

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
الگوریتم سرآمد بازار

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

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 نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵ 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 در خصوص وضع عمومی صندوق و عملکرد مدیر فراهم می‌آورد.

به نظر اینجانبان اطلاعات مندرج در این گزارش که در باره 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 تاحدی که در موقعیت فعلی می‌توان پیش بینی 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 ۱۴۰۵/۰۲/۲۷ به تأیید مدیر صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
مدیر	سیدگردان کارآمد	سید محمد هادی رضوی	

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 غیرتجاری 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.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتمی سرمایه‌بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی، نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

آخرین وضعیت صندوق:

وضعیت صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۱/۳۱ به شرح زیر است:

NAV کلی صندوق

آخرین نرخ صدور	آخرین نرخ ابطال	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری
۱,۸۵۹,۶۵۴	۱,۸۵۶,۶۰۴	۳,۵۸۵,۹۰۲

NAV به تفکیک نماد

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
صکوک اجاره داترا ۹۰-۳ ماهه ۲۳٪ (صاترا ۹۰)	۱,۰۰۹,۷۹۴	۱,۰۰۸,۸۴۹	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۸۸,۴۸۷,۶۶۱
صکوک مرابحه قرن ۶۱۲ - بدون ضامن (صقرن ۶۱۲)	۱,۰۴۱,۶۰۳	۱,۰۴۰,۷۸۷	۱۰۱,۰۰۰	۱۰۵,۱۱۹,۴۸۴,۸۶۲
مرابحه صنایع پزشکی فارمد ۰۸۱۲۲۶ (فارمد ۰۸)	۱,۳۱۴,۳۱۷	۱,۳۱۲,۰۸۰	۱۰,۰۰۰	۱۳,۱۲۰,۷۹۶,۴۹۷
مرابحه مدی تک سیس ۰۸۱۲۲۵ (مدی تک ۰۸)	۱,۳۱۴,۳۴۱	۱,۳۱۲,۱۰۴	۱۰,۰۰۰	۱۳,۱۲۱,۰۳۶,۵۱۵
تولید برق ماهتاب کهنوج (بکهنوج)	۹۴۰,۰۸۵	۹۳۸,۶۸۶	۶۲۵,۵۴۶	۵۸۷,۱۹۱,۰۱۳,۰۱۴
گواهی سپرده خودرو T۹KMCT	۱,۹۱۶,۵۰۱	۱,۹۱۳,۵۵۵	۴۱,۸۵۳	۸۰,۰۸۸,۰۱۳,۷۸۸
گواهی میلگرد SteelRebar	۱,۳۵۱,۴۳۴	۱,۳۵۱,۲۷۳	۱۰۳,۹۶۲	۱۴۰,۴۸۱,۰۰۴,۸۹۰
گواهی شمش روی ZincIngot	۱,۳۱۵,۱۵۷	۱,۳۱۳,۱۲۰	۳۰۵,۶۲۸	۴۰۱,۳۲۶,۱۹۷,۲۱۸
سلف استاندارد لوله جلو اگزوز (عموتور)	۳,۱۶۴,۳۸۲	۳,۱۶۲,۹۴۴	۱۹,۱۲۱	۶۰,۴۷۸,۶۵۰,۶۱۶
قرارداد اختیار معامله شمش طلا (GB)	۲,۷۹۸,۸۴۰	۲,۷۹۸,۱۹۲	۹۹,۸۴۰	۲۷۹,۳۷۱,۵۰۰,۷۷۱
اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح حمل و نقل عمومی (اتوبوس)	۷۴,۸۴۱,۷۶۷	۷۴,۷۴۵,۲۸۳	۲۰۰	۱۴,۹۴۹,۰۵۶,۵۷۹
اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح قطار شهری	۳,۰۸۹,۰۲۱,۷۶۶	۳,۰۸۴,۲۷۰,۲۹۷	۲۲	۶۷,۸۵۳,۹۴۶,۵۴۳
مرابحه نانوفناوران داروئی الوند (نانوالوند ۰۸)	۹۰۹,۷۶۱	۹۰۹,۳۴۶	۱۶۷,۲۷۰	۱۵۲,۱۰۶,۳۰۴,۲۵۵
اوراق مشارکت شهرداری طرجه	۷۵,۶۲۲,۹۵۳	۷۵,۴۶۴,۸۰۴	۱۰۰	۷,۵۴۶,۴۸۰,۴۰۶
صندوق چندکالایی کارآمد (زرگر)	۱,۴۸۳,۰۴۴	۱,۴۸۱,۴۶۱	۲۵۹,۲۶۵	۳۸۴,۰۹۰,۹۳۷,۶۱۵
اوراق مشارکت شهرداری مراغه	۴,۵۹۶,۸۸۹	۴,۵۵۳,۲۳۰	۹۱۴	۴,۱۶۱,۶۵۱,۸۳۲
اوراق مشارکت شهرداری شهرکرد	۷۴,۴۹۴,۲۸۷	۷۴,۴۵۷,۳۱۳	۱۰۰	۷,۴۴۵,۷۳۱,۲۷۸
سلف موازی پروتئاز بن دافراور (پروتئاز)	۶,۷۳۷,۱۱۰	۶,۷۳۱,۸۹۷	۱۷,۳۸۶	۱۱۷,۰۴۰,۷۵۳,۹۴۳
مرابحه آرمان موتور - سرآمد ۰۸۰۳۲۵ (آرمان موتور ۰۸)	۲,۲۹۶,۲۱۰	۲,۲۹۵,۰۴۴	۶,۸۱۰	۱۵,۶۲۹,۲۵۲,۰۲۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتیم سرمایه‌بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه‌ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ۱۴۰۵

