

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

۱۴۰۱/۰۵/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۴/۳۱			
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
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۱.۱۲	۲۱,۲۵۳,۴۲۷,۱۹۵	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۴۶,۸۰۶	۴۵۴,۱۶۰	۰	۰	۴,۱۲۷,۰۰۵,۶۴۵	۸۹,۵۱۰	۱۶,۷۵۰,۳۳۸,۳۲۲	۱۵,۷۹۳,۸۸۷,۳۱۱	۳۶۴,۶۵۰	صندوق س.اعتماد آفرین پاریسان-د
۰.۰۰	-	-	۱۰۰.۴۹	-	۳۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	(۲,۹۶۷,۰۶۳)	۵۱۶,۲۶۸,۹۶۲	-	۳۹,۹۰۲,۳۸۷,۲۹۰	۳۰,۰۱۵,۴۵۸,۷۱۷	۲,۹۶۷,۰۶۳	صندوق س. پارتد پایدار سپهر
۰.۰۰	-	-	۱۰۰.۴۹	-	۳۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	(۲,۹۶۷,۰۶۳)	۵۱۶,۲۶۸,۹۶۲	-	-	-	۲,۹۶۷,۰۶۳	صندوق س. پارتد پایدار سپهر
۰.۰۰	-	-	۱۰۰.۴۹	-	۳۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	(۲,۹۶۷,۰۶۳)	۵۱۶,۲۶۸,۹۶۲	-	۳۹,۹۰۲,۳۸۷,۲۹۰	۳۰,۰۱۵,۴۵۸,۷۱۷	۲,۹۶۷,۰۶۳	صندوق س. پارتد پایدار سپهر
۰.۰۰	-	-	۱۰۰.۴۹	-	۳۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	(۲,۹۶۷,۰۶۳)	۵۱۶,۲۶۸,۹۶۲	-	-	-	۲,۹۶۷,۰۶۳	صندوق س. پارتد پایدار سپهر
۵.۲۹	۱۰۰,۷۹۵,۱۹۱,۰۹۷	۱۰۰,۵۳۷,۸۰۷,۹۹۹	۱۰۰.۹۰	۹,۹۹۱,۴۸۶	۲,۷۹۹,۵۹۶,۱۶۳	(۲۷۶,۴۹۴)	-	-	۱۰۳,۴۷۱,۵۶۵,۸۶۳	۱۰۳,۳۱۹,۹۸۶,۸۱۵	۱۰,۲۶۷,۹۸۰	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۷۵.۲۶	۱,۴۳۴,۱۲۷,۵۸۵,۶۳۲	۱,۶۵۰,۳۳۳,۶۷۹,۳۰۳	۱۸,۲۲۰	۷۸,۷۷۱,۵۸۹	۳۴,۲۳۰,۵۷۶,۵۲۳	(۱,۲۵۷,۴۱۷)	۳۱,۹۵۹,۴۰۹,۶۸۴	۱,۶۷۸,۰۴۸	۱,۵۰۲,۴۱۲,۱۸۲,۳۰۸	۱,۶۴۴,۶۸۴,۷۰۱,۲۸۸	۷۸,۳۵۰,۹۵۸	سپید ماکیان
۱۴.۴۱	۲۷۴,۵۰۴,۶۶۵,۴۲۴	۲۸۳,۵۶۳,۰۷۴,۰۰۰	۲,۶۳۹	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	۲,۳۹۵,۰۵۸,۰۲۷	(۹۳۰,۰۰۰)	۲,۳۸۴,۴۶۶,۹۴۴	۹۳۰,۰۰۰	۲۷۷,۱۰۵,۱۲۶,۴۴۶	۲۸۳,۷۰۱,۷۰۵,۰۰۴	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	گروه صنایع کاغذ پارس
۰.۰۰	-	-	۳,۸۳۴	-	-	(۲۲,۲۸۱,۷۸۴)	-	-	۱۰۱,۹۷۳,۰۱۲,۲۸۶	۱۰۴,۵۵۷,۰۱۵,۸۲۴	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
۹۶.۰۸	۱,۸۳۰,۶۸۰,۸۶۹,۳۴۸	۲,۰۵۴,۳۴۵,۴۵۴,۲۵۸		۱۹۳,۳۱۴,۷۹۰	۱۴۸,۶۶۶,۹۳۳,۰۵۳	(۳۶,۶۱۳,۹۴۷)	۴۰,۵۳۵,۹۵۸,۱۲۱	۲,۶۹۷,۵۵۸	۲,۰۶۱,۵۱۶,۹۹۹,۸۰۵	۲,۲۱۲,۰۸۸,۲۱۳,۶۷۶	۲۲۷,۳۳۱,۱۷۹	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

