



صندوق اختصاصی بازارگردانی  
الگوریتم سرآمد بازار

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

| ۱۴۰۰/۱۱/۳۰           |                   |                   |          |             | تغییرات طی دوره |             |                   |             | ۱۴۰۰/۱۰/۳۰      |                 |            |                             |
|----------------------|-------------------|-------------------|----------|-------------|-----------------|-------------|-------------------|-------------|-----------------|-----------------|------------|-----------------------------|
| درصد به کل دارایی ها | خالص ارزش فروش    | بهای تمام شده     | قیمت     | تعداد       | فروش طی دوره    |             | خرید طی دوره      |             | خالص ارزش فروش  | بهای تمام شده   | تعداد      | شرکت                        |
|                      |                   |                   | بازار هر |             |                 |             |                   |             |                 |                 |            |                             |
| ۶۹.۷۲                | ۱,۳۶۵,۵۰۷,۷۲۰,۶۱۹ | ۱,۳۱۳,۱۳۰,۰۰۰,۳۶۲ | ۳۰,۵۰۰   | ۶۱,۷۷۹,۰۳۶  | ۶۵,۹۹۸,۲۰۵,۲۸۹  | -۳,۲۱۳,۲۳۵  | ۱,۳۷۶,۰۹۱,۳۱۶,۳۹۵ | ۶۴,۹۹۲,۲۷۱  | .               | .               | .          | سپید ماکیان                 |
| ۱۳.۱۸                | ۲۳۹,۲۳۸,۵۱۲,۶۴۱   | ۲۴۲,۵۹۶,۴۲۳,۳۲۰   | ۲,۶۳۲    | ۹۰,۹۶۵,۳۲۵  | ۴,۳۱۸,۱۴۵,۴۴۰   | -۱,۵۴۰,۲۱۴  | ۲۴۶,۶۶۹,۴۵۶,۹۹۳   | ۹۲,۵۰۵,۴۳۹  | .               | .               | .          | گروه صنایع کاغذ پارس        |
| ۶.۱۴                 | ۱۱۱,۳۷۲,۳۹۸,۴۷۶   | ۱۴۲,۴۷۱,۳۷۷,۶۳۰   | ۳,۸۶۷    | ۲۸,۸۲۲,۶۰۳  | ۳۳,۱۲۲,۱۹۵,۱۳۲  | -۸,۹۷۰,۰۰۰  | ۵,۶۴۷,۳۰۷,۴۹۱     | ۱,۵۱۲,۹۱۰   | ۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹ | ۱۸۱,۵۶۸,۴۳۲,۷۴۱ | ۳۶,۲۷۹,۶۹۳ | تولیدی فولاد سپید فراب کویر |
| ۸۹.۰۴                | ۱,۶۱۶,۱۱۸,۵۳۱,۷۳۶ | ۱,۵۹۸,۱۹۷,۷۰۱,۳۱۲ |          | ۱۸۱,۵۶۶,۸۶۴ | ۱۰۳,۴۳۸,۵۴۵,۸۶۱ | -۱۳,۷۲۳,۴۴۹ | ۱,۵۲۸,۴۰۷,۹۸۰,۸۷۹ | ۱۵۹,۰۱۰,۶۲۰ | ۱۴۰,۶۹۴,۴۷۸,۹۳۹ | ۱۸۱,۵۶۸,۴۳۲,۷۴۱ | ۳۶,۲۷۹,۶۹۳ | جمع کل                      |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۱-۲- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| سپرده های بانکی                                 | مشخصات حساب بانکی |                 |                   |                    | تغییرات طی دوره       |                        | ۱۴۰۰/۱۱/۳۰             |                        | درصد به کل دارایی ها |
|-------------------------------------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|------------------------|----------------------|
|                                                 | شماره حساب        | نوع سپرده       | تاریخ افتتاح حساب | نرخ سود علی الحساب | مبلغ                  | افزایش                 | کاهش                   | مبلغ                   |                      |
| سپرده کوتاه مدت- ۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد | ۳۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۱۱/۱۳        | ۰.۰۰               | ۰                     | ۱۶۰,۸۲۱,۲۴۹,۸۶۲        | ۲۸,۶۴۰,۸۳۵,۳۲۵         | ۱۳۲,۱۸۰,۴۱۴,۵۳۷        | ۷.۲۸                 |
| سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا   |                   |                 |                   | ۰.۰۰               | ۷۰,۲۵۳,۷۵۹,۰۰۸۴       | ۱۲۰,۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶        | ۱۲۳,۹۸۶,۷۰۵,۳۳۷        | ۶۶,۸۴۱,۷۷۹,۷۱۳         | ۳.۶۸                 |
| سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر    | ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳     | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۹/۲۹        | ۰.۰۰               | ۷۹۹,۷۲۲,۴۶۷           | ۱۹,۸۹۰,۳۳۸,۰۲۶         | ۱,۰۸۵,۹۸۶,۹۲۹          | ۱۹,۶۰۴,۰۷۳,۵۶۴         | ۱.۰۸                 |
| <b>جمع کل</b>                                   |                   |                 |                   |                    | <b>۷۱,۰۵۳,۴۸۱,۵۵۱</b> | <b>۳۰۱,۲۸۶,۳۱۳,۸۵۴</b> | <b>۱۵۳,۷۱۳,۵۲۷,۵۹۱</b> | <b>۲۱۸,۶۲۶,۲۶۷,۸۱۴</b> | <b>۱۲.۰۴</b>         |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| شرح                                                     | یادداشت | مبلغ           | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی ها |