نام اوراق بهادار	نرخ صدور	نرخ ابطال	کل واحدها	خالص ارزش دارایی
سلف موازی کاتالیست اکتیو آهن (عسرو)	۷,۲۳۴,۸۲۸	۷,۲۲۶,۰۸۶	۹,۷۷۶	۷۰,۶۴۲,۲۱۵,۷۶۹
قراردادهای آتی شمش طلای خام ۹۹۵ (GB)	۱,۰۷۷,۴۶۴	۱,۰۷۷,۴۶۴	۶۳,۹۷۳	۶۸,۹۲۸,۶۲۵,۲۲۶
گواهی سپرده شمش طلا GoldBar	۱,۶۲۶,۱۸۲	۱,۶۱۹,۴۵۰	۳۹۹,۶۰۳	۶۴۷,۱۳۷,۲۰۴,۲۷۴
گواهی سپرده سکه طلا GoldCoin	۱,۷۹۵,۳۶۶	۱,۷۹۴,۹۵۵	۴۰,۲۷۰	۷۲,۲۸۲,۸۱۹,۵۸۴
مراجعه نفت و گاز سرو ۷۱۲۲۶ (نفت سرو ۰۷)	۱۷,۵۶۰,۹۳۴	۱۷,۵۵۵,۴۳۰	۲,۲۷۲	۳۹,۸۸۵,۹۳۷,۳۰۵
مراجعه آرمان ارگ - کارآمد ۷۱۲۲۱ (آرمان ارگ ۰۷۱)	۳,۵۲۴,۳۶۶	۳,۵۰۳,۱۲۲	۱,۰۳۹	۳,۶۳۹,۷۴۳,۸۲۰
سلف موازی کرمان موتور (عکرمان ۳)	۳۲,۷۹۶,۱۹۲	۳۲,۷۵۰,۹۵۸	۵,۲۴۱	۱۷۱,۶۴۷,۷۷۳,۰۰۹
قرارداد آتی نقره SIL	۶,۹۶۵,۱۸۶	۶,۹۶۵,۱۸۶	۱۷,۸۷۹	۱۲۴,۵۳۰,۵۶۱,۱۶۸
گواهی سپرده کالایی شمش نقره (SilverBar)	۴,۳۵۱,۵۵۵	۴,۳۴۲,۵۱۱	۳۷۷,۴۶۲	۱,۶۳۹,۱۳۲,۸۱۳,۳۰۰
صندوق س. جوانه کوچک گندم - سهام (جوانه کوچک)	۹,۵۸۹,۹۰۷	۹,۵۸۳,۰۲۲	۳۹,۸۱۸	۳۸۱,۵۷۶,۷۶۲,۱۹۵
مراجعه کرمان موتور - سرآمد ۰۶۰۹۰۴ (کرمان ۰۶۱)	۶۷,۸۵۰,۹۸۰	۶۷,۶۶۴,۹۳۴	۱,۱۹۳	۸۰,۷۲۴,۲۶۵,۹۴۳
صندوق س. درآمد ثابت کارآمد - د (کارآمد)	۵,۷۹۵,۳۳۲	۵,۷۸۹,۳۷۱	۲۹,۹۱۲	۱۷۳,۱۷۱,۶۷۷,۴۹۲
مراجعه کرمان موتور - سرآمد ۰۵۱۲۲۳ (کرمان ۰۵۱۲۱)	۸,۷۶۰,۳۱۶	۸,۶۶۴,۴۱۱	۱,۴۹۴	۱۲,۹۴۴,۶۳۰,۵۶۲
سرمایه گذاری آرمان گسترپاریز (خکرمان)	۸۷۰,۶۳۴	۸۶۹,۳۸۹	۸۱۶,۹۵۳	۷۱۰,۲۵۰,۰۶۴,۶۲۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه‌گذار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

