



صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماه و ۱۲ روزه شهری به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۱ تیر 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 ۹ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۱ 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 ۱۴۰۱/۰۵/۳۰ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۱ تیر 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 ۱۴۰۱/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۸۸۱،۰۷۶	۸۸۰،۱۷۲	۱۸۲،۱۴۶	کویر
۱،۰۲۷،۰۴۲	۱،۰۲۵،۶۳۴	۳۰۰،۴۲۹	چکاپا
۱،۳۲۴،۹۷۹	۱،۳۲۳،۱۴۸	۱،۲۵۵،۰۷۶	سپید
۱،۲۲۶،۹۳۷	۱،۲۲۵،۲۷۵	۱،۷۳۷،۶۵۱	تجمیعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۱،۸۸۱،۴۹۰،۳۲۱،۰۴۰	۸۷،۸
نقد و بانک	۳۰،۷۹۵،۱۷۹،۳۰۷	۱،۵
صندوق های سرمایه گذاری	۱۵۰،۱۲۴،۲۹۱،۴۷۵	۷
سایر دارایی ها	۷۹،۵۸۹،۷۶۴،۲۲۵	۳،۷
جمع	۲،۱۴۱،۹۹۹،۵۵۶،۰۴۷	۱۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماه و ۱۲ روزه منتهی به ۳۱ تیر 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)	۱۰۱,۹۷۳,۰۱۲,۲۸۶	۴,۸٪
۲	گروه صنایع کاغذ پارس (چکاپا)	۲۷۷,۱۰۵,۱۲۶,۴۴۶	۱۲,۹٪
۳	سپید ماکیان (سپید)	۱,۵۰۲,۴۱۲,۱۸۲,۳۰۸	۷۰,۱٪
	جمع	۱,۸۸۱,۴۹۰,۳۲۱,۰۴۰	۸۷,۸٪

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٪

*بر اساس نامه مجوز شرکت بورس اوراق بهادار به شماره ۱۸۱/۱۱۰۷۸۴ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۲ و همچنین مصوبات صورت جلسه مجمع مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۳، عملیات بازارگردانی نماد "کویر" خاتمه یافت و نماد مذکور از فهرست عملیات بازارگردانی صندوق حذف گردید.

حجم معاملات سهام موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعاتی آغاز بازارگردانی هر نماد به صورت مجزا)

تا تاریخ ۱۴۰۱/۰۴/۳۱

سهام	خرید			فروش			ارزش کل معاملات هر نماد در بازار (ریال)
	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای خرید	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای فروش	
کویر	۴۶,۹۶۱,۷۹۷	۲۱۸,۸۰۹,۸۴۷,۰۸۰	۴,۶۵۹	۳۴,۶۸۰,۰۱۳	۱۴۴,۵۴۴,۱۹۷,۴۹۶	۴,۱۶۸	۷,۷۲۵,۶۹۸,۴۵۲,۴۷۸
چکاپا	۵۸,۹۶۲,۷۴۸	۱۶۵,۵۲۷,۵۱۵,۵۵۸	۲,۸۰۷	۱۴,۸۶۵,۱۹۳	۴۴,۶۷۱,۳۰۷,۲۶۴	۳,۰۰۵	۷,۵۸۹,۹۸۲,۶۶۷,۱۶۰
سپید	۵۱,۷۱۴,۰۵۷	۱,۱۳۲,۷۲۴,۳۳۳,۶۰۲	۲۱,۹۰۳	۳۳,۳۶۳,۰۹۹	۷۵۹,۶۸۰,۳۹۸,۲۵۳	۲۲,۷۷۰	۲۰,۳۵۴,۵۲۸,۳۰۶,۳۲۰
جمع	۱۵۷,۶۳۸,۶۰۲	۱,۵۱۷,۰۶۱,۶۹۶,۲۴۰	—	۸۲,۹۰۸,۳۰۵	۹۴۸,۸۹۵,۹۰۳,۰۱۳	—	۳۵,۶۷۰,۲۰۹,۴۲۵,۹۵۸