

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

۱۴۰۱/۰۲/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۱/۳۱				
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	فروش طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	شرکت		
					تعداد	بهای تمام شده						
۰.۷۷	۱۹,۱۷۶,۴۷۰,۳۰۷	۱۸,۷۱۵,۷۴۵,۶۳۶	۴۴,۳۸۷	۴۳۲,۱۱۰	۱,۴۰۰,۰۸۹,۳۷۷	(۳۱,۵۸۰)	۲,۰۰۰,۴۰۹,۰۶۵	۴۵,۶۹۰	۱۸,۲۳۸,۹۳۵,۵۵۸	۱۸,۰۸۳,۱۴۳,۹۵۲	۴۱۸,۰۰۰	صندوق س.اعتماد آفرین پاریسان-د
۱.۲۱	۲۹,۹۲۹,۰۸۵,۸۵۱	۳۰,۰۱۵,۴۵۸,۷۱۷	۱۰,۰۰۸۹	۲,۹۶۷,۰۶۳	۳۰,۹۹۵,۴۱۳,۷۶۸	(۳۰,۹۳,۴۲۷)	۳۶,۰۰۵,۴۰۲,۱۸۹	۳,۵۴۴,۹۱۹	۲۵,۳۸۲,۳۸۲,۴۴۲	۲۵,۳۰۳,۸۴۱,۱۲۷	۲,۵۱۵,۵۷۱	صندوق س. پارد پایداری سپهر
۹.۰۲	۲۲۳,۶۷۰,۷۲۸,۸۵۳	۲۲۳,۱۳۲,۱۴۲,۱۷۳	۱۰,۰۰۹۰	۲۲,۱۷۱,۷۲۲	۱۷۴,۸۷۲,۰۹۹,۴۲۹	(۱۷,۳۴۶,۱۷۰)	۱۲۲,۰۱۸,۳۴۵,۸۲۷	۱۲,۱۱۲,۷۰۰	۲۷۶,۵۷۶,۱۴۰,۲۹۶	۲۷۵,۷۱۳,۳۱۷,۳۸۷	۲۷,۴۰۵,۱۹۲	صندوق س. با درآمد ثابت کمنده
۶۸.۹۷	۱,۷۰۹,۱۷۸,۰۰۳,۹۹۸	۱,۴۸۸,۱۷۴,۷۸۸,۸۳۲	۲۴,۰۰۵۰	۷۱,۱۴۶,۷۱۲	۴۲۵,۵۶۳,۸۲۳,۳۴۳	(۱۶,۷۴۶,۴۱۲)	۵۶۰,۳۹۱,۱۳۲,۱۷۸	۲۳,۶۰۶,۳۷۲	۱,۳۷۷,۹۰۴,۹۷۱,۱۳۸	۱,۳۶۰,۱۱۹,۹۹۴,۶۰۹	۶۴,۲۸۶,۸۵۲	سپید ماکیان
۱۴.۳۴	۳۵۵,۵۱۸,۳۳۸,۶۵۴	۲۸۴,۲۶۸,۹۹۲,۰۵۳	۳,۳۹۵	۱۰۴,۷۹۷,۸۶۱	۷,۵۵۸,۳۶۰,۹۸۷	(۲,۱۲۵,۷۰۱)	۸,۹۷۴,۷۶۲,۱۰۰	۲,۵۱۲,۶۰۱	۳۳۰,۰۰۰,۸۷۸,۲۲۲	۲۸۱,۰۰۵,۰۶۴,۴۱۰	۱۰۴,۴۱۰,۹۶۱	گروه صنایع کاغذ پارس
۳.۳۲	۸۲,۲۱۶,۹۴۴,۵۶۹	۸۸,۶۱۱,۷۰۷,۴۵۹	۴,۳۸۹	۱۸,۷۴۶,۷۴۸	۵۷,۶۵۶,۱۵۱,۴۳۸	(۱۲,۹۵۶,۷۰۴)	۹,۷۴۹,۷۴۷,۸۰۵	۲,۲۰۸,۳۴۳	۱۲۰,۷۴۹,۶۲۲,۰۶۲	۱۴۰,۲۲۸,۱۸۰,۹۹۷	۲۹,۴۹۵,۱۰۹	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
۹۷.۶۳	۲,۴۴۰,۲۸۹,۵۷۲,۲۲۲	۲,۱۳۲,۹۱۸,۸۴۴,۸۷۰		۲۲۰,۲۶۲,۲۱۶	۶۹۸,۰۴۵,۸۳۸,۳۴۲	(۵۲,۲۹۹,۹۹۴)	۷۳۹,۰۰۳,۶۹۹,۱۶۴	۴۴,۰۳۰,۵۲۵	۲,۱۴۸,۸۵۲,۹۲۹,۷۱۸	۲,۰۰۰,۴۵۲,۵۴۲,۴۸۲	۲۲۸,۵۳۱,۶۸۵	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازاریگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

