



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
الگوریتم سرآمد بازار

شماره ثبت نزد سازمان بورس و اوراق بهادار: ۱۱۹۰۳
مرجع ثبت شرکت ها: ۵۲۳۴۸

شماره :

تاریخ :

پیوست :

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

با سلام و احترام

به پیوست صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار مربوط به دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰ 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 دارایی ها
۳	صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها
	یادداشت‌های توضیحی :
۴	الف - اطلاعات کلی صندوق
۴-۵	ب-ارکان صندوق
۵	پ - مبنای تهیه صورت‌های مالی
۵-۷	ت - خلاصه اهم رویه های حسابداری
۸-۱۲	ث- یادداشت های مربوط به اقلام مندرج در صورت های مالی و سایر اطلاعات مالی
این صورت های مالی در چارچوب استانداردهای حسابداری و با توجه به قوانین و مقررات سازمان بورس و اوراق بهادار در رابطه با صندوق های سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار تهیه گردیده است. مدیریت صندوق بر این باور است که این صورت های مالی برای ارائه تصویری روشن و منصفانه از وضعیت عملکرد مالی صندوق، در برگیرنده همه اطلاعات مربوط به صندوق، هماهنگ با واقعیت های موجود و اثرات آن ها در آینده که به صورت معقول در موقعیت کنونی می توان پیش بینی نموده می باشد و اطلاعات مزبور به نحو درست و به گونه کافی در این صورت های مالی افشاء گردیده اند.	
صورت‌های مالی حاضر در تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ تایید ارکان زیر رسیده است.	

سیدگردان سرآمد بازار



ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده
مدیر صندوق	سیدگردان سرآمد بازار	بهروز زارع
متولی صندوق	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی	علیرضا باغانی



۰۲۱-۸۸۸۵۷۱۳۵
۰۲۱-۸۸۸۵۷۴۱۵



www.smaf.ir



چهارراه جهان کودک، بلوار نلسون ماندلا، خیابان بدیدار، پلاک ۵۴، طبقه اول
کدپستی: ۱۵۱۸۸۳۴۱۱۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

صورت خالص دارایی ها

به تاریخ ۳۰ مهر ۱۴۰۰

دارایی ها	یادداشت	۱۴۰۰/۰۷/۳۰
موجودی نقد	۵	ریال ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع دارایی ها		۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
بدهی ها:		
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۶	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع بدهی ها		۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
خالص دارایی ها		-
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری		-

یادداشت های توضیحی همراه، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی است. سرمایه بازار



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

یادداشت	دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۱۴۰۰/۰۷/۳۰
	ریال
	-
	-
	-
	۰.۰۰٪
	۰.۰۰٪

درآمدها:

جمع درآمدها

هزینه ها:

جمع هزینه ها

سود(زیان) خالص

بازده میانگین سرمایه گذاری ۱

بازده سرمایه گذاری پایان سال مالی ۲

صورت گردش خالص دارایی ها

یادداشت	دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۱۴۰۰/۰۷/۳۰
	تعداد واحدهای سرمایه گذاری
	ریال
	-
	-
	-
	-
	-

خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره

واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره

واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره

سود خالص دوره

تعدیلات

خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) در پایان دوره

یادداشت های توضیحی همراه ، بخش جدایی ناپذیر صورتهای مالی است.

سود (زیان) خالص

۱- بازده میانگین سرمایه گذاری =

میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده

تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال $\pm$ سود (زیان) خالص

۲- بازده سرمایه گذاری پایان سال مالی =

خالص دارائیهای پایان سال مالی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار با شناسه ملی ۱۴۰۱۰۳۸۴۸۴۶ در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۱۵ تحت شماره ۱۱۹۰۳ به عنوان صندوق بازارگردانی نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و با شماره ۵۲۳۴۸ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران به منظور ایفای تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود علاوه بر انجام عملیات بازارگردانی، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در زمینه‌های بند ۲-۲ مندرج در امیدنامه سرمایه‌گذاری می‌نماید. مجوز فعالیت صندوق تا پایان تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ صادر گردیده است. مرکز اصلی صندوق در تهران، بلوار نلسون ماندلا، خیابان پدیدار، پلاک ۵۴، طبقه ۱ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی‌باشد.

