

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۱- سرمایه گذاری ها

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

۱۴۰۰/۱۲/۲۹				تغییرات طی دوره				۱۴۰۰/۱۱/۳۰			شرکت
خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
درصد به کل دارایی ها				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۱۵۰	۵۰,۴۶۲,۷۶۶,۹۲۳	۵۹,۳۷۷,۱۹۶,۳۶۶	۱۰,۰۰۹۳	-	-	۵۰,۲۹۴,۴۲۸,۴۳۷	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	-	-	-	صندوق س. بازند پایدار سپهر
۱۴,۲۵	۲۸۲,۶۳۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۸۱,۶۹۷,۴۵۶,۷۰۳	۱۰,۰۰۹۴	-	-	۲۸۱,۶۹۷,۴۵۶,۷۰۳	۲۸,۰۰۰,۰۰۰	-	-	-	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۶۱,۶۳	۱,۲۲۲,۲۸۰,۵۹۲,۷۹۳	۱,۳۳۰,۴۸۶,۴۰۸,۲۵۹	۱۸,۱۷۰	۷۵,۰۹۵,۶۸۷,۲۵۹	-۳,۸۹۲,۶۳۶	۱۸۳,۷۶۲,۱۷۶,۰۵۵	۹,۴۳۳,۹۲۱	۱,۲۶۵,۵۰۷,۷۲۰,۶۱۹	۱,۳۱۳,۱۳۰,۰۰۰,۳۶۲	۶۱,۷۷۹,۰۳۶	سپید ماکیان
۱۴,۹۶	۲۹۶,۶۴۴,۰۴۳,۶۷۰	۲۷۹,۱۳۶,۰۳۵,۹۶۰	۲,۸۵۶	۱۲,۶۴۲,۷۷۲,۵۴۲	-۴,۴۰۴,۳۹۸	۴۸,۴۲۹,۹۳۹,۸۴۴	۱۷,۳۸۵,۱۳۴	۲۳۹,۲۳۸,۵۱۲,۶۴۱	۲۴۲,۵۹۶,۴۲۳,۳۲۰	۹۰,۹۶۵,۲۲۵	گروه صنایع کاغذ پارس
۵,۷۹	۱۱۴,۸۳۳,۰۴۹,۰۸۷	۱۳۶,۰۵۲,۵۴۷,۲۵۳	۴,۰۶۹	۱۴,۷۲۵,۱۰۸,۵۵۱	-۳,۸۷۰,۰۰۰	۱۲,۳۹۸,۱۲۱,۳۷۲	۳,۲۹۰,۳۰۴	۱۱۱,۳۷۲,۲۹۸,۴۷۶	۱۴۲,۴۷۱,۲۷۷,۶۳۰	۲۸,۸۲۲,۶۰۳	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
۱۰۱,۷۳	۲,۰۱۷,۳۱۵,۲۱۹,۳۹۶	۲,۱۱۸,۰۶۱,۳۰۵,۰۴۹		۲۴۷,۵۰۹,۱۸۹	۱۰۲,۴۶۳,۵۶۸,۳۵۲	-۱۲,۱۶۷,۰۳۴	۶۲۶,۸۷۶,۵۵۰,۷۴۸	۱,۶۱۶,۱۱۸,۵۳۱,۷۳۶	۱,۵۹۸,۱۹۷,۷۰۱,۳۱۲	۱۸۱,۵۶۶,۸۶۴	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

اطلاعات آماری مرتبط با اوراق اختیار فروش تبعی خریداری شده توسط صندوق سرمایه گذاری:

۱۴۰۰/۱۲/۲۹				۱۴۰۰/۱۱/۳۰				
نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ سود مؤثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نام سهام
		.	.			.	.	
		.				.		جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت یور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

مشخصات حساب بانکی								
تغییرات طی دوره		۱۴۰۰/۱۱/۳۰						
۱۴۰۰/۱۲/۲۹								
مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۰.۳۶	۷,۰۵۹,۴۲۷,۶۵۸	۵۸۹,۶۳۲,۴۴۱,۶۴۵	۴۶۴,۵۰۱,۴۵۴,۷۶۶	۱۳۲,۱۸۰,۴۱۴,۵۳۷	۰.۰۰	۱۴۰۰/۱۱/۱۳	سپرده کوتاه مدت	سپرده کوتاه مدت-۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد
۰.۰۳	۶۷۴,۳۸۷,۸۶۳	۷۰,۸۹۲,۸۵۲,۶۷۷	۴,۷۲۵,۴۶۰,۸۲۷	۶۶,۸۴۱,۷۷۹,۷۱۳	۰.۰۰			سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۰.۰۵	۹۷۰,۲۴۰,۳۷۷	۴۰,۸۸۹,۸۲۳,۰۲۴	۲۲,۲۵۵,۹۸۹,۸۳۷	۱۹,۶۰۴,۰۷۳,۵۶۴	۰.۰۰	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر
۰.۴۴	۸,۷۰۴,۰۵۵,۸۹۸	۷۰۱,۴۰۵,۱۱۷,۳۴۶	۴۹۱,۴۸۲,۹۰۵,۴۳۰	۲۱۸,۶۲۶,۲۶۷,۸۱۴				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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	۱۰۲,۱۳۶,۳۵۸,۴۲۴-	۰.۰۰	۵.۱۵-
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۲	۱,۴۶۷,۵۴۹,۸۷۵	۰.۰۰	۰.۰۷
جمع کل		۱۰۰,۶۶۸,۸۰۸,۵۴۹-	۰.۰۰	۵.۰۸-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

