

مندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویت تم سرآمد بازار
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۳

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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۳ برپایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح ذیل تقدیم می‌گردد. گزارش حاضر به عنوان یکی از گزارش‌های مبتنی بر اطلاعات ارائه شده در صورت‌های مالی بوده و اطلاعاتی را درخصوص وضع عمومی صندوق و عملکرد مدیر فراهم می‌آورد. به نظر اینجانبان اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضع عمومی صندوق می‌باشد، 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 واقعیت‌های موجود بوده و اثرات آن‌ها در آینده تا حدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش‌بینی نمود، به نحو درست و کافی در این گزارش ارائه گردیده و هیچ موضوعی که عدم آگاهی از آن موجب گمراهی استفاده‌کنندگان می‌شود، از گزارش حذف نگردیده و در تاریخ ۱۴۰۳/۰۲/۲۹ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	سعید رضوانی فرد	سبدگردان سرآمد بازار	مدیر

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۳

تاریخچه تأسیس صندوق :

صندوق سرمایه‌گذاری 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، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران به منظور ایفای تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری 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 نصیب 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 ۱۴۰۳/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	خالص ارزش کل دارایی های صندوق
۲,۳۴۲,۲۰۵	۲,۹۳۰,۰۷۰,۵۴۰,۸۵۹

NAV به تفکیک نماد

نماد	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	خالص ارزش روز دارایی
آا	۱۹,۰۸۰	۳۸,۴۶۵,۹۶۶,۷۲۲
خکرمان	۶۸۰,۵۷۴	۶۶۲,۰۷۲,۹۶۹,۵۱۰
کرمان ۵۱۲۱	۱۱۳,۳۰۹	۱۶۵,۰۸۷,۲۶۳,۵۸۷
عکرمان ۲	۱,۴۷۲,۱۲۰	۲,۰۶۴,۴۴۴,۳۴۱,۰۴۰

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۵۴۲,۷۷۱,۲۵۴	۰,۰۲٪
جاری کارگزاران	۹۰۵,۰۶۳,۶۶۳,۶۵۳	۲۵,۳۵٪
سایر حساب های دریافتنی	۷۶۴,۳۱۱,۱۰۵,۸۲۸	۲۱,۴۱٪
سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۸۲۳,۳۸۳,۷۳۶,۶۸۹	۲۳,۰۷٪
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم شرکتها	۶۵۶,۸۸۳,۵۵۹,۷۹۰	۱۸,۴۰٪
مخارج انتقالی به دوره های آتی	۳,۰۳۱,۰۱۹,۶۸۵	۰,۰۸٪
سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری	۴۱۶,۴۴۳,۲۴۸,۳۶۱	۱۱,۶۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۳

تعهدات صندوق:

اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارشی انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۹۵،۹۰۰	۱،۹۱۸،۰۰۰	۲٪
صندوق سرمایه‌گذاری اعتماد ارغوان	آلا	۲۵۰،۰۰۰	۵،۰۰۰،۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد کرمان خودرو	عکرمان ۲	۱ درصد از حجم کل اوراق	۵ درصد از حجم کل اوراق	۲٪
اوراق مربحه کرمان موتور	۵،۱۲۱	۵۰۰۰	۴۰۰	۱٪

*بر اساس نامه‌های مجوز شرکت بورس اوراق بهادار به شماره ۱۸۱/۱۱۰۷۸۴ مورخ 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 که در دوره های قبل در فهرست نمادهای صندوق بوده اند از فهرست عملیات بازارگردانی صندوق حذف شدند.