



صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.ا. الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

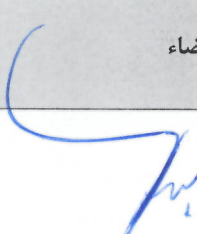
دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۱

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 ۶ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۱ فروردین 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 و در تاریخ ۱۴۰۱/۰۲/۲۵ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
مدیر	سبذگردان سرآمد بازار	بهروز زارع	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۱

تاریخچه تأسیس صندوق :

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار با شناسه ملی ۱۴۰۱۰۳۸۴۸۴۶ در تاریخ ۱۴۰۰/۰۸/۲۹ 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، 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. همچنین اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی سهام در بازار معاملات آتی بورس اوراق بهادار تهران صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسانات قیمت سهام است. 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. همچنین با توجه به تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکتها در تاریخ ۱۴۰۰/۰۷/۱۸ و اخذ مجوز فعالیت از سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۴۰۰/۰۹/۱۵، صورت های مالی فاقد اقلام مقایسه ای است.

آخرین وضعیت صندوق:

وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۸۰۱,۳۸۶	۸۰۰,۳۳۶	۱۸۲,۱۴۶	کویر
۱,۲۰۲,۶۶۱	۱,۲۰۰,۹۸۵	۳۰۰,۴۲۹	چکاپا
۱,۴۰۹,۷۶۲	۱,۴۰۷,۹۹۰	۱,۲۲۷,۸۷۲	سپید
۱,۳۰۸,۶۰۰	۱,۳۰۶,۹۲۱	۱,۷۱۰,۴۴۷	تجمیعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۱,۸۲۸,۶۵۵,۴۷۱,۴۲۲	۸۱,۵۹
نقد و بانک	۱۲,۱۸۲,۵۵۱,۵۹۱	۱۴,۲۹
صندوق های سرمایه گذاری	۳۲۰,۱۹۷,۴۵۸,۲۹۶	۰,۵۴
سایر دارایی ها	۸۰,۱۴۵,۳۷۳,۸۷۱	۳,۵۸
جمع	۲,۲۴۱,۱۸۰,۸۵۵,۱۸۰	۱۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۱

ترکیب دارایی‌های موضوع بازارگردانی صندوق:

ترکیب دارایی‌های موضوع بازارگردانی صندوق به شرح زیر است:

ردیف	دارایی	ارزش روز کل (ریال)	درصد از کل دارایی‌ها
۱	تولیدی فولاد سپید فراب کویر (کویر)	۱۲۰,۷۴۹,۶۲۲,۰۶۲	۵,۳۹
۲	گروه صنایع کاغذ پارس (چکاپا)	۳۳۰,۰۰۰,۸۷۸,۲۲۲	۱۴,۷۲
۳	سپید ماکیان (سپید)	۱,۳۷۷,۹۰۴,۹۷۱,۱۳۸	۶۱,۴۸
	جمع	۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹	۸۱,۵۹

تعهدات صندوق:

ردیف	سهام موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	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٪
۳	سپید ماکیان	سپید	۲,۹۸۰,۰۰۰	۱۴۹,۰۰۰	۳٪

حجم معاملات سهام موضوع بازارگردانی صندوق (طی دوره ۹ ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱)

سهام	خرید			فروش			ارزش کل معاملات هر نماد در بازار (ریال)
	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای خرید	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای خرید	
کویر	۳۳,۲۳۲,۴۳۵	۱۵۶,۱۸۱,۸۰۷,۰۶۱,۰۰	۴,۷۰۰	۱۳,۷۳۷,۳۲۶	۵۱,۵۱۸,۴۳۳,۶۹۶	۳,۷۵۰	۲,۷۵۸,۲۳۳,۵۱۳,۲۰۸
چکاپا	۵۱,۷۲۷,۰۸۴	۱۴۲,۳۹۸,۵۵۴,۹۱۴	۲,۷۵۳	۷,۳۱۶,۱۲۳	۳۱,۰۴۸,۷۲۹,۸۶۴	۲,۸۷۷	۳,۲۶۸,۹۶۳,۴۶۰,۴۹۱
سپید	۱۷,۳۸۵,۲۷۹	۳۴۲,۱۴۴,۴۴۱,۳۴۰	۱۹,۶۸۰	۱۳,۰۹۸,۴۲۷	۲۶۲,۸۰۰,۹۳۷,۸۰۰	۲۰,۰۶۳	۷,۱۰۵,۱۳۶,۹۳۵,۹۸۰
جمع	۱۰۲,۳۴۴,۷۹۸	۶۴۰,۷۲۴,۸۰۳,۳۱۵	-	۳۴,۱۵۱,۸۷۶	۳۳۵,۳۶۸,۱۰۱,۳۶۰	-	۱۳,۱۳۲,۳۳۳,۹۰۹,۶۷۹