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه و بند ۱۲ امیدنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس smaf.exphoenixfund.com درج گردیده است.

۲-۱- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است.

۲-۱- مجمع صندوق: از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری ممتاز، از حق رأی در مجمع برخوردارند. در تاریخ خالص دارایی ها واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی (که دارای حق رأی هستند) صادر نشده است.

۲-۲- مدیر صندوق و مدیر ثبت: شرکت سبد گردان سرآمد بازار که در تاریخ ۱۳۹۴/۰۴/۰۸ به شماره ۴۷۴۸۵۰ در اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران، بلوار نلسون ماندلا، خیابان پدیدار، پلاک ۵۴، طبقه ۱.

۲-۳- متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی است که در تاریخ ۱۳۸۸/۰۳/۲۷ به شماره ثبت ۳۵۳۰۲۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان سید جمال‌الدین اسدآبادی، خیابان ابن سینا، کوچه نهم، پلاک ۶، طبقه سوم، واحد ۶.

۲-۴- حسابرس صندوق: موسسه حسابرسی رازدار است که در تاریخ ۱۳۴۹/۱۱/۰۳ به شماره ثبت ۱۱۷۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، میدان آرژانتین، خیابان احمد قصیر (بخارست)، کوچه نوزدهم، پلاک ۱۸، واحد ۱۴، کدپستی ۱۵۱۳۸۴۳۸۳۷.

۳- مبنای تهیه صورت‌های مالی:

صورت‌های مالی صندوق بر مبنای ارزش‌های جاری در پایان دوره/ سال مالی تهیه شده است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۴- خلاصه اهم رویه های حسابداری

۴-۱- سرمایه‌گذاری ها

سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار (شامل سهام و سایر انواع اوراق بهادار) در هنگام تحصیل به بهای تمام شده ثبت و در اندازه‌گیری‌های بعدی به خالص ارزش فروش طبق دستورالعمل " نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری " مصوب ۱۳۸۶/۱۱/۳۰ هیأت مدیره سازمان بورس اوراق بهادار اندازه‌گیری می‌شود.

۴-۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی:

سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی به خالص ارزش فروش منعکس می‌شود. خالص ارزش فروش سهام عبارت است از ارزش بازار سهم در پایان روز یا قیمت تعدیل شده سهم، منهای کارمزد معاملات و مالیات فروش سهام. باتوجه به دستورالعمل " نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری "، مدیر صندوق می‌تواند در صورت وجود شواهد و ارائه مستندات کافی ارزش سهم در پایان روز را به میزان حداکثر ۲۰ درصد افزایش یا کاهش دهد و قیمت تعدیل شده را مبنای محاسبه خالص ارزش فروش قرار دهد.

۴-۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت پذیرفته شده در بورس یا فرابورس:

خالص ارزش فروش اوراق مشارکت در هر روز با کسر کارمزد فروش از قیمت بازار آنها محاسبه می‌گردد.

۴-۱-۳- سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت و گواهی سپرده بانکی غیر بورسی یا غیر فرابورسی:

خالص ارزش فروش اوراق مشارکت غیربورسی در هر روز مطابق ساز و کار بازخرید آنها توسط ضامن، تعیین می‌شود.

۴-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری ها:

۴-۲-۱- سود سهام:

درآمد حاصل از سود سهام شرکت‌ها در زمان تصویب سود توسط مجمع عمومی صاحبان سهام شرکت‌های سرمایه‌پذیر شناسایی می‌شود. همچنین سود سهام متعلق به صندوق سرمایه‌گذاری به ارزش فعلی محاسبه و در حساب‌ها منعکس می‌گردد. برای محاسبه ارزش فعلی سود سهام تحقق یافته و دریافت نشده، مبلغ سود دریافتنی با توجه به برنامه زمانبندی پرداخت سود توسط شرکت سرمایه‌پذیر و حداکثر ظرف ۸ ماه با استفاده از نرخ سود علی الحساب سالانه آخرین اوراق مشارکت دولتی به علاوه ۵ درصد تنزیل می‌شود. تفاوت بین ارزش تنزیل شده و ارزش اسمی با گذشت زمان به حساب سایر درآمدها منظور می‌شود.

