

مندوق سرمایه‌گذاری ا.ب الکویرتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه مالی منتهی به ۳۰ مهرماه 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 دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهرماه 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 آن ها 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 ۱۴۰۲/۰۸/۲۷ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	امیر حمزه مال میر	سیدگردان سرآمد بازار	مدیر



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه مالی منتهی به ۳۰ مهرماه 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 ۱۴۰۲/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۹۷۷,۱۳۳	۹۷۵,۷۶۲	۶۸۰,۵۷۴	خکرمان
۱,۰۴۹,۴۳۰	۱,۰۴۹,۳۵۸	۳,۰۰۰	آا
۹۷۷,۴۵۱	۹۷۶,۰۸۵	۶۸۳,۵۷۴	تجمعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۶۲۶,۷۵۳,۸۰۹,۴۰۵	۹۳.۴۴%
نقد و بانک	۳۹,۵۷۶,۲۱۰,۲۹۹	۵.۹۰%
صندوق های سرمایه گذاری	۲,۸۳۹,۶۷۵,۵۴۰	۰.۴۲%
سایر دارایی ها	۱,۵۵۸,۸۲۳,۲۶۵	۰.۲۳%
جمع	۶۷۰,۷۲۸,۵۱۸,۵۰۹	۱۰۰%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه مالی منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۴۰۲

تعهدات صندوق:

ردیف	سهام موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل حجم سفارشی انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
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٪

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

صورت مالی)

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	
خکرمان	۵,۵۵۳,۲۵۱	۲۷,۰۲۰,۶۰۸,۲۴۸	۴,۸۵۳	۲,۷۸۳,۵۳۰	۱۳,۷۱۱,۳۹۷,۷۳۸	۴,۹۲۹	۶۵۲,۱۱۱,۷۹۹,۵۳۳
جمع	۵,۵۵۳,۲۵۱	۲۷,۰۲۰,۶۰۸,۲۴۸	۴,۸۵۳	۲,۷۸۳,۵۳۰	۱۳,۷۱۱,۳۹۷,۷۳۸	۴,۹۲۹	۶۵۲,۱۱۱,۷۹۹,۵۳۳

حجم معاملات صندوق سرمایه گذاری موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعاتی آغاز بازارگردانی هر نماد به صورت

مجزا تا تاریخ صورت مالی)

صندوق سرمایه گذاری	خرید			فروش			ارزش کل معاملات هر نماد در بازار (ریال)
	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای خرید	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بهای فروش	
آلا	۵۶,۸۴۴,۵۰۶	۶۰۰,۴۲۱,۷۶۹,۸۳۱	۱۰,۵۶۳	۱۴۰,۸۷۲,۱۲۲	۱,۴۸۹,۰۰۸,۵۸۶,۶۴۶	۱۰,۵۷۰	۲,۶۴۷,۵۲۳,۷۵۲,۸۰۳
جمع	۵۶,۸۴۴,۵۰۶	۶۰۰,۴۲۱,۷۶۹,۸۳۱	۱۰,۵۶۳	۱۴۰,۸۷۲,۱۲۲	۱,۴۸۹,۰۰۸,۵۸۶,۶۴۶	۱۰,۵۷۰	۲,۶۴۷,۵۲۳,۷۵۲,۸۰۳