



## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

| ۱۴۰۱/۰۱/۳۱ |                   |                   |        |             | تغییرات طی دوره |              |                 |           |                   | ۱۴۰۰/۱۲/۲۹        |             |             |             |                                |
|------------|-------------------|-------------------|--------|-------------|-----------------|--------------|-----------------|-----------|-------------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|--------------------------------|
| ۰.۸۱٪      | ۱۸,۲۳۸,۹۳۵,۵۵۸    | ۱۸,۰۸۳,۱۴۳,۹۵۲    | ۴۳,۶۴۲ | ۴۱۸,۰۰۰     | -               | -            | ۱۸,۰۸۳,۱۴۳,۹۵۲  | ۴۱۸,۰۰۰   | -                 | -                 | -           | -           | -           | صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د |
| ۱.۱۳٪      | ۲۵,۳۸۲,۳۸۲,۴۴۲    | ۲۵,۳۰۳,۸۴۱,۱۲۷    | ۱۰,۰۹۲ | ۲,۵۱۵,۵۷۱   | ۲۴,۹۱۱,۳۶۰,۶۹۸  | (۲,۴۸۴,۴۳۹)  | -               | -         | ۲۰,۷۷۴,۱۶۸,۷۴۰    | ۲۰,۷۰۴,۸۶۸,۳۹۷    | ۵,۰۰۰,۰۰۰   | ۵,۰۰۰,۰۰۰   | ۵,۰۰۰,۰۰۰   | صندوق س. پارتد پایدار سپهر     |
| ۱۲.۳۳٪     | ۲۷۶,۵۷۶,۱۴۰,۳۹۶   | ۲۷۵,۷۱۳,۳۱۷,۳۸۷   | ۱۰,۰۹۴ | ۲۷,۴۰۵,۱۹۲  | ۶,۰۰۰,۴۱۲,۲۰۹   | (۵۹۴,۸۰۸)    | -               | -         | ۲۸۲,۶۲۲,۰۰۰,۰۰۰   | ۲۸۱,۶۹۷,۴۵۶,۷۰۳   | ۲۸,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۸,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۸,۰۰۰,۰۰۰  | صندوق س. با درآمد ثابت کمند    |
| ۶۱.۴۴٪     | ۱,۳۷۷,۹۰۴,۹۷۱,۱۲۸ | ۱,۲۶۰,۱۱۹,۹۹۴,۶۰۹ | ۳۱,۴۵۰ | ۶۴,۲۸۶,۸۵۲  | ۱۲۱,۵۰۷,۳۱۸,۴۲۰ | (۵,۹۹۲,۵۵۶)  | ۵۷,۰۹۱,۰۴۸,۸۹۰  | ۲,۹۵۹,۰۸۷ | ۱,۲۲۲,۲۸۰,۵۹۲,۷۹۳ | ۱,۲۲۰,۴۸۶,۴۰۸,۲۵۹ | ۶۷,۳۲۰,۳۲۱  | ۶۷,۳۲۰,۳۲۱  | ۶۷,۳۲۰,۳۲۱  | سپید ماکیان                    |
| ۱۴.۷۳٪     | ۳۳۰,۰۰۰,۸۷۸,۲۲۲   | ۲۸۱,۰۰۵,۰۶۴,۴۱۰   | ۳,۱۶۳  | ۱۰۴,۴۱۰,۹۶۱ | ۴۰۷,۱۸۵,۱۱۹     | (۱,۳۷۱,۵۱۱)  | ۵,۴۵۹,۱۵۸,۰۷۷   | ۱,۸۳۶,۵۱۱ | ۲۹۶,۶۴۴,۰۴۳,۶۷۰   | ۲۷۹,۲۲۶,۰۳۵,۹۶۰   | ۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱ | ۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱ | ۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱ | گروه صنایع کاغذ پارس           |
| ۵.۲۸٪      | ۱۲۰,۷۴۹,۶۲۲,۰۶۲   | ۱۴۰,۲۲۸,۱۸۰,۹۹۷   | ۴,۰۹۷  | ۲۹,۴۹۵,۱۰۹  | ۳,۶۳۱,۹۷۶,۶۲۵   | (۸۹۷,۳۲۶)    | ۸,۴۶۷,۹۴۵,۰۹۵   | ۲,۱۴۹,۵۲۸ | ۱۱۴,۸۲۳,۰۴۹,۰۸۷   | ۱۲۶,۰۵۲,۵۴۷,۲۵۳   | ۲۸,۲۴۲,۹۰۷  | ۲۸,۲۴۲,۹۰۷  | ۲۸,۲۴۲,۹۰۷  | تولیدی فولاد سپید فراب کویر    |
