
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

با سلام؛

به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان مربوط به دوره مالی شش ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۹/۳۰ 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.

<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

امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

بابک حقیقی مهمانداری

شرکت کارگزاری آبان

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت خالص دارایی‌ها

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

۱۳۹۹/۰۳/۳۱	۱۳۹۹/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	
		دارایی‌ها:
۵۳,۰۷۰,۶۶۴,۳۶۳	۱۴۹,۷۱۳,۶۱۹,۲۲۷	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱۳۶,۷۴۰,۴۶۸,۴۶۴	۳۸,۷۸۰,۶۲۸,۴۸۴	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱۵۶,۰۰۸,۰۹۰	۱۱۱,۲۳۱,۰۴۴	حساب‌های دریافتی
۱۸,۰۶۶,۸۹۷,۷۱۸	۰	جاری کارگزاران
۲۱۱,۴۳۹,۲۰۱	۶۹,۳۹۵,۸۱۰	سایر دارایی‌ها
۰	۹۹,۴۳۱,۷۶۱	موجودی نقد
۲۰۸,۲۴۵,۴۷۷,۸۳۶	۱۸۸,۷۷۴,۳۰۶,۳۲۶	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۰	۱۹,۳۸۹,۴۱۰,۰۷۷	جاری کارگزاران
۱,۲۴۵,۹۵۵,۵۳۱	۸۷۴,۵۲۱,۹۷۸	بدهی به ارکان صندوق
۸۱,۸۹۴	۰	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۵۸۹,۶۵۲,۴۲۳	۵۵۶,۲۸۰,۲۷۵	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۱,۸۳۵,۶۸۹,۸۴۸	۲۰,۷۲۰,۲۱۲,۳۳۰	جمع بدهی‌ها
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۶۸,۰۵۴,۰۹۳,۹۹۶	خالص دارایی‌ها:
۱,۷۶۰,۰۷۹	۱,۲۴۷,۸۰۳	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰	دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰	
ریال	ریال	ریال	درآمدها:
۸۱,۷۱۲,۱۸۷,۴۹۰	۸,۶۹۸,۳۳۹,۸۷۸	(۵۱,۵۳۹,۹۰۱,۶۱۳)	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۸,۳۱۹,۳۵۱,۵۹۹	۱۱,۶۳۲,۹۱۰,۴۷۳	(۲۹۶,۴۸۱,۷۶۰)	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۷۱۸,۴۹۲,۶۸۰	۷۱۴,۴۶۰,۷۳۵	۳۲۳,۰۱۱,۶۰۰	سود سهام
۳,۱۲۷,۶۴۹,۴۵۵	۱,۱۴۵,۸۶۹,۲۴۰	۲,۱۰۵,۶۶۳,۴۲۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۰۳,۰۱۰	۱۰۳,۰۱۰	۸۵۰,۶۶۹	سایر درآمدها
۹۳,۸۷۷,۷۸۴,۲۳۴	۲۲,۱۹۱,۶۸۳,۳۳۶	(۴۹,۴۰۶,۸۵۷,۶۷۸)	جمع درآمدها
			هزینه ها :
(۱,۲۷۵,۸۱۷,۳۴۶)	(۴۹۲,۷۳۵,۱۱۶)	(۱,۵۵۵,۸۴۶,۱۶۸)	هزینه کارمزد ارکان
(۶۱۹,۲۹۴,۷۹۳)	(۲۷۷,۷۳۳,۳۹۶)	(۳۹۲,۵۲۸,۵۷۳)	سایر هزینه‌ها
(۱,۸۹۵,۱۱۲,۱۳۹)	(۷۷۰,۴۶۸,۵۱۲)	(۱,۹۴۸,۳۷۴,۷۴۱)	جمع هزینه ها
۹۱,۹۸۲,۶۷۲,۰۹۵	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	(۵۱,۳۵۵,۲۳۲,۴۱۹)	سود خالص
۱۰۰.۸۷٪	۳۹.۴۱٪	(۲۸.۴۳)٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره/سال (۱)
۴۹.۹۳٪	۲۹.۳۹٪	(۳۰.۱۳)٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/سال (۲)

