

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

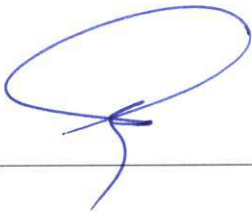
سال مالی منتهی به ۳۱ تیرماه ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر 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 تیر 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 ۱۴۰۴/۰۵/۲۷ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

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



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر 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 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 ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۷۰۴,۴۱۲	۱,۷۰۳,۲۳۲	۲,۳۳۶,۱۰۲

NAV به تفکیک نماد

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)	۴,۱۴۴,۹۸۶	۴,۱۴۰,۳۰۵	۲۲,۲۹۹	۹۲,۳۲۴,۶۶۴,۲۹۵
شرکت سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز (خکرمان)	۷۸۴,۲۱۸	۷۸۳,۱۷۲	۸۱۶,۹۵۳	۶۳۹,۸۱۴,۶۱۸,۶۵۳
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمپر شرکت کرمان باتری ارگ (عباتری)	۷,۸۴۹,۱۱۹	۷,۸۴۷,۴۸۴	۹,۲۹۷	۷۲,۹۵۸,۰۵۵,۷۰۱
صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد (کارآمد)	۲,۲۰۸,۰۴۰	۲,۲۰۷,۹۱۴	۱۹۴,۴۷۷	۴۲۹,۳۸۸,۴۲۱,۹۴۱
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۰۶۱)	۳,۹۳۰,۴۶۰	۳,۹۲۸,۲۵۱	۴۰,۰۳۷	۱۵۷,۲۷۵,۳۷۸,۵۴۴
صندوق سرمایه‌گذاری جوانه کوچک گندم (جوانه کوچک)	۶,۲۴۲,۹۴۴	۶,۲۴۰,۵۰۱	۸۶,۶۹۰	۵۴۰,۹۸۹,۰۳۷,۷۴۰
گواهی سپرده سکه طلا CDIGOC۰۰۰	۱,۰۱۴,۴۹۱	۱,۰۱۴,۳۹۵	۳۰,۰۴۲	۳۰,۴۷۴,۴۵۲,۰۷۵
گواهی سپرده شمش طلا CDIGOB۰۰۰	۱,۰۲۵,۷۸۹	۱,۰۲۵,۳۱۱	۳۰,۰۴۲	۳۰,۸۰۲,۳۸۵,۵۴۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
قراردادهای آتی شمش طلای خام ۹۹۵ (GB)	۱,۰۱۰,۶۳۲	۱,۰۱۰,۶۳۲	۸,۰۲۰	۸,۱۰۵,۲۶۷,۲۶۵
سلف موازی کاتالیست اکتیو آهن (عسرو)	۱,۱۷۱,۸۲۵	۱,۱۷۰,۱۳۳	۷۹,۲۵۳	۹۲,۷۳۶,۵۵۸,۵۴۷
مربحه آرمان موتور-سرمایه‌گذاری ۰۸۰۳۲۵ (آرمان موتور ۰۸۱)	۱,۰۳۹,۷۹۲	۱,۰۳۹,۲۸۴	۳۶,۸۴۳	۳۸,۳۹۰,۳۳۸,۵۷۷
شرکت فرآورده‌های دامی و لبنی دالاهو (غانیزان)	۱,۳۲۹,۶۶۱	۱,۳۲۹,۳۴۶	۱۸۷,۹۳۵	۲۴۹,۸۳۰,۶۴۵,۹۶۳
گواهی سپرده کالایی شمش نقره (CD۱SIB۰۰۱)	۱,۱۴۷,۴۲۹	۱,۱۴۴,۶۹۱	۲۹۰,۶۵۰	۳۳۲,۷۰۴,۵۱۵,۳۶۰
قرارداد آتی نقره SIL	۸۴۰,۵۳۱	۸۴۰,۵۳۱	۱۷,۸۷۹	۱۵,۰۳۷,۸۵۷,۸۶۶
اوراق سلف موازی شرکت کرمان موتور (عکرمان ۳)	۲,۹۲۴,۴۵۸	۲,۹۲۳,۵۴۵	۳۶۰,۹۲۳	۱,۰۵۵,۱۷۴,۵۷۳,۱۰۷
اوراق مربحه شرکت آرمان الکتریک ارگ (آرمان ارگ ۰۷۱)	۱,۱۸۳,۰۰۳	۱,۱۸۲,۶۵۹	۹۹,۶۹۲	۱۱۷,۹۰۱,۶۵۴,۶۷۸
اوراق مربحه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو (نفت سرو ۰۷)	۲,۹۹۹,۳۲۸	۲,۹۹۶,۵۷۷	۲۵,۰۷۰	۷۵,۱۲۴,۱۷۷,۹۷۵

