

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویت تم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۳

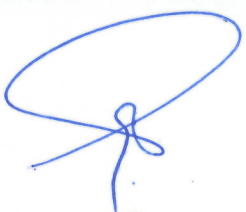
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر 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 سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه 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 ۱۴۰۳/۰۵/۳۰ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
مدیر	سیدگردان کارآمد	سید محمدهادی رضوی	

کارآمد
سیدگردان

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر 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 ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه
۱.۳۸۰.۷۴۹	۱.۳۸۰.۱۲۵	۱.۹۸۸.۰۸۴

NAV به تفکیک نماد

نماد	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
صندوق س. اعتماد ارغوان	۱,۹۱۱,۰۲۰	۱,۹۱۰,۹۰۵	۱۹,۲۱۴	۳۶,۷۱۶,۱۳۴,۶۶۱
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور	۱,۷۳۱,۰۲۳	۱,۷۳۰,۴۳۹	۵۹,۴۹۸	۱۰۲,۹۵۷,۶۶۶,۹۴۸
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	۹۱۱,۷۶۱	۹۱۰,۳۷۴	۶۸۰,۵۷۴	۶۱۹,۵۷۷,۳۳۴,۴۷۸
سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور	۱,۶۱۵,۲۴۸	۱,۶۱۵,۰۳۶	۱,۲۲۸,۷۹۸	۱,۹۸۴,۵۵۴,۱۴۵,۱۶۵
جمع				۲,۷۴۳,۸۰۵,۲۸۱,۲۵۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۹۴۰,۳۷۲,۹۵۴,۹۸۳	۲۶.۵۷
دریافتنی تجاری	۱,۰۰۸,۲۹۳,۵۹۴,۳۵۶	۲۸.۴۸
اوراق با درآمد ثابت	۹۱۰,۵۶۶,۷۱۳,۱۳۷	۲۵.۷۲
سهام و حق تقدم	۶۳۴,۰۵۵,۸۹۱,۱۳۳	۱۷.۹۱
صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۴۴,۵۴۱,۴۷۴,۳۴۴	۱.۲۶
جمع کل	۳,۵۳۹,۸۸۱,۱۳۵,۲۳۷	۱۰۰

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، ۱۴۰۱/۱۱۲۴۵۸ مورخ ۱۴۰۱/۰۵/۰۵ و ۱۴۰۱/۱۱۳۹۲۳ 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.