۴-۲-۲- سود سپرده بانکی و اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب:

سود تضمین شده اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب، سپرده و گواهی‌های سپرده بانکی بر اساس مدت زمان و با توجه به مانده اصل سرمایه‌گذاری شناسایی می‌شود. همچنین سود سپرده بانکی به طور روزانه با توجه به کمترین مانده وجوه در حساب سپرده و نرخ سود علی الحساب محاسبه می‌گردد. مبلغ محاسبه شده سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب، سپرده و گواهی سپرده بانکی با استفاده از نرخ سود همان اوراق و با در نظر گرفتن مدت باقی مانده تا دریافت سود با همان نرخ قبلی تنزیل شده و در حساب‌های صندوق سرمایه‌گذاری منعکس می‌شود.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۳-۴- محاسبه کارمزد ارکان و تصفیه:

کارمزد ارکان و تصفیه صندوق سرمایه‌گذاری به صورت روزانه به شرح جدول زیر محاسبه و در حسابها ثبت می‌شود:

عنوان هزینه	شرح نحوه محاسبه هزینه
هزینه‌های تأسیس	تا سقف ۱۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت به تایید متولی صندوق
هزینه‌های برگزاری مجامع صندوق	حداکثر تا مبلغ ۵۰ میلیون ریال برای برگزاری مجامع در طول یک سال مالی با ارائه مدارک مثبت به تایید متولی صندوق
کارمزد مدیر	سالانه ۰,۸ درصد از ارزش روزانه سهام و حق تقدم تحت تملک صندوق به علاوه ۰/۲ درصد از ارزش روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق و ۲ درصد از سود حاصل از گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی تا میزان نصاب مجاز سرمایه گذاری در آنها
کارمزد متولی	سالانه ۰,۵ درصد از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی‌های صندوق که حداقل ۱۰۰ میلیون ریال و حداکثر ۱۸۰ میلیون ریال است
حق الزحمه حسابرس	سالانه مبلغ ثابت ۱۶۶ میلیون ریال به ازای هر سال مالی است
حق الزحمه و کارمزد تصفیه مدیر صندوق	معادل ۰,۱ درصد ارزش خالص دارایی‌های صندوق در آغاز دوره اولیه تصفیه تا سقف ۱,۰۰۰ میلیون ریال
حق پذیرش و عضویت در کانون‌ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانون‌های مذکور، مشروط بر اینکه عضویت در این کانون‌ها طبق مقررات اجباری باشد یا عضویت به تصویب مجمع صندوق برسد.
هزینه دسترسی به نرم افزار، تارنما و سایت	هزینه ثابت: ۲۵۳,۷۰۶,۸۹۵ ریال با احتساب مالیات بر ارزش افزوده هزینه متغیر: به ازای هر NAV مازاد بر ۲ تا سقف ۵ مورد ۸۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال سالانه به مبلغ کل افزوده می‌شود. به ازای هر NAV مازاد بر ۵ مورد ۶۰,۰۰۰,۰۰۰ ریال سالانه به مبلغ کل افزوده می‌شود

۴-۴- بدهی به ارکان صندوق

با توجه به تبصره ۳ ماده ۴۳ اساسنامه، کارمزد مدیر، متولی هر سه ماه یک بار تا سقف ۹۰ درصد قابل پرداخت است. باقیمانده در پایان هر سال پرداخت می‌شود.

۴-۵- مخارج تأمین مالی

سود و کارمزد تسهیلات دریافتی از بانک‌ها و موسسات مالی و اعتباری و خرید اقساطی سهام، مخارج تأمین مالی را در بر می‌گیرد و در دوره وقوع به عنوان هزینه شناسایی می‌شود.

