

صندوق سرمایه‌گذاری ا.ب.ب الگوریتم سرآمد بازار
گزارش عملکرد

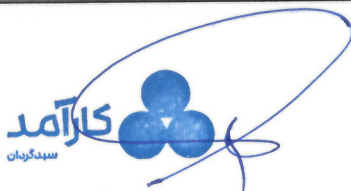
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

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 ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴ 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 ۱۴۰۴/۰۲/۲۴ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

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 ۱۴۰۴/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۲۸۷,۷۵۱	۱,۲۸۶,۴۲۴	۲,۸۳۶,۷۷۹

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	۰
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)	۳,۳۱۶,۱۹۹	۳,۳۱۴,۶۹۸	۱۸,۶۶۴	۶۱,۸۶۵,۵۳۱,۶۹۰
شرکت سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز (خکرمان)	۱,۰۱۸,۴۷۳	۱,۰۱۷,۳۰۴	۸۱۶,۹۵۳	۸۳۱,۰۸۹,۵۱۴,۰۱۹
اوراق سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور (عکرمان ۲)	۲۳,۷۱۶,۲۲۳	۲۳,۷۱۶,۲۲۳	۱۸,۸۵۸	۴۴۷,۲۴۰,۵۳۸,۱۶۵
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ (عباتری)	۳,۷۶۴,۵۷۳	۳,۷۶۳,۶۶۱	۱۶,۱۳۵	۶۰,۷۲۶,۶۷۶,۵۳۳
صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد (کارآمد)	۱,۷۲۶,۲۹۶	۱,۷۲۶,۱۱۹	۱۷۴,۵۲۱	۳۰۱,۲۴۴,۰۴۸,۳۳۹
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۰۶۱)	۹۵۵,۳۵۵	۹۵۴,۹۷۶	۶۲۴,۱۷۳	۵۹۶,۰۷۰,۱۷۰,۰۳۱
صندوق سرمایه‌گذاری جوانه کوچک گندم (جوانه کوچک)	۴,۵۰۸,۸۵۹	۴,۵۰۷,۸۳۸	۹۳,۱۹۰	۴۲۰,۰۸۵,۴۰۷,۸۷۴
شرکت فرآورده‌های دامی و لبنی دالاهو (غانیزان)	۱,۱۳۲,۵۰۴	۱,۱۲۹,۷۸۳	۵۰۰,۳۳۲	۵۶۵,۱۵۳,۷۲۶,۶۰۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
گواهی سپرده کالایی شمش نقره (CD ۱ SIB ۰۰۰ ۱)	۹۶۷,۶۴۳	۹۶۵,۳۲۳	۲۹۰,۶۵۰	۲۸۰,۵۷۱,۱۳۷,۸۵۷
قرارداد آتی نقره SIL	۵۵۵,۸۵۲	۵۵۵,۸۵۲	۱۷,۸۷۹	۹,۹۳۸,۰۷۴,۳۵۲
اوراق سلف موازی شرکت کرمان موتور (عکرمان ۳)	۲,۳۲۴,۶۷۶	۲,۳۲۲,۵۷۱	۱۵۱,۶۲۳	۳۵۲,۱۵۵,۲۵۲,۱۱۳
اوراق مربحه شرکت آرمان الکتریک ارگ (آرمان ارگ ۰۷۱)	۱,۰۴۶,۸۴۹	۱,۰۴۶,۶۱۲	۹۹,۶۹۲	۱۰۴,۳۳۸,۸۲۱,۰۷۲
اوراق مربحه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو (نفت سرو ۰۷)	۱,۹۹۸,۵۶۲	۱,۹۹۷,۷۴۲	۳۳,۰۶۷	۶۶,۰۵۹,۳۴۵,۸۸۸

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۹۴۳,۶۲۵,۳۸۶,۸۷۵	۱۵.۴۷
دریافتنی تجاری	۱,۴۰۵,۹۲۵,۰۹۱,۴۸۹	۲۳.۰۵
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲۶۰,۱۲۰,۳۸۰,۱۱۴	۴.۲۶
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکت‌ها	۱,۸۲۵,۴۴۶,۸۹۵,۶۸۷	۲۹.۹۳
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۱,۶۶۴,۵۵۰,۱۰۸,۱۸۲	۲۷.۲۹
حساب‌های فیما بین با کارگزاران	۰	۰
جمع کل	۶,۰۹۹,۶۶۷,۸۶۲,۳۴۷	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارشی انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۷۵,۱۲۰	۱,۵۰۲,۳۹۰	۲٪
اوراق سلف موازی استاندارد کرمان خودرو	عکرمان ۲	۱ درصد از حجم کل اوراق	۵ درصد از حجم کل اوراق	۲٪
اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۵۱۲۱	۵,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ	عباتری	۱ درصد از حجم کل اوراق	۲ درصد از حجم کل اوراق	۱٪
صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد	کارآمد	۷۵۰,۰۰۰	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	۱٪
صندوق جوانه کوچک گندم	جوانه کوچک	۸۰۰,۰۰۰	۸,۰۰۰,۰۰۰	۲٪
اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۰۶۱	۱۵,۰۰۰	۳۴۰,۰۰۰	۱٪
فرآورده های دامی و لبنی دالاهو	غانیزان	۲۸۰,۰۰۰	۵,۶۰۰,۰۰۰	۳٪
گواهی سپرده شمش نقره	CD\SIB۰۰۰۱	حداقل ۵۰۰ گواهی (معادل ۵۰۰ گرم شمش نقره) حجم خرید و حداقل ۵۰۰ گواهی (معادل ۵۰۰ گرم شمش نقره) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته (معادل ۱۰۰۰ گواهی سپرده شمش نقره در هر روز معاملاتی)	۴٪
قرارداد آتی نقره	SIL	حداقل ۵۰ قرارداد آتی نقره حجم خرید و حداقل ۵۰ قرارداد آتی نقره حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته (معادل ۱۰۰ قرارداد آتی نقره در هر روز معاملاتی)	۴٪
اوراق سلف موازی استاندارد خودرو KMCT ۹ شرکت کرمان موتور	عکرمان ۳	۱٪ حجم کل اوراق	۲٪ حجم کل اوراق	۲٪
اوراق مرابحه شرکت آرمان الکتریک ارگ	آرمان ارگ ۰۷۱	۵,۰۰۰	۲۵,۰۰۰	۱٪
اوراق مرابحه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو	نفت سرو ۰۷	۵,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۴

