

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.ا. الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۳

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	سبدگردان کارآمد	سید محمد هادی رضوی	 

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 شده 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 ۱۴۰۶/۰۴/۳۰ 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

تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۹۸۸,۰۸۴	۱,۳۸۰,۱۲۵	۱,۳۸۰,۷۴۹

NAV به تفکیک نماد

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
صندوق سرمایه‌گذاری اعتماد ارغوان	۱,۹۱۱,۰۲۰	۱,۹۱۰,۹۰۵	۱۹,۲۱۴	۳۶,۷۱۶,۱۳۴,۶۶۱
اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور	۱,۷۳۱,۰۲۳	۱,۷۳۰,۴۳۴	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

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
دریافتی تجاری	۱,۰۱۰,۴۳۳,۲۳۷,۱۳۹	۲۴,۴۸
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۹۱۰,۵۶۶,۷۱۳,۱۳۷	۲۵,۷۲
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکتها	۶۲۴,۰۵۵,۸۹۱,۱۳۳	۱۷,۹۱
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۴۱۶,۴۴۳,۲۴۸,۳۶۱	۱,۲۶
جمع کل	۳,۵۲۹,۸۸۱,۱۳۵,۲۳۷	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش 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 مرابحه کرمان موتور	۵,۱۲۱	۵۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪

حجم معاملات اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعاتیه آغاز بازارگردانی هر نماد به صورت

مجزا تا تاریخ صورت مالی)

ارزش کل معاملات هر نماد در بازار (ریال)	فروش			خرید			
	میانگین بهای فروش	مبلغ کل (ریال)	تعداد	میانگین بهای خرید	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۴۳,۲۱۱,۶۶۴,۵۴۸,۵۸۲	۱۱,۷۷۳	۳۳,۶۶۳,۴۴۹,۴۷۰,۶۸۱	۲,۸۵۹,۴۱۶,۰۶۸	۱۱,۶۵۷	۳۳,۶۸۸,۱۳۷,۴۷۴,۴۹۶	۲,۸۶۱,۶۴۰,۷۲۵	صندوق س اعتماد ارغوان
۲,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	.	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰	اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور
۱۲,۶۸۸,۱۳۷,۴۷۴,۴۹۶	۵,۲۱۵	۱۸۵,۰۲۳,۰۶۷,۳۸۶	۳۵,۰۶۷,۵۲۰	۵,۱۰۵	۲۴۰,۷۸۲,۶۰۰,۷۵۱	۴۷,۵۳۸,۹۴۸	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز
۱۹,۷۹۸,۱۸۱,۳۷۴,۷۳۸	۱,۴۵۸,۶۶۷	۸۴,۳۷۶,۸۹۹,۹۸۰	۵۸,۱۰۰	۱,۵۰۴,۸۱۰	۸۸۸,۱۰۸,۹۰۸,۲۴۶	۶۱۰,۱۷۳	سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور

*بر اساس نامه‌های مجوز شرکت بورس اوراق بهادار به شماره ۱۸۱/۱۱۰۷۸۴ مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۱۲، ۱۴۰۱/۰۵/۰۵ و ۱۴۰۱/۰۵/۰۵ و ۱۸۱/۱۱۳۹۲۳ مورخ ۱۴۰۱/۰۶/۰۱، عملیات بازارگردانی نمادهای "کویر"، "چکاپا" و "سپید" خاتمه یافت و نمادهای مذکور که در دوره‌های قبل در فهرست نمادهای صندوق بوده اند از فهرست عملیات بازارگردانی صندوق حذف شدند.