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۴/۳۱ به شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
نقد و بانک	۳۰۵,۰۳۱,۱۵۰,۹۶۱	۴.۸۵
دریافتنی تجاری	۲۰,۷۵,۳۲۶,۷۷۴,۵۷۲	۳۳.۰۲
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۳۰۴,۹۴۵,۱۲۳,۶۵۴	۴.۸۵
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم شرکت‌ها	۹۴۰,۷۴۷,۸۰۹,۴۸۳	۱۴.۹۷
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۲,۶۵۵,۷۳۶,۳۵۴,۲۷۶	۴۲.۲۶
سایر دارایی‌ها	۳,۱۳۴,۵۳۸,۸۱۸	۰.۰۴
جمع کل	۶,۲۸۴,۹۲۱,۷۵۱,۷۶۴	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۱۲۵,۴۴۵	۲,۵۰۸,۸۵۰	۲٪
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۵۱۲۱	۵,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ آمبر 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	۱,۳۲۵,۰۰۰	۲۴,۵۰۰,۰۰۰	۱٪
صندوق جوانه کوچک گندم	جوانه کوچک	۸۰۰,۰۰۰	۸,۰۰۰,۰۰۰	۲٪
اوراق مربحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۰۶۱	۱۵,۰۰۰	۳۴۰,۰۰۰	۱٪
فراآورده های دامی و لبنی دالاهو	غانیزان	۲۸۰,۰۰۰	۵۶۰۰,۰۰۰	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 KMC T۹ شرکت کرمان موتور	عکرمان ۳	۱٪ حجم کل اوراق	۲٪ حجم کل اوراق	۲٪
اوراق مربحه شرکت آرمان الکتریک ارگ	آرمان ارگ ۰۷۱	۵,۰۰۰	۲۵,۰۰۰	۱٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مغننه
گواهی سپرده سکه طلا	گواهی سپرده سکه طلا CD\GOC۰۰۰۱	حداقل ۵ گواهی سپرده حجم خرید(معادل ۵ سکه طلا) و حداقل ۵ گواهی سپرده حجم فروش (معادل ۵ سکه طلا) در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله (۱۰ گواهی سپرده سکه معادل ۱۰ سکه طلا)	۴٪
گواهی سپرده شمش طلا	گواهی سپرده شمش طلا CD\GOB۰۰۰۱	حداقل ۵۰۰ گواهی سپرده (معادل ۵۰ گرم شمش طلا) حجم خرید و حداقل ۵۰۰ گواهی سپرده (معادل ۵۰ گرم شمش طلا) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله (۱۰۰۰ گواهی سپرده معادل ۱۰۰ گرم شمش طلا)	۴٪
قراردادهای آتی شمش طلای خام	قراردادهای آتی شمش طلای خام ۹۹۵ (GB)	حداقل ۳۰ قرارداد خرید و حداقل ۳۰ قرارداد فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله (۶۰ قرارداد)	۴٪
صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کارآمد	-	حداقل ۵۰۰,۰۰۰ واحد سفارش خرید و حداقل ۵۰۰,۰۰۰ واحد سفارش فروش	۵,۰۰۰,۰۰۰	۴٪
اوراق مرابحه شرکت آرمان موتور ارگ	آرمان موتور ۰۸۱	۵,۰۰۰	۲۰,۰۰۰	۱٪
اوراق سلف موازی استاندارد کاتالیست اکتیو احیا مستقیم آهن شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو	عسرو	۱٪ حجم کل اوراق	۳٪ حجم کل اوراق	۲٪
اوراق مرابحه شرکت نانوفناوران دارویی الوند	-	۵,۰۰۰	۸۰,۰۰۰	۱٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر 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
۹,۳۱۰,۹۳۴	۱۸,۳۲۱,۸۶۷,۳۰۴	۲,۰۰۰	۸,۹۵۵,۸۱۹	۲۲,۳۸۹,۵۴۷,۵۱۶	۲,۵۰۰	CD\GOB۰۰۰۱ طلا
-	-	-	-	-	-	اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)
۴,۹۴۴	۷۲۲,۰۳۴,۷۲۳,۵۴۳	۱۴۶,۰۳۴,۱۹۱	۴,۸۶۳	۷۵۲,۳۵۶,۱۰۴,۹۸۰	۱۵۴,۷۰۳,۲۷۶	سرمایه گذاری آرمان گستر یاریز (خکرمات)
۷۶۸,۳۶۹,۵۳۱	۹,۲۱۹,۲۳۴,۲۷۶	۱۲	۷۲۸,۰۳۸,۸۲۳	۸,۷۳۶,۳۶۵,۸۷۸	۱۲	CD\GOC۰۰۰۱ طلا
۱,۲۵۰,۷۴۵	۱۶,۳۵۹,۶۸۵	۱۳	۱,۱۰۸,۲۹۴	۴۰,۰۱۴,۹۶۶,۰۳۴	۳۶,۱۰۵	اوراق سلف موازی استاندارد باتری ۵۵ (عباتری)
۱۱,۷۷۶	۱۴۰,۲۷۲,۲۷۳,۹۸۴,۳۴۴	۱۱,۹۱۱,۹۷۵,۱۳۵	۱۱,۷۶۷	۱۴۰,۴۶۸,۰۴۰,۷۶۸,۶۸۵	۱۱,۹۳۷,۷۸۵,۱۳۴	صندوق اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد (کارآمد)
۱۱,۷۲۳	۱۵,۰۱۰,۳۴۰,۸۰۰,۵۲۳	۱,۲۷۹,۳۱۷,۵۵۹	۱۱,۴۵۶	۱۴,۹۶۰,۰۹۱,۳۱۶,۴۲۳	۱,۳۰۵,۹۰۷,۴۰۲	صندوق جوانه کوچک گندم (جوانه کوچک)
۹۹۹,۹۹۶	۳۷۴,۹۹۸,۲۷۲,۸۲۵	۳۷۵,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۸۱	۵۰۵,۰۴۴,۳۸۱,۳۱۴	۵۰۵,۰۰۰	اوراق مربحه شرکت کرمان موتور (کرمان ۰۶۱)
۱۶,۲۳۸	۲,۶۴۹,۶۹۴,۷۸۸,۳۱۹	۱۶۳,۱۷۵,۰۸۰	۱۴,۶۵۶	۲,۴۳۴,۵۸۰,۶۵۲,۵۷۷	۱۶۵,۴۲۳,۰۶۹	فرآورده های دامی و لبنی دالاهو (غانیزان)
۹۶۵,۸۳۶	۲۴۴,۱۳۱,۵۹۲,۹۱۱	۲۵۲,۷۶۷	۹۳۱,۰۵۸	۵۲۹,۱۷۶,۴۶۸,۰۰۱	۵۶۸,۳۶۰	گواهی سپرده شمش نقره (CD\SIB۰۰۰۱)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۴