درآمد سود سهام

۱۴۰۰/۱۲/۲۹			طی دوره			اطلاعات مجمع			نام سهام
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	
۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	۱,۴۸۲,۲۳۹,۱۲۸	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵	۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	-۱,۴۸۲,۲۳۹,۱۲۸	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵	۱۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	گروه صنایع کاغذ پارس
۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	۱,۴۸۲,۲۳۹,۱۲۸	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵	۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	-۱,۴۸۲,۲۳۹,۱۲۸	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۰/۱۲/۲۹			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۳,۲۸۷	۰	۳,۲۸۷	۳,۲۸۷	۰	۳,۲۸۷	۰.۰۰	۱۴۰۱/۱۱/۱۳	۱۴۰۰/۱۲/۱۱	سپرده کوتاه مدت-۱-۱۵۱۵۵۹۴۰-بانک پاسارگاد
۱,۴۵۸,۳۳۵,۱۹۱	۰	۱,۴۵۸,۳۳۵,۱۹۱	۵۵۴,۷۴۲,۶۴۱	۰	۵۵۴,۷۴۲,۶۴۱	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکابا
۹,۳۱۱,۳۹۷	۰	۹,۳۱۱,۳۹۷	۹,۳۱۱,۳۹۷	۰	۹,۳۱۱,۳۹۷	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۶۵۳-بانک شهر-کویر
۱,۴۶۷,۵۴۹,۸۷۵	۰	۱,۴۶۷,۵۴۹,۸۷۵	۵۶۴,۰۵۷,۳۲۵	۰	۵۶۴,۰۵۷,۳۲۵				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۰/۱۲/۲۹					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	
۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	۲۰,۷۶۵,۹۱۸,۳۸۹	۸۶۲,۰۶۱,۵۰۵	۳۳,۱۳۸,۹۸۵,۸۹۱	۰.۰۰	۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	۲۰,۷۶۵,۹۱۸,۳۸۹	۸۶۲,۰۶۱,۵۰۵	۳۳,۱۳۸,۹۸۵,۸۹۱	۰.۰۰	گروه صنایع کاغذ پارس
۰	۱۶۸,۳۳۸,۴۸۶	۰	۱۶۸,۳۳۸,۴۸۶	۰.۰۰	۰	۱۶۸,۳۳۸,۴۸۶	۰	۱۶۸,۳۳۸,۴۸۶	۰.۰۰	صندوق س. پازند پایدار سپهر
۰	۹۳۴,۵۴۳,۲۹۷	۰	۹۳۴,۵۴۳,۲۹۷	۰.۰۰	۰	۹۳۴,۵۴۳,۲۹۷	۰	۹۳۴,۵۴۳,۲۹۷	۰.۰۰	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۰	-۱۵۰,۵۸۳,۵۳۵,۷۲۳	-۱,۲۵۲,۹۶۴,۰۵۱	-۱۵۱,۸۳۶,۴۹۹,۷۷۴	۰.۰۰	۰	-۱۵۱,۸۳۶,۴۹۹,۷۷۴	-۱,۲۵۲,۹۶۴,۰۵۱	-۱۵۱,۸۳۶,۴۹۹,۷۷۴	۰.۰۰	سپید ماکیان
۰	۹,۸۷۹,۴۸۰,۹۸۸	-۴,۰۸۰,۵۴۳,۵۱۲	۵,۷۹۸,۹۳۷,۴۷۶	۰.۰۰	۰	۹,۸۷۹,۴۸۰,۹۸۸	-۴,۰۸۰,۵۴۳,۵۱۲	۵,۷۹۸,۹۳۷,۴۷۶	۰.۰۰	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	-۱۱۸,۸۲۵,۲۵۴,۵۶۳	-۴,۴۷۱,۴۴۶,۰۵۸	-۱۱۱,۷۹۵,۶۹۴,۶۲۴	۰.۰۰	۱۱,۵۱۱,۰۰۵,۹۹۷	-۱۱۸,۸۲۵,۲۵۴,۵۶۳	-۴,۴۷۱,۴۴۶,۰۵۸	-۱۱۱,۷۹۵,۶۹۴,۶۲۴	۰.۰۰	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۰/۱۲/۲۹		طی دوره		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۰.۰۰	۳,۲۸۷	۰.۰۰	۳,۲۸۷	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	سپرده کوتاه مدت-۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد
۹۹.۳۷	۱,۴۵۸,۲۳۵,۱۹۱	۹۸.۳۵	۵۵۴,۷۴۲,۶۴۱		سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۰.۶۳	۹,۳۱۱,۳۹۷	۱.۶۵	۹,۳۱۱,۳۹۷	۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر
۱۰۰.۰۰	۱,۴۶۷,۵۴۹,۸۷۵	۱۰۰.۰۰	۵۶۴,۰۵۷,۳۲۵		جمع کل