ترکیب دارایی‌های صندوق:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۱/۳۱ شرح زیر است:

عنوان	مبلغ به ریال	درصد از دارایی
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۱,۲۷۱,۸۸۰,۶۲۸,۳۹۰	۸,۸۳
سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده کالایی و اختیار خرید	۲,۹۰۱,۱۱۸,۶۶۹,۵۲۰	۲۰,۱۵
سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۳,۲۹۱,۵۹۶,۷۰۱,۰۶۵	۲۲,۸۶
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۲۲۰,۵۹۳,۸۹۴,۵۷۹	۱,۵۳
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۳۵۶,۸۱۵,۱۳۷,۰۰۰	۲,۴۸
حساب‌های دریافتی	۱,۸۵۵,۸۵۶,۹۸۸,۳۶۴	۱۲,۸۹
پیش پرداخت‌ها	۴,۲۵۲,۰۵۸,۸۵۳,۶۰۹	۲۹,۵۳
سایر دارایی‌ها	۱۰,۲۰۴,۸۷۹,۷۰۶	۰,۰۷
موجودی نقد	۲۳۹,۱۶۴,۲۱۱,۵۴۶	۱,۶۶
جمع کل	۱۴,۳۹۹,۲۸۹,۹۶۳,۷۷۹	۱۰۰

تعهدات صندوق:

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه (درصد)
سرمایه‌گذاری آرمان گستر پاریز	خکرمان	۱۶۰,۷۵۰	۳,۲۱۴,۹۵۰	۲/۲۵
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	۲
صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد	کارآمد	۱,۲۲۵,۰۰۰	۲۴,۵۰۰,۰۰۰	۱
صندوق جوانه کوچک گندم	جوانه کوچک	۱۳۲,۰۰۰	۱,۳۲۰,۰۰۰	۳
اوراق مرابحه شرکت کرمان موتور	کرمان ۰۶۱	۱۵/۰۰۰	۳۴۰/۰۰۰	۱
اوراق مرابحه شرکت توسعه صنایع نفت و گاز سرو	نفت سرو ۰۷	۵/۰۰۰	۴۰/۰۰۰	۱
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 KMCT۹ 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
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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه‌بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مطنه
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 زرگر کارآمد	زرگر	۲,۴۰۰,۰۰۰	۲۴,۰۰۰,۰۰۰	۴
اوراق مرابحه شرکت آرمان موتور ارگ	آرمان موتور ۸۱۰	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	۲٪ حجم کل اوراق	۲
اوراق مرابحه شرکت نانوفناوران داروئی الوند	نانوالوند ۸۰	۵,۰۰۰	۸۰,۰۰۰	۱
اوراق سلف موازی استاندارد آنزیم پروتئاز شرکت توسعه بن دافراور	عپروتئاز	۱٪ حجم کل اوراق	۲٪ حجم کل اوراق	۲
اوراق مشارکت شهرداری شهرکرد	-	۱,۷۵۰	۳۵,۰۰۰	۱
اوراق مشارکت شهرداری طرqbه	-	۸۷۵	۱۷,۵۰۰	۱
اوراق مشارکت شهرداری مراغه	-	۸۷۵	۱۷,۵۰۰	۱
اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح قطار شهری	-	۸,۰۰۰	۱۶۰,۰۰۰	۱
اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح حمل و نقل عمومی (اتوبوس)	-	۲,۰۰۰	۴۰,۰۰۰	۱
قرارداد اختیار معامله شمش طلا (GB)	-	حداقل ۲۰۰ قرارداد (معادل ۲۰۰ گواهی سپرده شمش طلا) حجم خرید و حداقل ۲۰۰ قرارداد (معادل ۲۰۰ گواهی سپرده شمش طلا) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله (۴۰۰ قرارداد معادل ۴۰۰ گواهی سپرده شمش طلا)	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه‌بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
گواهی سپرده میلگرد	-	حداقل ۱۰۰۰ گواهی (معادل ۱۰۰۰ کیلوگرم میلگرد) حجم خرید و حداقل ۱۰۰۰ گواهی (معادل ۱۰۰۰ کیلوگرم میلگرد) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته	۴
گواهی سپرده خودرو T9	-	حداقل ۵۰۰ گواهی حجم خرید و حداقل ۵۰۰ گواهی حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته	۴
اوراق سلف موازی استاندارد لوله جلو آگروز ۴ شرکت آرمان موتور ارگ	عموتور	۱٪ حجم کل اوراق	۲٪ حجم کل اوراق	۲
گواهی سپرده شمش روی	ZincIngot	حداقل ۵۰۰ گواهی (معادل ۵۰۰ کیلوگرم شمش روی) حجم خرید و حداقل ۵۰۰ گواهی (معادل ۵۰۰ کیلوگرم شمش روی) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته	۴
گواهی سپرده میلگرد	SteelRebar	حداقل ۱۰۰۰ گواهی (معادل ۱۰۰۰ کیلوگرم میلگرد) حجم خرید و حداقل ۱۰۰۰ گواهی (معادل ۱۰۰۰ کیلوگرم میلگرد) حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته	۴
گواهی سپرده خودرو T9	۹KMCT	حداقل ۵۰۰ گواهی حجم خرید و حداقل ۵۰۰ گواهی حجم فروش در هر روز معاملاتی	معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل ۲ برابر معامله حداقل سفارش انباشته	۴
اوراق اجاره شرکت آترا زیست آرای	صاترا۹۰۱	۳,۰۰۰	۶۰,۰۰۰	۱
شرکت تولید برق ماهتاب کهنوج	بکهنوج	۲۱۶,۴۳۰	۴,۳۲۸,۵۷۰	۲/۷۵
اوراق مرابحه شرکت مدی تک سیس	مدی تک ۰.۸	۵,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

