

مندوق سریاله گذاری ا.ب الکوریتم سرآمد بازار

گزارش عکس

دوره مالی شش ماهه هی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره ششم 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 اینجانب اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می باشد، با تأکید 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 مالمیر	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره ششم ماهه مالی منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

تاریخچه تأسیس صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار با شناسه ملی ۱۴۰۱۰۳۸۴۸۶ 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، جمجمه‌گردانی سرمایه از سرمایه‌گذاران به منظور ایفای تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، پهنه‌گیری از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود علاوه بر انجام عملیات بازارگردانی، بیشترین بازدهی ممکن نسبت سرمایه‌گذاران 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 زمینه‌های بند ۲-۲ مندرج در امیدنامه سرمایه‌گذاری می‌نماید. 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 نمی‌باشد.

آخرین وضعیت صندوق:

وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

نحوه ساخت صندوق	تعداد واحدهای سرمایه	مقدار	توضیحات
خرکمان	۶۸۰,۵۷۴	۱,۰۱۸,۰۴۵	۱,۰۱۹,۴۷۸
آل	۱۹,۰۸۰	۲,۳۸۸,۶۹۷	۲,۳۸۸,۸۵۸
تحصیعی	۶۹۹,۷۵۴	۱,۰۵۵,۴۲۴	۱,۰۵۳,۸۲۳

ترکیب دارایی‌های صندوق:

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

درصد از کل دارایی‌های صندوق	مبلغ (ریال)	شرح
۸۵.۲۴	۶۳۹,۰۸۵,۱۸۶,۳۴۲	سهام و حق تقدم
۰.۲۶	۱,۹۲۹,۴۷۷,۹۹۰	نقد و بانک
۱۳.۹۱	۱۰۴,۲۵۸,۴۳۳,۹۹۵	صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۰.۴۸	۳,۶۰۴,۹۹۹,۱۵۲	حساب‌های دریافتی
۰.۱۱	۸۴۱,۱۱۷,۳۴۲	سایر داری‌ها
۱۰۰	۷۴۹,۷۱۹,۲۱۴,۸۲۱	جمع

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازار گردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره ششم ماهه مالی منتهی به ۳۰ دیماه ۱۴۰۲

تعهدات صندوق:

ردیف	اوراق بیهاده موضوع با ارگانی	ساد	حداقل معاملات روزانه	ساد	حداقل حجم سودمندی انسانی	حداقل حجم سودمندی انسانی	دسته همظمه
۱	سرمایه گذاری آمان گستر پاریز	خرمکان	۱۴۱,۴۰۰	۲,۸۲۸,۰۰۰	۲,۸۲۸,۰۰۰	۲,۸۲۸,۰۰۰	۲,۵%
۲	صندوق سرمایه گذاری اعتماد ارغوان	آل	۲۵۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰	۱%
۳	اوراق سلف موازی استاندار کرمان خودرو	عکرمان	۱۲۴,۲۰۰	۶۲۱,۰۰۰	۶۲۱,۰۰۰	۶۲۱,۰۰۰	%۲

حجم معاملات اوراق بیهاده موضوع بازار گردانی صندوق (بر اساس اطلاعیه آغاز بازار گردانی هر نماد به صورت مجزا تا

(تاریخ صورت مالی)

نماد	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین خرید	خرید				تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین فروش	فروش	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بها	بها	میانگین	در بازار (ریال)	ارزش کل معاملات هر نماد	
				خرید	تعداد	مبلغ کل (ریال)	میانگین بها												
خرمکان	۲۶,۱۸۷,۴۶۴	۱۳۷,۲۰۸,۰۷۹,۰۶۳	۵,۱۳۹	۲۶,۶۴۱,۴۳۴	۲۶,۶۴۱,۴۳۴	۱۴۳,۷۲۵,۸۳۰,۳۰۴	۵,۳۹۵	۸,۳۹۳,۹۳۳,۳۲۳,۵۱۴	۵,۳۹۵	۱۴۳,۷۲۵,۸۳۰,۳۰۴	۱۴۳,۷۲۵,۸۳۰,۳۰۴	۱۰,۹۱۹	۱۲,۵۲۰,۳۷,۰۳۷,۶۸۷	۱,۱۴۶,۶۱۳,۵۸۸	۱,۱۴۶,۶۱۳,۵۸۸	۱,۱۴۶,۶۱۳,۵۸۸	۱,۱۴۶,۶۱۳,۵۸۸	۱۲,۲۲۴,۹۵۹,۴۹۶,۲۵۹	۱۲,۲۲۴,۹۵۹,۴۹۶,۲۵۹
آل	۱,۱۵۰,۱۲۶,۱۵۶	۱۲,۵۴۱,۷۸۱,۲۷۳,۵۴۷	۱,۰۹۰۵	۱,۱۷۳,۲۵۵,۰۲۲	*	۱۲,۶۷۸,۹۸۹,۳۵۲,۶۱۰	*	۲۱,۶۲۸,۸۹۲,۸۲۱,۷۷۳	*	۱۲,۶۷۸,۹۸۹,۳۵۲,۶۱۰	۱۲,۶۷۸,۹۸۹,۳۵۲,۶۱۰	۱,۱۷۶,۳۱۳,۶۲۰	جمع						