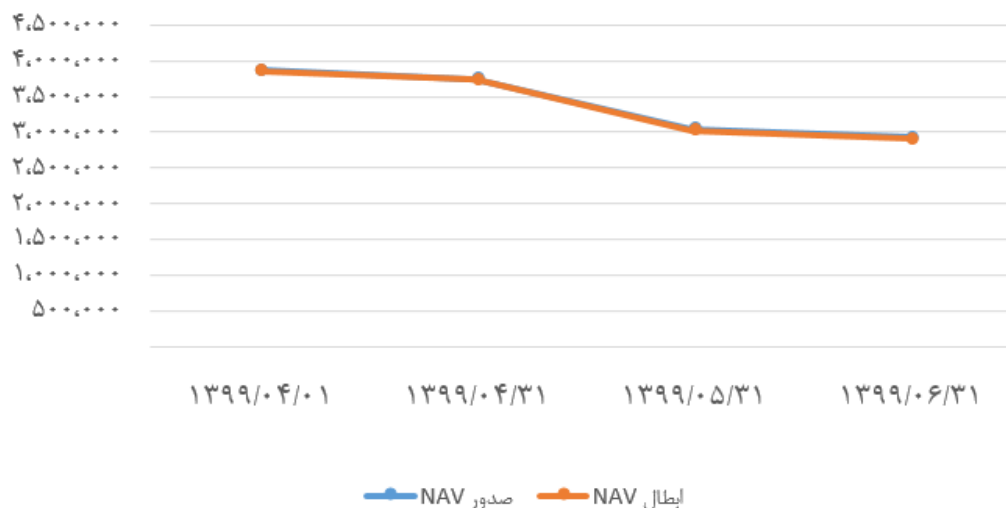
فعالیت‌های صندوق	
۱,۷۶۳,۷۷۱	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۴/۰۱
۱,۳۵۲,۱۵۱	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۶/۳۱
۱۶۴,۲۵۴,۴۰۱,۶۱۴	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۹/۰۶/۳۱
۱۲۲,۱۸۰	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۹/۰۶/۳۱
۴,۹۰۷	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
(۲۳,۷۳)%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری
(۲۸,۶۸)%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

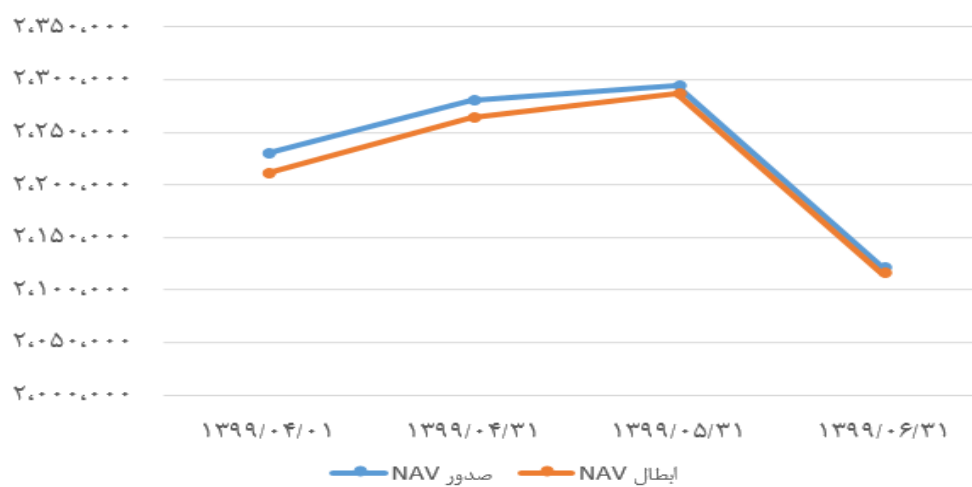
گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV کارخانجات تولیدی شیشه رازی



