



صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.ا. الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۰

مقدمه:

در اجرای مفاد ماده ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفند ماه ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدینوسیله گزارش درباره فعالیت و وضع عمومی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار برای دوره مالی ۳ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۰ برپایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح ذیل تقدیم می گردد. گزارش حاضر به عنوان یکی از گزارش های مبتنی بر اطلاعات ارائه شده در صورت های مالی بوده و اطلاعاتی را درخصوص وضع عمومی صندوق و عملکرد مدیر فراهم می آورد. به نظر اینجانبان اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تاکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد مدیر و در جهت حفظ منافع صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه گردیده است. این اطلاعات هماهنگ با واقعیت های موجود بوده و اثرات آنها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می توان پیش بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده کنندگان می شود، از گزارش حذف نگردیده است.

تاریخچه تأسیس صندوق :

صندوق سرمایه گذاری 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 شرکت ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران به منظور ایفای تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه گذاران است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود علاوه بر انجام عملیات بازارگردانی، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در زمینه های بند ۲-۲ مندرج در امیدنامه سرمایه گذاری می نماید. 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 نمی باشد.

آخرین وضعیت صندوق:

وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۷۷۴,۲۱۰	۷۷۳,۰۴۸	۱۸۲,۱۴۶	کوبر
۱,۰۱۰,۹۰۸	۱,۰۱۰,۹۰۷	۲۰,۰۰۰	چکاپا
۷۹۷,۶۲۹	۷۹۶,۵۸۲	۲۰۲,۱۴۶	تجمیعی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۰

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹	۶۶.۳۷
نقد و بانک	۷۱,۰۵۳,۴۸۱,۵۵۱	۳۳.۵۲
سایر دارایی ها	۲۴۵,۴۶۶,۰۹۷	۰.۱۲
جمع	۲۱۱,۹۹۳,۴۲۶,۵۸۷	۱۰۰

ترکیب دارایی های موضوع بازارگردانی صندوق:

ترکیب دارایی های موضوع بازارگردانی صندوق به شرح زیر است:

ردیف	دارایی	ارزش روز کل (ریال)	درصد از کل دارایی ها
۱	تولیدی فولاد سپید فراب کویر (کویر)	۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹	۶۶.۳۶
۲	گروه صنایع کاغذ پارس (چکاپا)	-	-
جمع		۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹	۶۶.۳۶

تعهدات صندوق:

ردیف	سهم موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل معاملات روزانه	حداقل حجم سفارش انباشته	دامنه مظنه
۱	تولیدی فولاد سپید فراب کویر	کویر	۲,۷۶۰,۰۰۰	۱۳۸,۰۰۰	۳٪
۲	گروه صنایع کاغذ پارس	چکاپا	۹,۳۰۰,۰۰۰	۴۶۵,۰۰۰	۳٪

حجم معاملات سهام موضوع بازارگردانی صندوق (طی دوره ۳ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۰/۱۰/۱۴۰۰)

سهم	خرید			فروش			درصد از کل معاملات
	تعداد	مبلغ کل (میلیارد ریال)	میانگین بهای خرید	تعداد	مبلغ کل (میلیارد ریال)	میانگین بهای خرید	
کویر	۳۶,۲۷۹,۶۹۳	۱۸۲	۴,۸۴۱	-	-	-	۱۰.۰۵٪
جمع	۳۶,۲۷۹,۶۹۳	۱۸۲	۴,۸۴۱	-	-	-	۱۰.۰۵٪