صورت گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱		دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰		دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰		
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	۱۲,۱۲۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۱۲۷	۱۷,۴۰۷,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۴۰۷	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	۲۱,۴۲۱,۲۱۴,۸۲۴	۰	(۵۱,۳۵۵,۲۳۲,۴۱۹)	۰	سود خالص دوره
(۱۱,۹۸۴,۶۶۱,۸۳۹)	۰	۱,۸۷۲,۹۴۹,۴۹۷	۰	(۴,۴۰۷,۴۶۱,۵۷۳)	۰	تعدیلات ناشی از ارزشگذاری قیمت صدور و ابطال
۲۰۶,۴۰۹,۷۸۷,۹۸۸	۱۱۷,۲۷۳	۷۳,۲۱۲,۹۴۲,۰۵۳	۴۰,۷۸۰	۱۶۸,۰۵۴,۰۹۳,۹۹۶	۱۳۴,۶۸۰	خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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 شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر 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

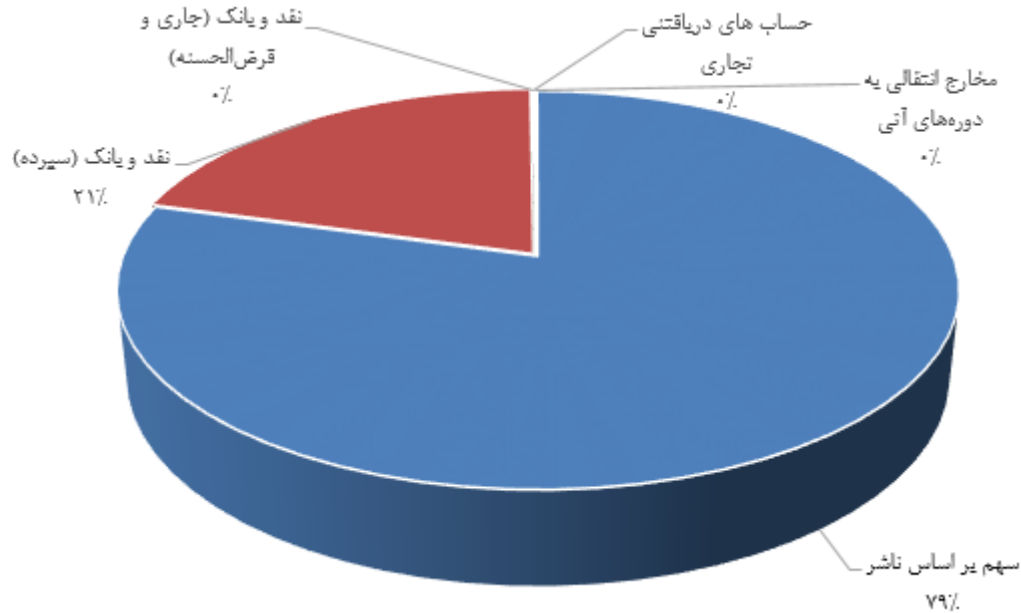
متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری سهم آشنا (سهامی خاص) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۲۸ با شماره ثبت ۵۲۴۷۰۶ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است و نشانی متولی عبارت است از سعادت‌آباد - بالاتر از میدان کاج - خیابان شهید محمدرضا یعقوبی (هشتم) - پلاک ۲۷ - طبقه چهارم - واحد ۷ حسابرس صندوق: مؤسسه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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