| ۹۵.۸۲٪     | ۲,۲۲۵,۰۰۰,۰۷۷,۰۴۴ | ۲,۰۷۶,۳۶۵,۰۶۵,۸۶۳ |        | ۲۴۶,۱۴۰,۶۸۲ | ۳۳۴,۵۰۲,۴۰۷,۹۵۷ | (۲۸,۷۳۱,۶۳۳) | ۸۹,۱۰۱,۲۹۶,۰۰۱۴ | ۷,۳۶۳,۱۲۶ | ۲,۱۱۸,۲۴۰,۷۵۳,۲۴۲ | ۲,۲۱۸,۶۵۰,۱۶۱,۹۲۳ | ۲۶۷,۵۰۹,۱۸۹ | ۲۶۷,۵۰۹,۱۸۹ | ۲۶۷,۵۰۹,۱۸۹ | جمع کل                         |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت بورتقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| مشخصات حساب بانکی                                    |  |                     |                 |                   |                    |               |                |                |                | ۱۴۰۰/۱۲/۲۹           |  | تغییرات طی دوره |  | ۱۴۰۱/۰۱/۳۱ |  |
|------------------------------------------------------|--|---------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------------|--|-----------------|--|------------|--|
| سپرده های بانکی                                      |  | شماره حساب          | نوع سپرده       | تاریخ افتتاح حساب | نرخ سود علی الحساب | مبلغ          | افزایش         | کاهش           | مبلغ           | درصد به کل دارایی ها |  |                 |  |            |  |
| سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکابا         |  | ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰       | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۹/۰۷        | -                  | ۶۷۴,۳۸۷,۸۶۳   | ۱,۸۵۲,۱۷۹,۰۷۸  | ۵۰۴,۶۲۵,۶۸۹    | ۲,۰۲۱,۹۴۱,۳۵۲  | ۰.۰۹٪                |  |                 |  |            |  |
| سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر          |  | ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳       | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۹/۲۹        | -                  | ۹۷۰,۲۴۰,۳۷۷   | ۵۶۵,۵۹۷,۳۹۲    | ۱,۳۵۷,۲۵۴,۴۵۲  | ۱۷۸,۵۸۳,۳۱۷    | ۰.۰۱٪                |  |                 |  |            |  |
| سپرده کوتاه مدت-۲۹۰-۸۱۰۰-۱۵۱۵۵۹۴۰-بانک پاسارگاد-سپید |  | ۲۹۰-۸۱۰۰-۱۵۱۵۵۹۴۰-۱ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۱۱/۱۳        | -                  | ۷۰,۵۹,۴۲۷,۶۵۸ | ۲۹,۲۲۷,۰۷۸,۱۲۳ | ۲۶,۳۰۴,۴۷۸,۷۵۹ | ۹,۹۸۲,۰۲۷,۰۲۲  | ۰.۴۵٪                |  |                 |  |            |  |
| جمع کل                                               |  |                     |                 |                   |                    | ۸,۷۰۴,۰۵۵,۸۹۸ | ۳۱,۶۴۴,۸۵۴,۵۹۳ | ۲۸,۱۶۶,۳۵۸,۹۰۰ | ۱۲,۱۸۲,۵۵۱,۵۹۱ | ۰.۵۴٪                |  |                 |  |            |  |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

