

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.الکویت تم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۳

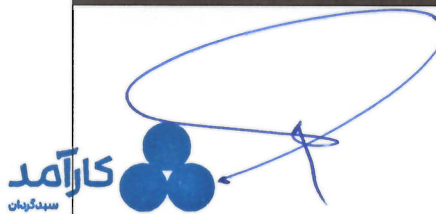
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ دی 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 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	ارکان صندوق
	سید محمد هادی رضوی	سیدگردان سرآمد بازار	مدیر

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ دی 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 تأمین 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 ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۳۸۵,۱۳۴	۱,۳۸۴,۴۳۹	۳,۳۵۰,۶۵۲

NAV به تفکیک نماد

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
صندوق سرمایه‌گذاری اعتماد ارغوان	۲,۳۶۵,۱۶۹	۲,۳۶۵,۱۶۹	۰	۲۲,۶۶۲,۲۸۴
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)	۲,۱۵۰,۲۵۶	۲,۱۵۰,۱۳۵	۴۸,۰۳۳	۱۰۳,۲۷۷,۴۳۴,۴۵۵
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز (خکرمان)	۹۸۸,۵۵۶	۹۸۷,۳۵۷	۸۱۶,۹۵۳	۸۰۶,۶۲۴,۲۶۳,۲۲۱
سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور (عکرمان ۲)	۱,۷۶۵,۱۲۸	۱,۷۶۴,۹۵۸	۱,۲۱۲,۱۸۱	۲,۱۳۹,۴۴۸,۵۵۳,۳۹۸
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ (عباتری)	۲,۱۸۵,۴۳۳	۲,۱۸۴,۹۷۸	۳۰,۵۱۲	۶۶,۶۶۸,۰۴۸,۷۳۶
صندوق در اوراق بهادار کارآمد	۱,۲۲۹,۸۹۴	۱,۲۲۹,۷۳۲	۱۴۴,۱۱۸	۱۷۷,۲۲۶,۵۱۶,۳۷۶
مربحه کرمان موتور (کرمان ۰۶۱)	۱,۰۴۴,۷۴۰	۱,۰۴۴,۶۴۰	۳۹۲,۹۴۵	۴۱۰,۴۸۶,۰۶۴,۸۰۰
صندوق جوانه کوچک گندم (جوانه کوچک)	۴,۰۹۲,۸۹۳	۴,۰۹۰,۸۳۲	۵۶,۱۶۸	۲۲۹,۷۷۳,۸۵۱,۷۷۶
فرآورده های دامی و لبنی دالاهو (غانیزان)	۱,۰۸۶,۸۷۷	۱,۰۸۵,۴۲۴	۶۴۹,۷۴۲	۷۰۵,۲۴۵,۵۶۰,۶۰۸
جمع				۴,۶۳۸,۷۵۰,۲۹۳,۳۷۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۳

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۱,۵۸۸,۸۷۴,۹۹۶,۸۳۳	۲۵.۶۶
دریافتنی تجاری	۱,۷۸۲,۹۸۰,۶۱۳,۹۱۱	۲۸.۷۶
سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴۷۶,۵۴۳,۹۸۸,۶۶۳	۷.۷
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم شرکتها	۱,۲۷۸,۷۳۱,۶۶۵,۰۱۷	۲۰.۶۵
سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری	۹۲۹,۱۷۹,۲۰۴,۲۰۵	۱۵.۰۱
حساب‌های فی ما بین با کارگزاران	۱۳۵,۷۲۵,۴۴۶,۶۶۰	۲.۱۹
جمع کل	۶,۱۹۲,۰۳۵,۹۱۵,۲۸۹	۱۰۰

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۷۵,۱۲۰	۱,۵۰۲,۳۹۰	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	۵۱۲۱	۵,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ	عباتری	۹,۰۲۳	۱۸,۰۴۶	۲٪
در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد	کارآمد	۷۵۰,۰۰۰	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۱٪
صندوق جوانه کوچک گندم	گندم	۴۰۰,۰۰۰	۴,۰۰۰,۰۰۰	۲٪
مرابحه کرمان موتور	کرمان ۰۶۱	۱۵,۰۰۰	۳۴۰,۰۰۰	۱٪
فرآورده های دامی و لبنی دالاهو	غانیزان	۲۸۰,۰۰۰	۵,۶۰۰,۰۰۰	۳٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۳

حجم معاملات اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق (بر اساس اطلاعات اولیه آغاز بازارگردانی هر نماد به صورت مجزا تا تاریخ صورت مالی)

فروش			خرید			
میانگین بهای فروش	مبلغ کل (ریال)	تعداد	میانگین بهای خرید	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۱۲.۲۱۵	۴۵.۹۱۷.۱۴۲.۵۲۶.۸۸۱	۳.۷۵۹.۰۷۰.۱۲۷	۱۲.۲۱۳	۴۵.۹۱۱.۰۰۹.۱۷۶.۸۰۷	۳.۷۵۹.۰۷۰.۱۲۷	صندوق س اعتماد ارغوان
۵۵.۹۹۵	۹۶.۲۳۹.۶۱۸.۴۴۹	۱,۷۱۸,۷۱۱	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۰۰۰	اوراق مربحه شرکت کرمان موتور ۵۱۲۱
۴۸۰۴	۵۵۶.۰۶۶۸.۰۶۶۲۴	۱۱۵.۷۴۵.۹۸۶	۴,۷۵۲	۵۶۱.۵۸۲.۱۰۷.۳۹۷	۱۱۸.۱۸۵.۶۲۸	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز
۱.۶۲۸.۴۰۶	۱۰.۳۸۸.۳۷.۱۳۸.۸۶۳	۶۳۷.۹۴۱	۱.۵۲۹.۲۴۷	۱.۳۰۱.۴۰۵.۱۵۲.۴۱۷	۸۵۲.۹۷۲	سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور
.	.	.	۱,۱۰۸,۲۴۵	۳۹,۹۹۹,۸۸۶,۷۸۵	۳۶,۰۹۳	اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵
۱۰.۶۰۴	۱۵.۹۸۳.۹۴۴.۷۹۸.۷۷۴	۱.۵۰۷.۳۰۷.۳۵۵	۱۰.۵۹۸	۱۶.۲۷۵.۹۲۱.۱۴۱.۶۱۶	۱.۵۳۵.۶۸۲.۲۱۶	اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد
۱۱.۴۴۶	۷.۶۷۲.۰۱۳.۹۹۲.۷۵۴	۶۷۰.۲۹۲.۹۲۳	۱۱.۱۶۰	۷.۷۱۵.۱۱۳.۸۳۹.۳۳۱	۶۹۱.۳۱۵.۲۸۹	صندوق جوانه کوچک گندم
۹۹۹.۹۶۶	۴۶۹.۹۸۴.۰۰۰.۰۰۰	۴۷۰.۰۰۰	۱.۰۰۰.۰۰۰	۵۰۰.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۵۰۰.۰۰۰	مربحه کرمان موتور ۰۶۱
۱۱.۲۲۷	۷۷.۴۶۸.۰۷۹.۶۹۱	۶.۹۰۰.۰۰۰	۱.۰۶۴	۶۴۹.۷۴۲.۰۰۵.۹۲۰	۶۱.۰۶۵.۹۷۸	فرآورده های دامی و لبنی دالاهو