|---------------------------------------------------------|---------|----------------|--------------------|----------------------|
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام       | ۱-۲     | ۹,۶۵۹,۳۳۶,۲۰۰  | ۹۱.۴۵              | ۰.۵۳                 |
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده | ۲-۲     | ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰    | ۸.۵۵               | ۰.۰۵                 |
| جمع کل                                                  |         | ۱۰,۵۶۲,۸۲۸,۷۵۰ | ۱۰۰.۰۰             | ۰.۵۸                 |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| ۱۴۰۰/۱۱/۳۰  |             |             | طی دوره     |             |             | نرخ سود علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت سود | شرح                                          |
|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|------------------|----------------------------------------------|
| خالص درآمد  | هزینه تنزیل | درآمد سود   | خالص درآمد  | هزینه تنزیل | درآمد سود   |                    |              |                  |                                              |
| ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰ | ۰           | ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰ | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶ | ۰           | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶ | ۰.۰۰               | ۱۴۰۱/۰۹/۲۹   | ۱۴۰۱/۰۹/۲۹       | سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا |
| ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰ | ۰           | ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰ | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶ | ۰           | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶ |                    |              |                  | جمع کل                                       |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| ۱۴۰۰/۱۱/۳۰                                                                                                                 |                   |                        |                         | طی دوره               |                        |                        |                         |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|------------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|
| شرح                                                                                                                        | تعداد             | خالص ارزش فروش         | سود و زیان ناشی از فروش | تعداد                 | خالص ارزش فروش         | ارزش دفتری             | سود و زیان ناشی از فروش |
| سپید ماکیان                                                                                                                | ۳,۲۱۳,۲۳۵         | ۶۵,۹۹۸,۲۰۵,۲۸۹         | ۶۲,۹۱۱,۰۱۹,۶۳۲          | ۳,۰۸۷,۱۸۵,۶۵۷         | ۶۲,۹۱۱,۰۱۹,۶۳۲         | ۶۲,۹۱۱,۰۱۹,۶۳۲         | ۳,۰۸۷,۱۸۵,۶۵۷           |
| گروه صنایع کاغذ پارس                                                                                                       | ۱,۵۴۰,۲۱۴         | ۴,۳۱۸,۱۴۵,۴۴۰          | ۴,۰۶۹,۷۴۹,۴۶۰           | ۲۴۸,۳۹۵,۹۸۰           | ۴,۳۱۸,۱۴۵,۴۴۰          | ۴,۰۶۹,۷۴۹,۴۶۰          | ۲۴۸,۳۹۵,۹۸۰             |
| تولیدی فولاد سپید فراب کویر                                                                                                | ۸,۹۷۰,۰۰۰         | ۳۳,۱۲۲,۱۹۵,۱۳۲         | ۴۴,۷۱۹,۲۷۰,۹۹۳          | -۱۱,۵۹۷,۰۷۵,۸۶۱       | ۳۳,۱۲۲,۱۹۵,۱۳۲         | ۴۴,۷۱۹,۲۷۰,۹۹۳         | -۱۱,۵۹۷,۰۷۵,۸۶۱         |
| <b>جمع کل</b>                                                                                                              | <b>۱۳,۷۲۳,۴۴۹</b> | <b>۱۰۳,۴۳۸,۵۴۵,۸۶۱</b> | <b>۱۰۳,۴۳۸,۵۴۵,۸۶۱</b>  | <b>-۸,۲۶۱,۴۹۴,۲۲۴</b> | <b>۱۰۳,۴۳۸,۵۴۵,۸۶۱</b> | <b>۱۱۱,۷۰۰,۰۴۰,۰۸۵</b> | <b>-۸,۲۶۱,۴۹۴,۲۲۴</b>   |
| ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره |                   |                        |                         |                       |                        |                        |                         |