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     | ۱۵۱,۰۷۴,۲۰۹,۶۰۷ | ۰.۹۶               | ۰.۰۷                 |
| سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی      |         | ۶,۸۶۶,۸۵۰,۹۷۹   | ۰.۰۴               | ۰.۰۰                 |
| جمع کل                                            |         | ۱۵۷,۹۴۱,۰۶۰,۵۸۶ | ۱.۰۰               | ۰.۰۷                 |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| ۱۴۰۱/۰۱/۳۱    |             |               | طی دوره       |             |               | نرخ سود علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت سود | شرح                                                 |
|---------------|-------------|---------------|---------------|-------------|---------------|--------------------|--------------|------------------|-----------------------------------------------------|
| خالص درآمد    | هزینه تنزیل | درآمد سود     | خالص درآمد    | هزینه تنزیل | درآمد سود     |                    |              |                  |                                                     |
| ۱,۴۵۸,۲۳۵,۱۹۱ | -           | ۱,۴۵۸,۲۳۵,۱۹۱ | -             | -           | -             | ۱۰                 | -            | یکم هر ماه       | سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا         |
| ۹,۳۱۱,۳۹۷     | -           | ۹,۳۱۱,۳۹۷     | -             | -           | -             | ۱۰                 | -            | یکم هر ماه       | سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کوبیر         |
| ۱۴,۰۸۸,۰۵۷    | -           | ۱۴,۰۸۸,۰۵۷    | -             | -           | -             | ۱۰                 | -            | سیزدهم هر ماه    | سپرده کوتاه مدت-۲۹۰-۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰-بانک پاسارگاد-سپید |
| ۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲   | -           | ۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲   | ۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲   | -           | ۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲   | -                  | -            | -                | صندوق س. پارتد پایدار سپهر                          |
| ۴۷۱,۶۶۱,۰۳۸   | -           | ۴۷۱,۶۶۱,۰۳۸   | ۴۷۱,۶۶۱,۰۳۸   | -           | ۴۷۱,۶۶۱,۰۳۸   | -                  | -            | -                | صندوق س. پارتد پایدار سپهر                          |
| ۴,۶۱۸,۴۱۷,۰۶۴ | -           | ۴,۶۱۸,۴۱۷,۰۶۴ | ۴,۶۱۸,۴۱۷,۰۶۴ | -           | ۴,۶۱۸,۴۱۷,۰۶۴ | -                  | -            | -                | صندوق س. با درآمد ثابت کمند                         |
| ۶,۸۶۶,۸۵۰,۹۷۹ | -           | ۶,۸۶۶,۸۵۰,۹۷۹ | ۵,۳۸۵,۲۱۶,۳۳۴ | -           | ۵,۳۸۵,۲۱۶,۳۳۴ |                    |              |                  | جمع کل                                              |

