

مندوق سرمایه‌گذاری ا.ب الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۲

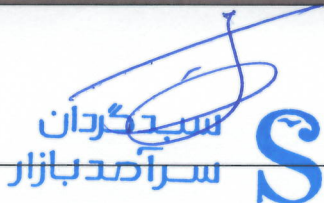
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۲

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 سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۲ 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 ۱۴۰۲/۰۵/۲۳ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
مدیر	سبدگردان سرآمد بازار	امیر حمزه المیر	 سبدگردان سرآمد بازار

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۲

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 شرکتها و مؤسسات 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.

آخرین وضعیت صندوق:

وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۹۳۸,۱۶۵	۹۳۷,۷۹۶	۵۰,۰۱۶	چکاپا
۹۳۸,۱۶۵	۹۳۷,۷۹۶	۵۰,۱۶	تجمیعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	-	۰٪
نقد و بانک	۳۷,۱۴۶,۱۰۳	۰.۰۷٪
صندوق های سرمایه گذاری	۴۹,۱۴۲,۲۲۶,۱۴۰	۹۶.۵۰٪
سایر دارایی ها	۱,۷۴۲,۶۱۷,۳۱۰	۳.۴۲٪
جمع	۵۰,۹۲۱,۹۸۹,۵۵۳	۱۰۰٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۲

تعهدات صندوق:

ردیف	سهام موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مغتنه
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٪
۴	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۱۶۵,۰۰۰	۳,۲۸۱,۰۰۰	۳٪
۵	صندوق سرمایه گذاری اعتماد ارغوان	آلا	۱۲۵,۰۰۰	۲,۵۰۰,۰۰۰	۱٪

*بر اساس نامه‌های مجوز شرکت بورس اوراق بهادار به شماره ۱۸۱/۱۱۰۷۸۴ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۲، ۱۴۰۱/۰۴/۱۲، ۱۸۱/۱۱۲۴۵۸ 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.

* دو نماد "خکرمان" و "آلا" در فرآیند دریافت تأیید بازارگردانی از شرکت فرابورس می‌باشند.

حجم معاملات سهام موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعات آغاز بازارگردانی هر نماد به صورت مجزا تا تاریخ

تصفیه نمادها)

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	۶,۸۸۲,۳۲۰,۰۲۵,۸۴۳
سپید	۱,۶۷۸,۰۴۸	۳۱,۹۵۹,۴۰۹,۶۸۴	۱۹,۰۴۵	۱,۲۵۷,۴۱۷	۲۴,۲۳۰,۵۷۶,۵۲۳	۱۹,۲۷۰	۸,۷۸۱,۷۳۸,۰۳۱,۸۵۰
جمع	۲,۶۰۸,۰۴۸	۳۴,۳۴۳,۸۷۶,۶۲۸	-	۲,۱۸۷,۴۱۷	۲۶,۶۲۵,۶۳۴,۵۵۰	-	۱۵,۶۶۴,۰۵۸,۰۵۷,۶۹۳