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۲-۱- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

| ۱۴۰۰/۱۱/۳۰                  |                |                  |                 |                | طی دوره             |                |                  |                |                 |                     |
|-----------------------------|----------------|------------------|-----------------|----------------|---------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|---------------------|
| سهام                        | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش      | جمع مبلغ       | درصد از کل درآمد ها | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | جمع مبلغ        | درصد از کل درآمد ها |
| سپید ماکیان                 | ۰              | ۵۲,۳۷۷,۷۲۰,۳۵۷   | ۳,۰۸۷,۱۸۵,۶۵۷   | ۵۵,۴۶۴,۹۰۵,۹۱۴ | ۱۰۹.۷۶              | ۰              | ۵۲,۳۷۷,۷۲۰,۳۵۷   | ۳,۰۸۷,۱۸۵,۶۵۷  | ۵۵,۴۶۴,۹۰۵,۹۱۴  | ۵۷۴.۲۱              |
| گروه صنایع کاغذ پارس        | ۰              | -۳,۳۵۷,۹۱۰,۶۷۹   | ۲۴۸,۳۹۵,۹۸۰     | -۳,۱۰۹,۵۱۴,۶۹۹ | -۶.۱۵               | ۰              | -۳,۳۵۷,۹۱۰,۶۷۹   | ۲۴۸,۳۹۵,۹۸۰    | -۳,۱۰۹,۵۱۴,۶۹۹  | -۳۲.۱۹              |
| تولیدی فولاد سپید فراب کویر | ۰              | ۹,۷۷۴,۹۷۴,۶۴۸    | -۱۱,۵۹۷,۰۷۵,۸۶۱ | -۱,۸۲۲,۱۰۱,۲۱۳ | -۳.۶۱               | ۰              | -۱۱,۵۹۷,۰۷۵,۸۶۱  | -۱,۸۲۲,۱۰۱,۲۱۳ | -۴۲,۶۹۶,۰۵۵,۰۱۵ | -۴۴۲.۰۲             |
| جمع کل                      | ۰              | ۵۸,۷۹۴,۷۸۴,۲۲۶   | -۸,۲۶۱,۴۹۴,۲۲۴  | ۵۰,۵۳۳,۲۹۰,۰۰۲ | ۱۰۰.۰۰              | ۰              | ۱۷,۹۲۰,۸۳۰,۴۲۴   | -۸,۲۶۱,۴۹۴,۲۲۴ | ۹,۶۵۹,۳۳۶,۲۰۰   | ۱۰۰.۰۰              |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۲-۳- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

| نام سپرده بانکی                              |            | طی دوره           |                     | ۱۴۰۰/۱۱/۳۰        |                     |
|----------------------------------------------|------------|-------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| نام سپرده                                    | شماره حساب | سود سپرده بانکی و | درصد سود به میانگین | سود سپرده بانکی و | درصد سود به میانگین |
|                                              |            | گواهی سپرده       | سپرده               | گواهی سپرده       | سپرده               |
| سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر چکاپا |            | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶       | ۱۰۰.۰۰              | ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰       | ۱۰۰.۰۰              |
| جمع کل                                       |            | ۵۷۴,۷۲۵,۹۶۶       | ۱۰۰.۰۰              | ۹۰۳,۴۹۲,۵۵۰       | ۱۰۰.۰۰              |