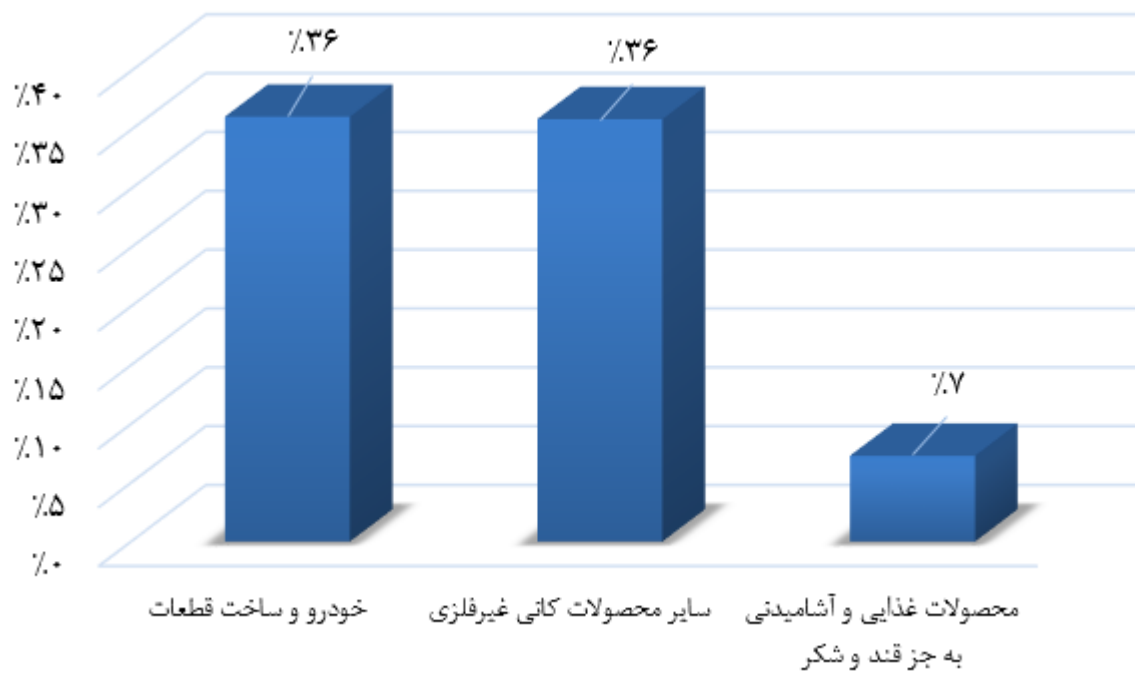
گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

ترکیب دارایی‌ها



سهام بر اساس ناشر



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

جدول فعالیت صندوق

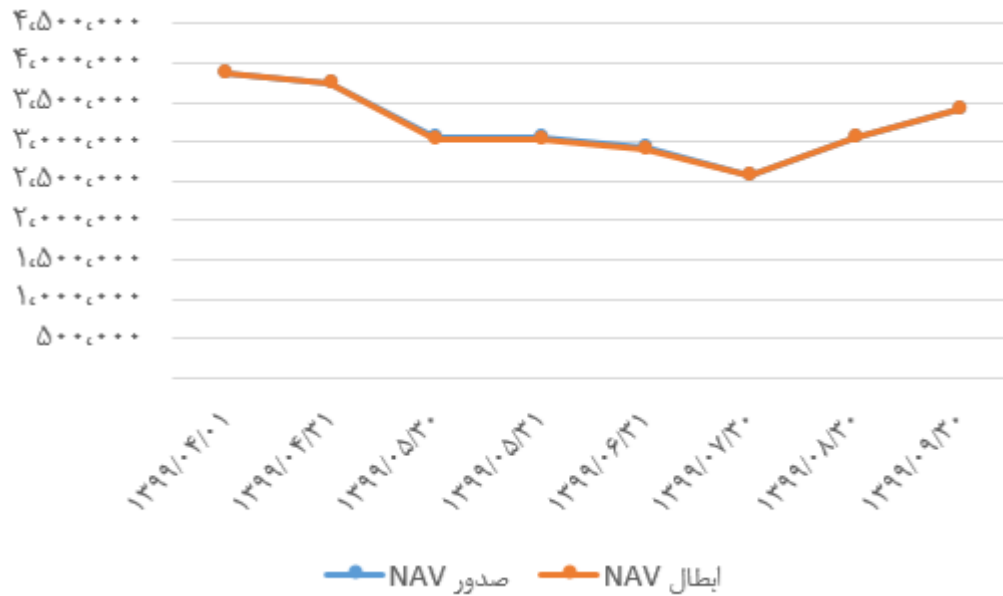
فعالیت‌های صندوق	
۱.۷۶۳.۷۷۱	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۴/۰۱
۱.۲۴۹.۴۶۵	NAV صدور در تاریخ ۹۹/۰۹/۳۰
۱۶۸.۰۵۴.۰۹۳.۹۹۶	کل ارزش خالص دارایی‌ها در تاریخ ۹۹/۰۹/۳۰
۱۳۴.۶۸۰	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در تاریخ ۹۹/۰۹/۳۰
۱۷,۴۰۷	تعداد کل واحدهای صادر شده طی دوره
۰	تعداد کل واحدهای باطل شده طی دوره
(۲۸,۴۳)%	بازده میانگین سرمایه‌گذاری پایان دوره/ سال مالی
(۳۰,۱۳)%	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره/ سال مالی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

