

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

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۳

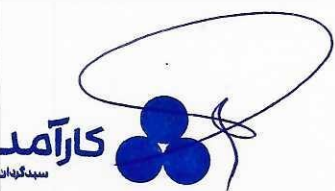


صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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 منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۴۰۳ بر پایه 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 ۱۴۰۳/۰۸/۲۲ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارگان صندوق
 سید محمد هادی رضوی	سید محمد هادی رضوی	سیدگردان سرآمد بازار	مدیر

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهر 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 ۱۴۰۳/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۳۳۴,۷۳۰	۱,۳۳۴,۱۵۲	۲,۰۶۷,۴۵۸

NAV به تفکیک نماد

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
صندوق سرمایه‌گذاری اعتماد ارغوان	۲,۱۳۹,۴۵۳	۲,۱۳۹,۳۰۴	۱۹,۲۱۴	۴۱,۱۰۴,۶۰۳,۵۴۸
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور	۱,۸۵۳,۵۸۹	۱,۸۵۱,۲۱۳	۱۲,۲۱۸	۲۲,۶۱۸,۱۳۲,۶۳۷
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	۷۸۳,۶۲۶	۷۸۲,۵۳۰	۸۱۶,۹۵۳	۶۳۹,۲۹۰,۹۳۲,۲۵۵
سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور	۱,۶۹۰,۴۴۶	۱,۶۹۰,۲۳۶	۱,۲۱۰,۷۹۳	۲,۰۴۶,۵۲۶,۱۵۳,۰۳۸
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ	۱,۰۵۹,۹۷۳	۱,۰۵۸,۵۶۴	۸,۲۸۰	۸,۷۶۴,۹۱۶,۲۲۸
جمع				۲,۷۵۸,۳۰۴,۷۳۷,۷۰۶

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۷/۳۰ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۱,۴۱۱,۶۸۸,۴۳۴,۱۷۵	۳۴.۲۵
دریافتنی تجاری	۱,۲۵۱,۴۶۲,۹۳۰,۰۳۶	۳۰.۳۷
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴۱۸,۹۷۶,۷۹۵,۷۸۸	۱۰.۱۷
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکتها	۶۰۱,۳۹۴,۸۲۷,۴۷۹	۱۴.۵۹
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۴۳۷,۷۶۷,۷۲۳,۵۷۵	۱۰.۶۲
جمع کل	۴,۱۲۱,۲۹۰,۷۱۱,۰۵۳	۱۰۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۳

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارشی انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۷۵,۱۲۰	۱,۵۰۲,۳۹۰	۲٪
صندوق سرمایه گذاری 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 مراحه کرمان موتور	۵,۱۲۱	۵,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ	عباتری	۹,۰۲۳	۱۸,۰۴۶	۲٪

حجم معاملات اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعیه 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
۵۶,۸۲۷,۳۵۱,۶۹۲,۴۵۵	۱۲,۱۷۲	۴۴,۷۶۴,۸۳۵,۰۶۷,۱۹۹	۳,۶۷۷,۶۳۹,۴۶۸	۱۲,۱۷۲	۴۴,۷۹۷,۴۰۱,۹۸۸,۰۵۴	۳,۶۸۰,۳۳۱,۲۷۷	صندوق س اعتماد ارغوان
۲,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰	اوراق مراحه شرکت کرمان موتور
۱۱,۰۳۳,۸۵۴,۶۷۱,۴۶۹	۴,۹۰۲	۲۷۱,۳۷۰,۵۵۶,۱۱۷	۵۵,۳۶۱,۱۳۰	۴,۷۶۲	۳۹۶,۱۹۵,۳۶۰,۰۱۹	۸۳,۲۰۰,۰۴۸	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز
۲۱,۹۷۶,۳۲۱,۹۵۵,۰۰۴	۱,۶۰۷,۴۹۶	۸۸۶,۷۹۳,۰۵۵,۱۹۴	۵۵۱,۶۶۱	۱,۴۹۷,۳۹۷	۱,۱۴۲,۳۸۰,۸۶۵,۴۳۶	۷۶۲,۹۱۱	سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور
۹۹۹,۹۹۱,۶۲۸,۴۰۰	۰	۰	۰	۱,۱۰۸,۲۴۵	۳۹,۹۹۹,۸۸۶,۷۸۵	۳۶,۰۹۳	اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