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار**

## صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

**سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار**

| ۱۴۰۱/۰۱/۳۱                                                                                                                |                 |                 |            | طی دوره                 |                 |                 |            |                             |  |  |  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-----------------|------------|-------------------------|-----------------|-----------------|------------|-----------------------------|--|--|--|
| سود و زیان ناشی از فروش                                                                                                   | ارزش دفتری      | خالص ارزش فروش  | تعداد      | سود و زیان ناشی از فروش | ارزش دفتری      | خالص ارزش فروش  | تعداد      | شرح                         |  |  |  |
| ۵,۹۷۶,۴۹۲,۱۸۶                                                                                                             | ۲۵۶,۶۲۴,۷۱۸,۷۸۲ | ۲۶۲,۶۰۱,۲۱۰,۹۶۸ | ۱۳,۰۹۸,۴۲۷ | ۴,۱۴۲,۲۷۰,۵۸۰           | ۱۱۷,۳۶۵,۰۴۷,۸۴۰ | ۱۲۱,۵۰۷,۳۱۸,۴۲۰ | ۵,۹۹۲,۵۵۶  | سپید ماکیان                 |  |  |  |
| ۱۷,۳۹۸,۱۷۲                                                                                                                | ۵,۹۸۴,۱۳۹,۳۱۶   | ۶,۰۰۱,۵۳۷,۴۸۸   | ۵۹۴,۸۰۸    | ۱۷,۳۹۸,۱۷۲              | ۵,۹۸۴,۱۳۹,۳۱۶   | ۶,۰۰۱,۵۳۷,۴۸۸   | ۵۹۴,۸۰۸    | صندوق س. با درآمد ثابت کمند |  |  |  |
| (۷۴,۵۵۴,۸۶۸)                                                                                                              | ۲۴,۹۹۰,۵۸۷,۳۱۰  | ۲۴,۹۱۶,۰۳۲,۴۴۲  | ۲,۴۸۴,۴۲۹  | (۷۴,۵۵۴,۸۶۸)            | ۲۴,۹۹۰,۵۸۷,۳۱۰  | ۲۴,۹۱۶,۰۳۲,۴۴۲  | ۲,۴۸۴,۴۲۹  | صندوق س. با درآمد ثابت پارس |  |  |  |
| ۱,۴۹۵,۲۳۹,۸۴۷                                                                                                             | ۱۹,۵۳۷,۴۹۳,۲۵۴  | ۲۱,۰۳۲,۷۳۳,۱۰۱  | ۷,۳۱۶,۱۲۳  | ۳۸۴,۷۸۲,۳۶۲             | ۳,۶۸۷,۰۳۲,۷۵۷   | ۴,۰۷۱,۸۱۵,۱۱۹   | ۱,۳۷۱,۵۱۱  | گروه صنایع کاغذ پارس        |  |  |  |
| (۱۶,۳۳۵,۱۹۱,۷۶۹)                                                                                                          | ۶۷,۸۱۴,۴۷۲,۰۷۷  | ۵۱,۴۷۹,۲۸۰,۳۰۸  | ۱۳,۷۳۷,۳۲۶ | (۶۵۷,۵۷۲,۳۹۶)           | ۴,۳۸۹,۵۴۹,۰۲۱   | ۳,۶۳۱,۹۷۶,۶۳۵   | ۸۹۷,۳۲۶    | تولیدی فولاد سپید فراب کویر |  |  |  |
| (۸,۹۲۰,۶۱۶,۴۳۲)                                                                                                           | ۳۷۴,۹۵۱,۶۱۰,۷۳۹ | ۳۶۶,۰۲۰,۷۹۴,۳۰۷ | ۳۷,۲۳۱,۱۱۳ | ۳,۸۱۲,۲۲۳,۸۵۰           | ۱۵۶,۳۱۶,۳۵۶,۲۴۴ | ۱۶۰,۱۲۸,۶۸۰,۰۹۴ | ۱۱,۳۴۰,۶۳۰ | جمع کل                      |  |  |  |
| 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 سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