فروش				خرید		
میانگین بهای فروش	مبلغ کل (ریال)	تعداد	میانگین بهای خرید	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۱,۷۲۷,۰۹۱	۲,۰۳۴,۵۱۳,۲۶۴	۱,۱۷۸	۱,۵۳۴,۸۰۷	۱۵۱,۹۷۵,۰۲۹,۱۵۲	۹۸,۳۷۸	اوراق سلف موازی شرکت کرمان موتور (عکرمات ۳)
.	.	.	۱,۰۰۰,۱۴۵	۵,۰۰۰,۷۲۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	اوراق مربجه شرکت آرمان الکتریک ارگ (آرمان ارگ ۰۷۱)
.	.	.	۱,۰۰۰,۱۴۵	۵,۰۰۰,۷۲۵,۰۰۰	۵,۰۰۰	اوراق مربجه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو (نفت سرو ۰۷)
.	.	.	۱,۶۷۳,۶۰۱	۲۰,۰۰۰,۹۶۲,۷۵۸	۱۱,۹۵۸	سلف موازی کاتالیست اکتیو آهن (عسرو)
.	.	.	۱,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰	مربجه آرمان موتور-سرآمد ۸۰۳۲۵ (آرمان موتور ۰۸۱)
.	.	.	.	.	.	قراردادهای آتی شمش طلای خام ۹۹۵ (GB)
۱,۰۷۹,۵۰۵	۱,۹۱۷,۲۰۱,۴۴۱	۱,۷۷۶	۱,۰۷۹,۵۹۸	۱,۹۱۷,۳۶۶,۶۵۳	۱,۷۷۶	قرارداد آتی نقره (SIL)