

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویت تم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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 ۳ ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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 ۱۴۰۱/۰۷/۳۰ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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 ۱۴۰۱/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۹۳۰,۲۴۹	۹۲۹,۱۱۰	۳۳۰,۴۴۵	چکاپا
۹۳۰,۲۴۹	۹۲۹,۱۱۰	۳۳۰,۴۴۵	تجمیعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷	۷۸.۶۳
نقد و بانک	۴۴,۲۸۸,۸۰۱,۶۱۶	۱۴.۲۴
صندوق های سرمایه گذاری	۲۲,۰۰۱,۷۴۲,۵۳۹	۷.۰۷
سایر دارایی ها	۱۹۰,۱۷۹,۵۲۹	۰.۰۶
جمع	۳۱۱,۰۲۸,۰۷۸,۱۴۱	۱۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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	گروه صنایع کاغذ پارس (چکاپا)	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷	۷۸.۶۳
	جمع	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷	۷۸.۶۳

تعهدات صندوق:

ردیف	سهام موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
۱	تولیدی فولاد سپید فراب کویر	کویر	۱۳۸,۰۰۰	۲,۷۶۰,۰۰۰	۳٪
۲	گروه صنایع کاغذ پارس	چکاپا	۴۶۵,۰۰۰	۹,۳۰۰,۰۰۰	۳٪
۳	سپید ماکیان	سپید	۱۴۹,۰۰۰	۲,۹۸۰,۰۰۰	۳٪

*بر اساس نامه‌های مجوز شرکت بورس اوراق بهادار به شماره ۱۸۱/۱۱۰۷۸۴ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۲، ۱۴۰۱/۰۴/۱۲، ۱۸۱/۱۲۴۵۸ مورخ ۱۴۰۱/۰۵/۰۵ و ۱۸۱/۱۱۳۹۲۳ مورخ ۱۴۰۱/۰۶/۰۱، عملیات بازارگردانی نمادهای "کویر"، "چکاپا" و "سپید" خاتمه یافت و نمادهای مذکور از فهرست عملیات بازارگردانی صندوق حذف گردیدند.

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

تا تاریخ ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

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	
چکاپا	۹۳۰,۰۰۰	۲,۳۸۴,۴۶۶,۹۴۴	۲,۵۶۳	۹۳۰,۰۰۰	۲,۳۹۵,۰۵۸,۰۲۷	۲,۵۷۵	۲,۳۷۵,۳۲۳,۱۸۶,۳۰۷
سپید	۱,۶۷۸,۰۴۸	۳۱,۹۵۹,۴۰۹,۶۸۴	۱۹,۰۳۰	۱,۲۵۷,۴۱۷	۲۴,۲۳۰,۵۷۶,۵۲۳	۱۹,۱۶۲	۳,۰۹۹,۳۷۸,۳۸۹,۵۱۰
جمع	۲,۶۰۸,۰۴۸	۳۴,۳۴۳,۸۷۶,۶۲۸	-	۲,۱۸۷,۴۱۷	۲۶,۶۲۵,۶۳۴,۵۵۰	-	۵,۴۷۴,۷۰۱,۵۷۵,۸۱۷