نمودار NAV نیلی صنعت کرمان

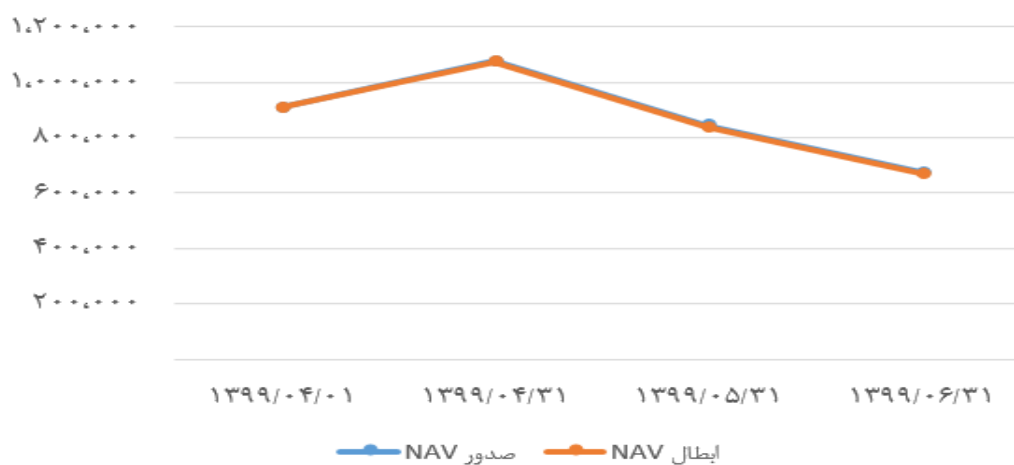


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV سهم سایپا دیزل



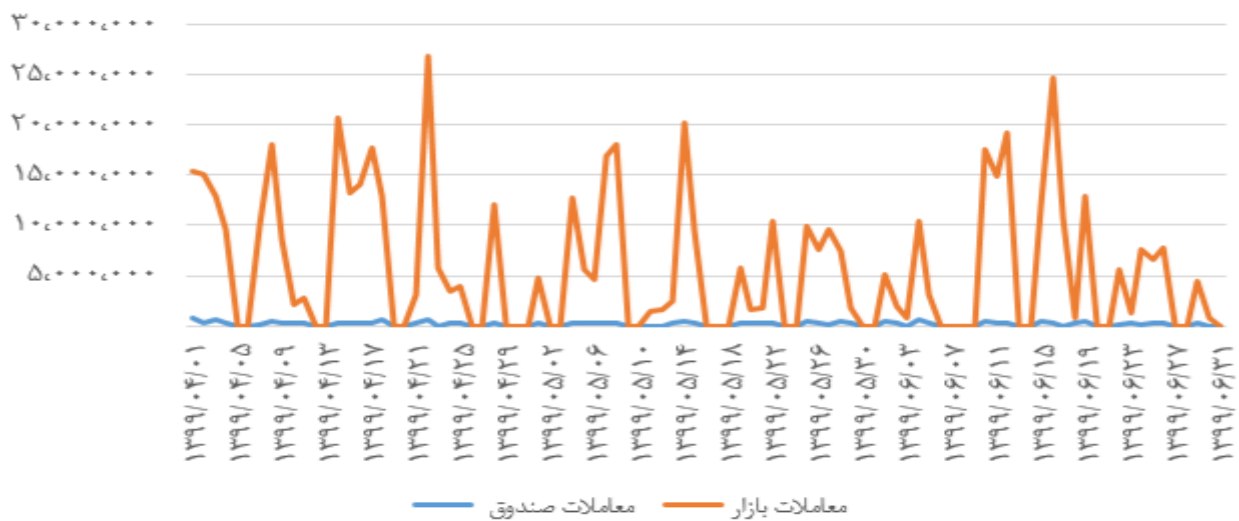
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

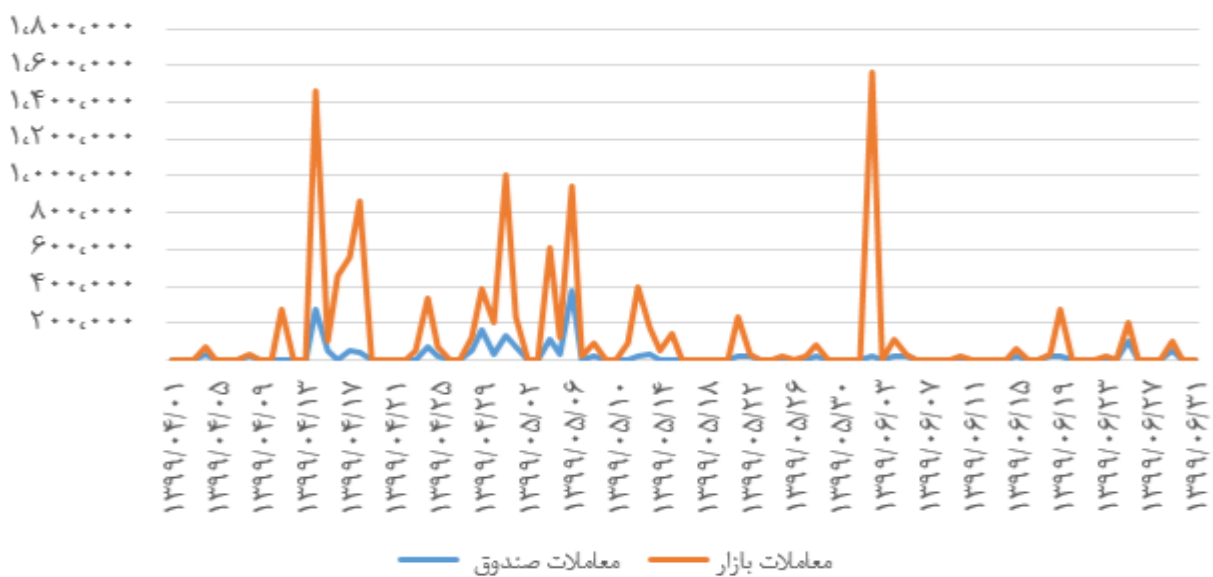
دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

- کارخانجات تولیدی شیشه رازی:



- نیلی صنعت کرمان:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ماه ۱۳۹۹

• سایپا دیزل :