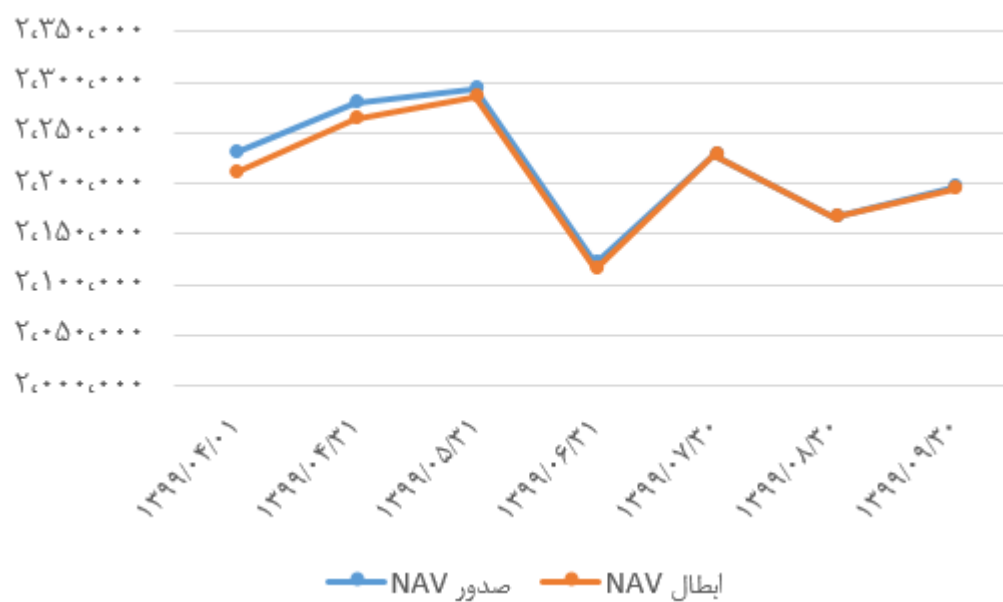
گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV کارخانجات تولیدی شیشه رازی