مشخصات حساب بانکی		۱۴۰۱/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۰۲/۳۱	
سپرده‌های بانکی	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	مبلغ	افزایش	کاهش
سپرده کوتاه مدت- ۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۱۱/۱۳	۰.۰۰	۹,۹۸۲,۰۲۷,۰۲۲	۳۸۶,۹۵۶,۰۲۳,۵۶۹	۳۹۶,۲۶۰,۱۹۵,۷۶۴
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت		۰.۰۰	۲,۰۲۱,۹۴۱,۲۵۲	۲,۱۶۹,۲۰۰,۰۲۳	۴,۱۹۰,۲۰۷,۹۱۲
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر	۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۰.۰۰	۱۷۸,۵۸۳,۳۱۷	۶۹,۳۵۶,۴۹۴,۳۱۹	۲۴,۸۱۳,۳۴۴,۷۸۱
جمع کل					۱۲,۱۸۲,۵۵۱,۵۹۱	۴۵۸,۴۸۱,۷۱۷,۹۱۱	۴۲۵,۲۶۳,۷۴۸,۴۵۷
							۴۵,۴۰۰,۵۲۱,۰۴۵
							۱.۸۳

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

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	۳۸۲,۱۵۳,۰۹۵,۴۵۵	۹۶.۷%	۱۵.۴%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۱۱,۶۲۲,۹۴۵,۴۶۶	۲.۹%	۰.۵%
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۱,۴۸۷,۰۱۴,۹۴۶	۰.۳۸%	۰.۱%
جمع کل		۳۹۵,۲۶۳,۰۵۵,۸۶۷	۱۰۰	۱۵.۹۴%

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع			طی دوره			۱۴۰۱/۰۲/۳۱		
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل
گروه صنایع کاغذ پارس	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۲۵	۰	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵	۱,۱۷۳,۸۴۴,۵۷۵
جمع کل				۰	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵	۱,۱۷۳,۸۴۴,۵۷۵

خالص درآمد سود سهام

۱۱,۸۱۹,۴۰۰,۵۵۰

۱,۱۷۳,۸۴۴,۵۷۵

۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵

۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷

۰

۱۲۵

۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱

۱۴۰۰/۱۲/۲۵

گروه صنایع کاغذ پارس

جمع کل

۱۱,۸۱۹,۴۰۰,۵۵۰

۱,۱۷۳,۸۴۴,۵۷۵

۱۲,۹۹۳,۲۴۵,۱۲۵

۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷

۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷

۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۱/۰۲/۳۱			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۱۶,۰۴۷,۸۲۱	-	۱۶,۰۴۷,۸۲۱	۱,۹۵۹,۷۶۴	-	۱,۹۵۹,۷۶۴	۰.۰۰	۱۴۰۱/۱۱/۱۳	۱۴۰۱/۰۲/۱۲	سپرده کوتاه مدت-۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد
۱,۴۶۰,۶۷۹,۱۶۷	-	۱,۴۶۰,۶۷۹,۱۶۷	۲,۴۴۳,۹۷۶	-	۲,۴۴۳,۹۷۶	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۱۰,۲۸۷,۹۵۸	-	۱۰,۲۸۷,۹۵۸	۹۷۶,۵۶۱	-	۹۷۶,۵۶۱	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کوبر
۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲	-	۲۹۵,۱۳۸,۲۳۲	.	-	.	۰.۰۰	-	-	صندوق س. پارانید پایدار سپهر
۱,۵۲۶,۱۸۶,۳۹۸	-	۱,۵۲۶,۱۸۶,۳۹۸	۱,۰۵۴,۵۲۵,۲۶۰	-	۱,۰۵۴,۵۲۵,۲۶۰	۰.۰۰	-	-	صندوق س. پارانید پایدار سپهر
۹,۸۰۱,۶۲۰,۹۳۶	-	۹,۸۰۱,۶۲۰,۹۳۶	۵,۱۸۳,۲۰۳,۸۷۲	-	۵,۱۸۳,۲۰۳,۸۷۲	۰.۰۰	-	-	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۱۳,۱۰۹,۹۶۰,۴۱۲	-	۱۳,۱۰۹,۹۶۰,۴۱۲	۶,۲۴۳,۱۰۹,۴۳۳	-	۶,۲۴۳,۱۰۹,۴۳۳				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