حجم معاملات اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق

فروش			خرید			
میانگین بهای فروش	مبلغ کل (ریال)	تعداد	میانگین بهای خرید	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۱۳,۶۲۰	۱۲,۲۵۳,۶۹۳,۰۵۶,۲۰۰	۸۹۹,۶۵۴,۰۵۹	۱۳,۶۲۰	۱۲,۲۲۲,۸۷۱,۷۰۲,۳۱۱	۸۹۷,۴۲۹,۴۰۲	صندوق س اعتماد ارغوان (آا)
.	.	.	.	.	.	اوراق مربایحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)
۴,۷۲۸	۵۵۵,۹۲۸,۶۰۲,۸۲۴	۱۱۷,۵۸۸,۹۰۱	۴,۶۴۵	۴۶۲,۵۸۵,۰۳۶,۴۷۹	۹۹,۵۸۸,۴۶۸	سرمایه گذاری آرمان گستر پاریز (خکرمان)
۱,۶۹۰,۷۷۲	۱,۳۴۳,۹۴۷,۴۹۳,۵۳۰	۷۹۴,۸۷۲	۱,۷۰۲,۲۱۶	۴۱۳,۲۹۶,۲۴۴,۱۷۱	۲۴۲,۷۹۹	سلف خودرو کی ام سی کرمان موتور (عکرمان ۲)
.	.	.	۱,۱۰۸,۲۴۵	۳۹,۹۹۹,۸۸۶,۷۸۵	۳۶,۰۹۳	اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ (عباتری)
۱۱,۱۷۸	۶۲,۶۲۰,۷۱۱,۸۹۲,۲۷۳	۵۶۰,۱۹۲,۵۷۹	۱۱,۱۶۵	۶۲,۹۳۴,۶۹۶,۸۳۶,۱۵۱	۵,۶۳۶,۷۷۷,۸۰۴	صندوق اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد (کارآمد)
۱۱,۳۸۳	۹,۵۹۱,۳۵۱,۳۴۹,۱۴۵	۸۴۲,۶۰۸,۹۷۵	۱۱,۱۲۹	۹,۵۶۷,۱۰۲,۹۸۷,۵۲۴	۸۵۹,۶۲۸,۵۰۰	صندوق جوانه کوچک گندم (جوانه کوچک)
۹۹۹,۹۶۶	۴۶۹,۹۸۴,۰۰۰,۰۰۰	۳۷۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰	اوراق مربایحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۰۶۱)
۱۴,۷۴۹	۱,۰۲۴,۵۳۳,۷۶۱,۷۰۷	۶۹,۴۶۵,۹۷۸	۱۳,۸۶۰	۱,۷۹۲,۹۸۸,۰۶۲,۲۷۴	۱۲۹,۳۶۸,۸۱۸	فرآورده های دامی و لبنی دالاهو (غانیزان)
۹۶۷,۷۸۹	۲۲۲,۱۶۷,۵۳۲,۱۴۲	۲۲۹,۵۶۲	۹۳۰,۸۲۲	۵۱۰,۲۲۱,۰۴۲,۸۸۳	۵۴۸,۱۴۰	گواهی سپرده شمش نقره (CD ۱SIB ۰۰۰۱)
۱,۰۷۹,۵۰۵	۱,۹۱۷,۲۰۱,۴۴۱	۱,۷۷۶	۱,۰۷۹,۵۹۸	۱,۹۱۷,۳۶۶,۶۵۳	۱,۷۷۶	قرارداد آتی نقره (SIL)
۱,۵۶۷,۹۶۰	۱۸,۸۱۵,۵۱۶	۱۲	۱,۵۴۲,۵۴۹	۱۴۹,۹۵۴,۲۲۵,۸۹۱	۹۷,۲۱۲	اوراق سلف موازی شرکت کرمان موتور (عکرمان ۳)
.	.	.	۱,۰۰۰,۱۴۵	۵,۰۰۰,۷۲۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	اوراق مربایحه شرکت آرمان الکتریک ارگ (آرمان ارگ ۰۷۱)
.	.	.	۱,۰۰۰,۱۴۵	۵,۰۰۰,۷۲۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	اوراق مربایحه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو (نفت سرو ۰۷)