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

| ۱۴۰۱/۰۱/۳۱     |                  |                  |                  |                     | 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 |                             |
| -              | ۷۸,۵۴۱,۳۱۵       | (۷۴,۵۵۴,۸۶۸)     | ۳,۹۸۶,۴۴۷        | ۰.۰۰٪               | -              | ۸۶۳,۸۲۲,۹۰۹      | (۷۴,۵۵۴,۸۶۸)  | (۱۶۴,۳۵۲,۰۳۹)   | -۰.۱۰٪              | صندوق س. پازند پایدار سپهر  |
| -              | ۸۶۳,۸۲۲,۹۰۹      | ۱۷,۳۹۸,۱۷۲       | ۸۸۰,۲۲۱,۰۸۱      | ۰.۵۶٪               | -              | (۱۹,۴۷۸,۵۵۸,۹۳۵) | (۷۴,۵۵۴,۸۶۸)  | (۱۶۴,۳۵۲,۰۳۹)   | -۰.۰۳٪              | صندوق س. با درآمد ثابت کمند |
| -              | ۱۵۵,۷۹۱,۶۰۶      | -                | ۱۵۵,۷۹۱,۶۰۶      | ۰.۱۰٪               | -              | ۱۱۷,۷۸۴,۹۷۶,۵۲۹  | -             | ۱۵۵,۷۹۱,۶۰۶     | -                   | صندوق اعتماد                |
| -              | ۱۱۷,۷۸۴,۹۷۶,۵۲۹  | ۵,۹۷۶,۴۹۲,۱۸۶    | ۱۲۳,۷۶۱,۴۶۸,۷۱۵  | ۷۸.۳۶٪              | -              | ۴۸,۹۹۵,۸۱۳,۸۱۲   | ۴,۱۴۲,۲۷۰,۵۸۰ | ۲۲۰,۱۳۳,۰۶۲,۵۷۵ | ۱۳۹.۳۸٪             | سپید ماکیان                 |
| -              | (۱۹,۴۷۸,۵۵۸,۹۳۵) | (۱۶,۳۳۵,۱۹۱,۷۶۹) | (۳۵,۸۱۳,۷۵۰,۷۰۴) | -۲۲.۶۸٪             | -              | ۱۱,۵۹۵,۴۳۸,۸۰۲   | (۶۵۷,۵۷۲,۳۹۶) | ۱,۰۸۳,۳۶۶,۸۳۵   | ۰.۶۹٪               | تولیدی فولاد سپید فراب کویر |
| -              | ۴۸,۹۹۵,۸۱۳,۸۱۲   | ۱,۴۹۵,۲۳۹,۸۴۷    | ۶۲,۰۸۶,۴۹۲,۴۶۲   | ۳۹.۳۱٪              | -              | ۲۰.۲۴٪           | ۳۸۴,۷۸۲,۳۶۲   | ۳۱,۹۷۲,۵۸۸,۴۶۴  | ۲۰.۲۴٪              | گروه صنایع کاغذ پارس        |
| -              | ۱۴۸,۳۹۹,۳۸۷,۲۳۶  | (۸,۹۲۰,۶۱۶,۴۳۲)  | ۱۵۱,۰۷۴,۲۰۹,۶۰۷  | ۹۶٪                 | -              | ۲۵۳,۱۲۶,۱۲۵,۲۲۵  | ۳,۸۱۲,۳۲۲,۸۵۰ | ۲۴۹,۳۱۳,۸۱۱,۳۷۵ | ۱۶.۰٪               | جمع کل                      |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۱/۳۱

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

| ۱۴۰۱/۰۱/۳۱                |                               | 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                                              |
| ۰.۰۷٪                     | ۱,۴۵۸,۲۳۵,۱۹۱                 | ۰.۰۰٪                     | -                             | ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰       | سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا           |
| ۰.۰۰٪                     | ۹,۳۱۱,۳۹۷                     | ۰.۰۰٪                     | -                             | ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳       | سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کوپر            |
| ۰.۰۰٪                     | ۱۴,۰۸۸,۰۵۷                    | ۰.۰۰٪                     | ۱۴,۰۸۸,۰۵۷                    | ۲۹۰-۸۱۰۰-۱۵۱۵۵۹۴۰-۱ | سپرده کوتاه مدت-۲۹۰-۸۱۰۰-۱۵۱۵۵۹۴۰-۱-بانک پاسارگاد-سپید |
| ۰٪                        | ۱,۴۸۱,۶۳۴,۶۴۵                 | ۰٪                        | ۱۴,۰۸۸,۰۵۷                    |                     | جمع کل                                                 |