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

سهام	درآمد سود سهام	طی دوره				۱۴۰۱/۰۲/۳۱			
		درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمد	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ
گروه صنایع کاغذ پارس	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۲۲,۲۵۳,۵۳۲,۷۸۹	۱,۸۵۳,۱۷۵,۰۳۸	۲۴,۳۳۰,۶۶۹,۵۷۴	۱۰.۵۳	۱۱,۸۱۹,۴۰۰,۵۵۰	۷۱,۲۴۹,۳۴۶,۶۰۱	۳,۳۴۸,۴۱۴,۸۸۵	۸۶,۴۱۷,۱۶۳,۰۳۶
صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د	-	۳۰۴,۹۳۳,۰۶۵	۳۲,۵۴۴,۵۵۹	۳۳۷,۴۷۷,۶۲۴	۰.۱۵	-	۴۶۰,۷۲۴,۶۷۱	۳۲,۵۴۴,۵۵۹	۴۹۳,۲۶۹,۲۳۰
صندوق س. پارس پایداری سپهر	-	(۱۶۴,۹۱۴,۱۸۱)	(۲۹۲,۵۵۸,۱۰۵)	(۴۵۷,۴۷۲,۲۸۶)	(۰.۲۰)	-	(۸۶,۳۷۲,۸۶۶)	(۳۶۷,۱۱۲,۹۷۳)	(۴۵۳,۴۸۵,۸۳۹)
صندوق س. با درآمد ثابت کمند	-	(۳۲۴,۲۳۶,۲۲۹)	۳۰۵,۴۷۳,۰۳۹	(۱۸,۷۶۳,۱۹۰)	(۰.۰۱)	-	۵۳۸,۵۸۶,۶۸۰	۳۲۲,۸۷۱,۲۱۱	۸۶۱,۴۵۷,۸۹۱
سپید ماکیان	-	۱۰۳,۸۱۸,۲۳۸,۶۳۷	۹۳,۶۵۱,۱۵۸,۰۰۵	۱۹۷,۴۶۹,۳۹۶,۶۴۲	۸۵.۴۶	-	۲۲۱,۶۰۳,۲۱۵,۱۶۶	۹۹,۶۲۷,۶۵۰,۱۹۱	۳۲۱,۲۳۰,۸۶۵,۳۵۷
تولیدی فولاد سپید فراب کویر	-	۱۳,۰۸۳,۷۹۶,۰۴۵	(۳,۶۶۶,۲۱۸,۵۶۱)	۹,۴۱۷,۵۷۷,۴۸۴	۴.۰۸	-	(۶,۳۹۴,۷۶۲,۸۹۰)	(۲۰,۰۰۱,۴۱۰,۳۳۰)	(۲۶,۳۹۶,۱۷۳,۲۲۰)
جمع کل	۲۲۳,۹۶۱,۷۴۷	۱۳۸,۹۷۱,۲۵۰,۱۲۶	۹۱,۸۸۳,۵۷۳,۹۷۵	۲۳۱,۰۷۸,۸۸۵,۸۴۸	۱۰۰	۱۱,۸۱۹,۴۰۰,۵۵۰	۲۸۷,۳۷۰,۷۳۷,۳۶۲	۸۲,۹۶۲,۹۵۷,۵۴۳	۳۸۲,۱۵۳,۰۹۵,۴۵۵

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۲/۳۱

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

۱۴۰۱/۰۲/۳۱		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
۱۰۰۸	۱۶,۰۴۷,۸۲۱	۳۶.۴۲	۱,۹۵۹,۷۶۴	۳۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	سپرده کوتاه مدت-۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد
۹۸.۲۳	۱,۴۶۰,۶۷۹,۱۶۷	۴۵.۴۲	۲,۴۴۳,۹۷۶	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۰.۶۹	۱۰,۲۸۷,۹۵۸	۱۸.۱۵	۹۷۶,۵۶۱	۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر
۱۰۰.۰۰	۱,۴۸۷,۰۱۴,۹۴۶	۹۹.۹۹	۵,۳۸۰,۳۰۱		جمع کل