نام اوراق بهادار	نماد	حداقل حجم سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مزنه
اوراق مرابحه شرکت صنایع پزشکی فارمد	فارمد ۰۸	۵,۰۰۰	۳۰,۰۰۰	۱
اوراق مرابحه شرکت پدیده شیمی قرن	صقرن ۰۶۱۲	۱۰,۰۰۰	۲۰۰,۰۰۰	۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

حجم معاملات اوراق بهادار موضوع بازارگردانی صندوق:

فروش		خرید		
مبلغ کل (ریال)	تعداد	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۶۵۵,۵۹۳,۹۹۶,۷۰۹	۱۵۲,۷۸۴,۶۸۵	۷۲۴,۷۰۹,۰۰۰,۷۱۲	۱۷۲,۹۳۲,۱۵۰	سرمایه گذاری آرمان گسترپاریز (خکرمان)
۵۹,۹۹۱,۳۰۰,۰۰۰	۶۰,۰۰۰	۶۰,۰۰۸,۷۰۰,۰۰۰	۶۰,۰۰۰	اوراق مربجه شرکت کرمان موتور (کرمان ۵۱۲۱)
۱۶۴,۹۲۷,۶۴۹,۲۶۹,۵۴۵	۱۱,۱۱۸,۹۰۰,۴۴۰	۱۱۱,۰۳۳,۶۰۲,۳۷۸,۹۵۵	۷,۴۸۰,۳۹۷,۶۶۹	صندوق در اوراق بهادار با درآمد ثابت کارآمد (کارآمد)
۶۶۱,۰۹۱,۸۳۹,۳۴۰	۶۶۱,۱۰۸	۶۶۱,۱۲۴,۱۶۰,۶۶۰	۶۶۱,۱۰۸	مربجه کرمان موتور - سرمایه ۰۶۰۹۰۴ (کرمان ۰۶۱)
۷,۵۰۱,۲۶۰,۸۳۲,۵۷۱	۵۲۷,۱۶۴,۴۸۹	۵,۵۳۹,۷۱۵,۱۱۱,۱۷۱	۳۹۷,۲۷۲,۲۴۷	صندوق س. جوانه کوچک گندم - سهام
۴,۷۸۹,۳۳۱,۲۴۲,۵۳۹	۱,۶۲۶,۶۸۳	۴,۸۰۴,۴۸۵,۷۷۹,۸۵۸	۱,۶۶۷,۰۲۷	گواهی سپرده کالایی شمش نقره (SilverBar)
۱	۱	۱	۱	قرارداد آتی نقره SIL
۲,۵۴۲,۶۹۴,۵۴۰,۶۳۷	۱,۲۸۰,۴۳۶	۲,۴۱۹,۸۱۶,۸۳۳,۴۶۷	۱,۲۸۰,۴۳۳	سلف موازی کرمان موتور (عکرمان ۳)
۰	۰	۰	۰	مربجه آرمان ارگ - کارآمد ۰۷۱۲۲۱ (آرمان ارگ ۰۷۱)
۰	۰	۰	۰	مربجه نفت و گاز سرو ۰۷۱۲۲۶ (نفت سرو ۰۷)
۵۰۱,۰۱۳,۵۷۰,۳۵۵	۳۷۵	۳۸۶,۷۵۱,۰۵۰,۳۲۸	۳۷۵	گواهی سپرده سکه طلا GoldCoin
۳,۶۷۵,۹۲۴,۳۹۱,۶۰۸	۱۸۸,۳۶۰	۴,۲۰۰,۷۹۷,۵۰۵,۰۹۱	۲۳۶,۹۲۶	گواهی سپرده شمش طلا GoldBar
۰	۰	۰	۰	قرارداد آتی شمش طلای خام ۹۹۵
۶۴۳,۳۵۸,۷۱۴	۳۵۵	۶۳۸,۰۵۱,۷۸۰	۳۵۲	سلف موازی کاتالیست اکتیو آهن (عسرو)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه‌بازار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

