

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویت تم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه مالی منتهی به ۳۰ دی 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 دوره مالی شش ماه منتهی به ۳۰ دی ماه 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 ۱۴۰۲/۱۱/۲۵ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

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

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه مالی منتهی به ۳۰ دی 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 ۱۴۰۲/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ انقضا	تعداد واحدهای سرمایه	نماد
۱,۰۱۹,۴۷۸	۱,۰۱۸,۰۴۵	۶۸۰,۵۷۴	خکرمان
۲,۳۸۸,۸۵۸	۲,۳۸۸,۶۹۷	۱۹,۰۸۰	آلا
۱,۰۵۶,۸۲۲	۱,۰۵۵,۴۲۴	۶۹۹,۶۵۴	تجمعی

ترکیب دارایی های صندوق:

ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

شرح	مبلغ (ریال)	درصد از کل دارایی های صندوق
سهام و حق تقدم	۶۳۹,۰۸۵,۱۸۶,۳۴۲	۸۵.۲۴
نقد و بانک	۱,۹۲۹,۴۷۷,۹۹۰	۰.۲۶
صندوق های سرمایه گذاری	۱۰۴,۲۵۸,۴۳۳,۹۹۵	۱۳.۹۱
حساب های دریافتی	۳,۶۰۴,۹۹۹,۱۵۲	۰.۴۸
سایر دارایی ها	۸۴۱,۱۱۲,۳۴۲	۰.۱۱
جمع	۷۴۹,۷۱۹,۲۱۴,۸۲۱	۱۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه مالی منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

تعهدات صندوق:

ردیف	اوراق بهادار موضوع بازارگردانی	نماد	حداقل حجم سفارش اثبات شده	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
۱	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۱۴۱,۴۰۰	۲,۸۲۸,۰۰۰	۲.۵٪
۲	صندوق سرمایه گذاری اعتماد ارغوان	آلا	۲۵۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰	۱٪
۳	اوراق سلف موازی استاندارد کرمان خودرو	عکرمان ۲	۱۲۴,۲۰۰	۶۲۱,۰۰۰	۲٪

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

تاریخ صورت مالی)

نماد	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	۲۶,۱۸۷,۴۶۴	۱۳۷,۲۰۸,۰۷۹,۰۶۳	۵,۲۳۹	۲۶,۶۴۱,۴۳۴	۱۴۳,۷۲۵,۸۳۰,۳۰۴	۵,۳۹۵	۸,۳۹۳,۹۳۳,۳۲۳,۵۱۴
آلا	۱,۱۵۰,۱۲۶,۱۵۶	۱۲,۵۴۱,۷۸۱,۲۷۳,۵۴۷	۱۰,۹۰۵	۱,۱۴۶,۶۱۳,۵۸۸	۱۲,۵۲۰,۳۷۰,۳۳۷,۶۸۷	۱۰,۹۱۹	۱۳,۲۳۴,۹۵۹,۴۹۸,۲۵۹
جمع	۱,۱۷۶,۳۱۳,۶۲۰	۱۲,۶۷۸,۹۸۹,۳۵۲,۶۱۰	*	۱,۱۷۳,۲۵۵,۰۲۲	۱۲,۶۶۴,۰۹۶,۱۶۷,۹۹۱	*	۲۱,۶۲۸,۸۹۲,۸۲۱,۷۷۳