۴-۶- تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال

این تعدیلات به دلیل تفاوت در نحوه محاسبه قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری ایجاد می‌شود. برای محاسبه قیمت صدور واحدهای سرمایه‌گذاری کارمزد پرداختی بابت تحصیل دارایی مالی به ارزش خرید دارایی‌های مالی اضافه می‌شود. همچنین برای محاسبه قیمت ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری کارمزد معاملات و مالیات از قیمت فروش دارایی‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری کسر می‌شود. نظر به اینکه بر طبق تبصره ۲ ماده ۹ اساسنامه صندوق ارزش روز دارایی‌های صندوق برابر با قیمت ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری است، به دلیل آنکه داراییهای صندوق در خالص دارایی‌ها به ارزش روز اندازه‌گیری و ارائه می‌شود؛ لذا تفاوت قیمت صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری تحت عنوان

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

تعدیلات ناشی از قیمت صدور و ابطال منعکس می‌شود. همچنین مازاد ذخیره تصفیه تا سقف یک میلیارد ریال مطابق با ابلاغیه شماره ۱۲۰۲۰۱۷۳ مورخ ۱۳۹۹/۰۶/۱۸ طی سال مالی به تعدیلات قیمت صدور واحد های عادی منتقل می‌گردد.

۴-۷- تعهدات و شرایط بازارگردانی:

صندوق متعهد است که خرید و فروش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی را طبق مفاد بند ۲-۲ امیدنامه صندوق انجام دهد و یا در شرایط مشخص شده معاف از ایفای تعهدات است.

تعهدات بازارگردانی تعریف شده در بند ۱-۲-۲ امیدنامه و آخرین صورتجلسه مجمع صندوق به شرح جدول زیر است.

ردیف	نام شرکت	نماد	دامنه مظنه (درصد)	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه
۱	تولیدی فولاد سپید فراب کویر	کویر	۳	۱۳۸,۰۰۰	۲,۷۶۰,۰۰۰
۲	گروه صنایع کاغذ پارس	چکاپا	۳	۴۶۵,۰۰۰	۹,۳۰۰,۰۰۰

۴-۸- مبنای محاسبه تفکیکی خالص ارزش دارایی‌های جداگانه عملیات بازارگردانی:

کارمزد تصفیه: بر اساس نسبت خالص ارزش دارایی‌های هر یک از سرمایه‌گذاری ها به کل خالص ارزش دارایی‌ها صندوق به صورت روزانه محاسبه می‌شود.

کارمزد مدیر: بر اساس نسبت مانده خالص ارزش فروش هر یک از سرمایه‌گذاری ها به کل خالص ارزش فروش سرمایه‌گذاری به صورت روزانه محاسبه می‌شود.

کارمزد متولی: کل کارمزد روزانه به نسبت مساوی به هر یک از سرمایه‌گذاری های عملیات بازارگردانی تسهیم می‌شود.

کارمزد حسابرس: کل کارمزد روزانه به نسبت مساوی به هر یک از سرمایه‌گذاری های عملیات بازارگردانی تسهیم می‌شود.

۴-۹- وضعیت مالیاتی:

طبق قانون توسعه ابزارها و نمادهای مالی در راستای تسهیل اجرای کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی (مصوب در آذرماه ۱۳۸۸ مجلس شورای اسلامی) و به استناد تبصره یک ماده ۱۴۳ مکرر قانون مالیات های مستقیم تمامی درآمدهای صندوق های سرمایه گذاری در چارچوب این قانون و تمامی درآمدهای حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار موضوع ۲۴ ماده یک قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران مصوب ۱۳۸۴ و درآمدهای حاصل از نقل و انتقال این اوراق بادرآمدهای حاصل از صدور و ابطال آن ها از پرداخت مالیات بر درآمد و مالیات بر ارزش افزوده موضوع قانون مالیات بر ارزش افزوده مصوب ۲ خرداد ۱۳۸۷ معاف می باشد و از بابت نقل و انتقال آن ها و صدور و ابطال اوراق بهادار یاد شده مالیاتی مطالبه نخواهد گردید.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۵- موجودی نقد

موجودی نقد صندوق در تاریخ صورت خالص دارایی ها به شرح زیر است:

نام بانک	نوع حساب	شماره حساب	۱۴۰۰/۰۷/۳۰
حساب جاری-۱۰۰۱۰۰۰۲۹۷۰۸۵-بانک شهر	شهر	جاری	ریال
			۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع			۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰

۶- سایر حساب های پرداختنی و ذخایر

سایر حساب های پرداختنی و ذخائر در تاریخ صورت خالص دارایی ها به شرح زیر است:

یادداشت	۱۴۰۰/۰۷/۳۰
	ریال
۶-۱	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰

وجوه واریزی نامشخص

۶-۱ مانده حساب فوق مربوط به واریزی موسسین به حساب صندوق می‌باشد.

۷- تعهدات و بدهی های احتمالی

در تاریخ خالص دارایی‌ها، به استثنای تعهدات بند ۷ امیدنامه مربوط به بازارگردانی نمادهای "کویر" و "چکاپا" صندوق هیچگونه تعهدات و بدهی احتمالی ندارد.

۸- رویداد های بعد از تاریخ خالص دارایی‌ها

رویدادهایی که بعد از تاریخ خالص دارایی‌ها تا تاریخ تأیید صورت های مالی اتفاق افتاده، مستلزم تعدیل اقلام صورت های مالی و یا افشاء در یادداشت های توضیحی نبوده است. شایان ذکر است مطابق با صورتجلسه مجمع مورخ ۱۴۰۰/۰۹/۱۵، بازارگردانی نماد "کویر" و "چکاپا" به فهرست عملیات بازارگردانی صندوق اضافه گردید.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۹- کفایت سرمایه

بر اساس بند ۲ ماده دستورالعمل الزامات کفایت سرمایه نهادهای مالی مصوب ۱۳۹۰/۰۷/۳۰ هیات مدیره محترم سازمان بورس و اوراق بهادار و همچنین اصلاحات ارایه شده در صورتجلسه شماره ۳۰۴ مورخ ۱۳۹۲/۰۵/۰۵ هیات مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار، محاسبه نسبت کفایت سرمایه صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۷/۳۰ بر اساس تعهدات مندرج در امیدنامه صندوق به شرح زیر می باشد:

ردیف	شرح	ارقام بدون تعدیل	تعدیل شده برای محاسبه نسبت جاری	تعدیل شده برای محاسبه نسبت بدهی و تعهدات
۱	جمع دارایی جاری	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
۲	جمع دارایی غیر جاری	۰	۰	۰
۳	جمع کل دارایی ها	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
۴	جمع بدهی های جاری	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
۵	جمع بدهی های غیر جاری	۰	۰	۰
۶	جمع کل بدهی ها	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰
۷	جمع کل تعهدات	۶۹,۶۴۲	۳۴,۸۲۱	۳۴۸,۲۱۰
۸	جمع کل بدهی ها و تعهدات	۱۱۹,۶۴۲	۸۴,۸۲۱	۳۹۸,۲۱۰
۹	نسبت جاری	۰.۴۲	۰.۵۹	
۱۰	نسبت بدهی و تعهدات	۲.۳۹		۷.۹۶

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

یادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۱۰- تفکیک عملیات بازارگردانی

۱۰-۱- خالص دارایی ها به تفکیک عملیات بازارگردانی

داراییها:	کویبر	چکاپا	جمع کل
	۱۴۰۰/۰۷/۳۰	۱۴۰۰/۰۷/۳۰	
	ریال	ریال	ریال
موجودی نقد	۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع دارایی ها	۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
بدهی ها:			
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
جمع بدهی ها	۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
خالص دارایی ها	—	—	—
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	—	—	—

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش مالی میان دوره ای

پادداشت های توضیحی صورت مالی

دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰

۳-۱۰- گردش خالص دارایی ها به تفکیک عملیات بازارگردانی

صورت گردش خالص دارایی ها

جمع کل		چکاپ		کویر	
		دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰		دوره مالی ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۰	
		ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری
ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	ریال	تعداد واحدهای سرمایه گذاری
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) ابتدا دوره

واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی دوره مالی

واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی دوره مالی

سود خالص دوره مالی

تعدیلات

خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) در پایان دوره