فروش		خرید		
مبلغ کل (ریال)	تعداد	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۰	۰	۰	۰	مربحه آرمان موتور - سرمایه ۰۸۰۳۲۵ (آرمان موتور ۰۸)
۵,۷۷۷,۷۲۸	۳	۱۰,۰۰۱,۳۷۸,۵۴۹	۵,۹۵۳	سلف موازی پروتئاز بن دافراور (عپروتئاز)
۰	۰	۰	۰	اوراق مشارکت شهرداری شهرکرد
۰	۰	۰	۰	اوراق مشارکت شهرداری مراغه
۱۸,۱۸۷,۰۷۲,۵۱۴,۸۷۴	۹۹۵,۵۵۰,۳۰۷	۱۱,۶۶۴,۶۱۴,۴۷۸,۶۶۸	۶۱۷,۱۸۴,۳۰۱	صندوق چندکالایی کارآمد (زرگر)
۰	۰	۰	۰	اوراق مشارکت شهرداری طرقله
۳,۵۲۲,۷۶۴,۷۷۹,۲۸۵	۴,۰۴۰,۰۰۰	۳,۷۵۴,۵۱۱,۶۷۱,۹۶۷	۴,۰۵۵,۰۰۰	مربحه نانوفناوران داروئی الوند (نانوالوند ۰۸)
۰	۰	۰	۰	اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح قطار شهری
۰	۰	۰	۰	اوراق مشارکت شهرداری شیراز مربوط به طرح حمل و نقل عمومی (اتوبوس)
۱۸,۷۷۹,۶۶۲,۰۴۰	۲۰,۳۲۴	۱۲۴,۳۷۶,۴۸۷,۸۱۳	۲۱,۹۵۸	قرارداد اختیار معامله شمش طلا (GB)
۱۰۹,۳۲۲,۶۶۵	۸۲	۱۰,۱۰۴,۸۸۸,۴۱۲	۸,۳۶۳	سلف استاندارد لوله جلاگروز (عموتور)
۵۲۵,۵۸۱,۷۳۵,۲۱۵	۱۳۹,۶۷۷	۱,۲۶۳,۰۹۸,۳۷۰,۴۱۸	۳۵۱,۵۴۵	گواهی شمش روی Zinc Ingot
۲۳۵,۹۵۵,۱۶۸,۶۹۳	۴۸۷,۹۳۲	۲۲۱,۴۸۸,۵۳۶,۴۴۴	۴۹۵,۲۳۷	گواهی میلگرد Steel Rebar
۸۱,۷۷۱,۷۳۰,۷۰۸	۲۱,۳۴۱	۹۰,۵۴۲,۵۷۶,۷۶۷	۳۰,۳۱۵	گواهی سپرده خود رو ۹T ۹KMCT
۲,۹۹۹,۲۲۱	۴,۰۰۲	۴۶۶,۹۶۹,۹۴۳	۶۳۰,۴۶۸	تولید برق ماهتاب کهنج
۰	۰	۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰	مربحه مدی تک سیس ۱۴۰۸۱۲۲۵ (مدی تک ۰۸)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه‌گذار

گزارش عملکرد

دوره مالی نه‌ماهه منتهی به ۳۱ فروردین ماه ۱۴۰۵

فروش		خرید		
مبلغ کل (ریال)	تعداد	مبلغ کل (ریال)	تعداد	نماد
۰	۰	۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۰۰	مراجعه صنایع پزشکی فارمد ۰۸۱۲۲۶ (فارمد ۰۸)
۸۹,۹۸۷,۷۵۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰	صکوک مراجعه قرن ۰۶۱۲ - بدون ضامن (صقرن ۰۶۱۲)
۰	۰	۳,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳,۰۰۰	صکوک اجاره داترا ۰۹۰۱۱ - ۳ ماهه ۲۳٪ (صاترا ۰۹۰۱۱)