نمودار NAV نیلی صنعت کرمان

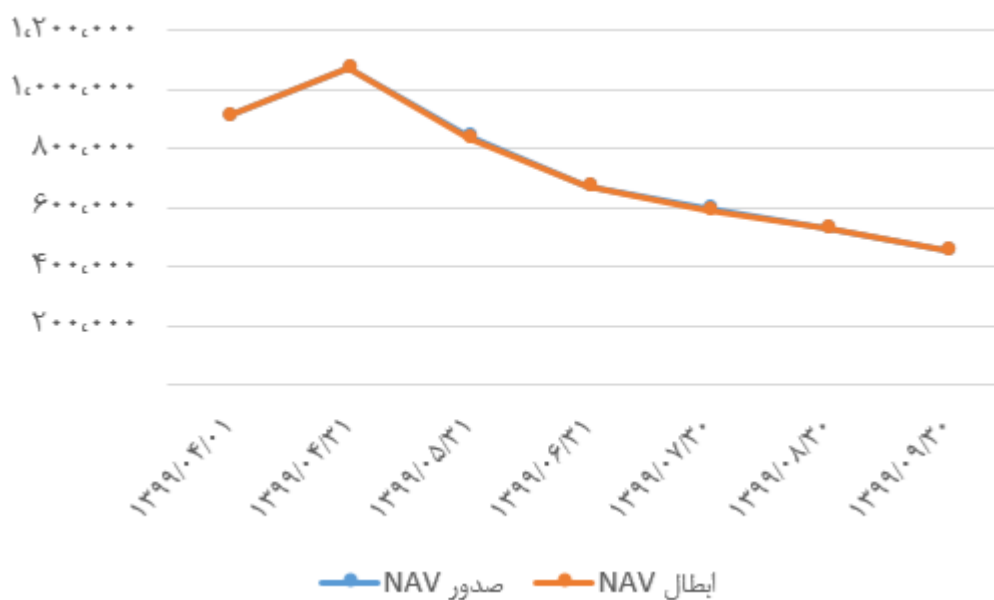


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

نمودار NAV سهم سایپا دیزل



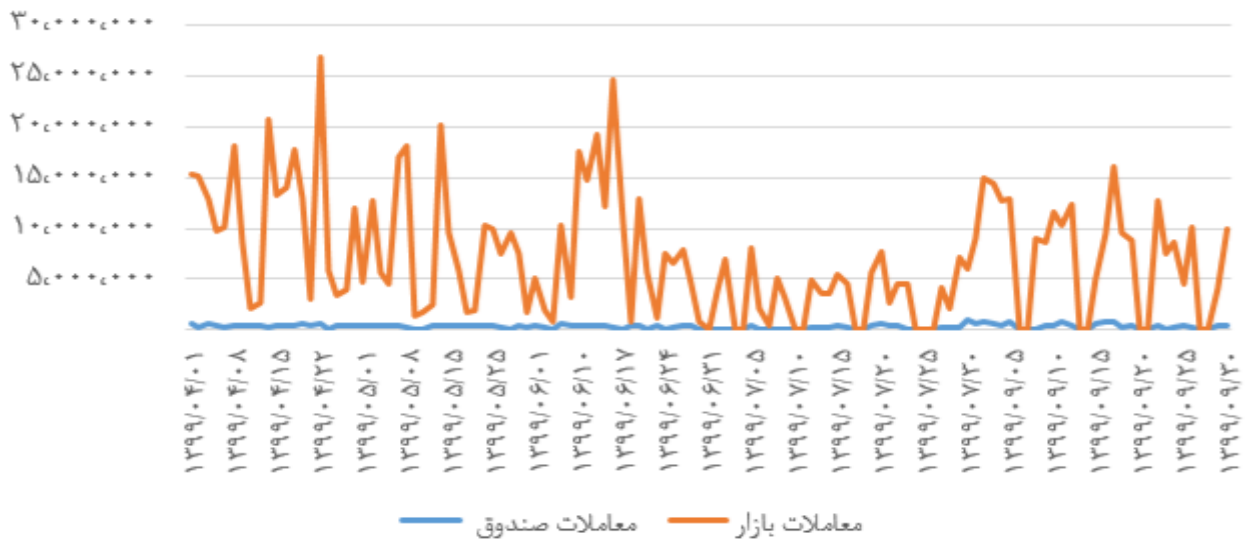
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

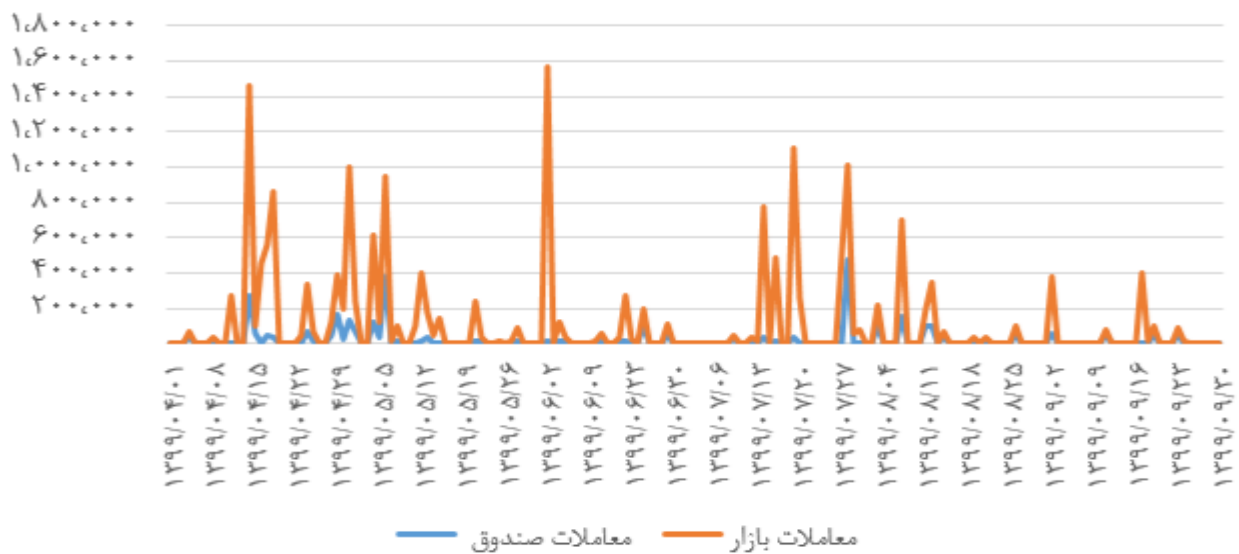
دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

نمودار مقایسه حجم معاملات صندوق و بازار

- کارخانجات تولیدی شیشه رازی:



- نیلی صنعت کرمان:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی هوشمند آبان

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ آذر ماه ۱۳۹۹

• سایپا دیزل :