سپرده های بانکی	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۰۵/۳۱	
	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ
سپرده کوتاه مدت- ۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱- بانک پاسارگاد	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۱۱/۱۳	۰.۰۰	۳۲۶,۳۲۹,۵۰۱	۶۶,۶۰۷,۴۳۳,۱۸۶	۵,۶۴۰,۰۴۰,۲۳۹	۶۱,۲۹۳,۷۲۲,۴۴۸
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰- بانک شهر- چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۰.۰۰	۲,۸۶۴,۴۷۰,۱۲۳	۱,۲۶۷,۸۴۵,۴۶۶	۴,۱۳۱,۵۲۷,۵۹۸	۷۸۸,۰۰۱
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳- بانک شهر- کویر	۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۰.۰۰	۲۷,۶۰۴,۳۷۹,۶۷۳	۹۱,۷۳۲,۱۹۰,۷۷۴	۱۱۹,۳۳۶,۵۷۰,۴۴۷	۰
جمع کل					۳۰,۷۹۵,۱۷۹,۳۰۷	۱۵۹,۶۰۷,۴۶۹,۴۲۶	۱۲۹,۱۰۸,۱۳۸,۲۸۴	۶۱,۲۹۴,۵۱۰,۴۴۹
								۳.۲۲

درصد به کل دارایی ها

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

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	(۷۷,۱۶۸,۰۰۵,۰۶۳)	۰.۰۰	-۴.۰۵
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	.	۰.۰۰	۰.۰۰
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۷,۶۲۷,۸۵۴	۰.۰۰	۰.۰۰
سایر درآمدها	۴-۲	.	۰.۰۰	۰.۰۰
جمع کل		(۷۷,۱۶۰,۳۷۷,۲۰۹)	۰.۰۰	(۴.۰۵)

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

درآمد سود سهام

۱۴۰۱/۰۵/۳۱			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	
۶۶۳۱۴۸۳۲۳	(۶۶۳۱۴۸۳۲۳)	-	۶۶۳,۱۴۸,۳۲۳	۶۶۳,۱۴۸,۳۲۳	-	۸۰۰	۷۶,۴۶۹,۲۹۱	۱۴۰۱/۰۳/۰۸	سپید ماکیان
۲۵۲۰۶۶۱۱۲	(۲۵۲۰۶۶۱۱۲)	-	۲۵۲,۰۶۶,۱۱۲	۲۵۲,۰۶۶,۱۱۲	-	۱۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	گروه صنایع کاغذ پارس
-	-	-	-	-	-	۸۵	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	۱۴۰۱/۰۴/۲۹	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
۹۱۵۲۱۴۴۳۵	(۹۱۵۲۱۴۴۳۵)	-	۹۱۵,۲۱۴,۴۳۵	۹۱۵,۲۱۴,۴۳۵	-				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۱/۰۵/۳۱			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۴,۳۹۴	—	۴,۳۹۴	۴,۳۹۴	—	۴,۳۹۴	۰.۰۰	۱۴۰۱/۱۱/۱۳	۱۴۰۱/۰۵/۱۱	سپرده کوتاه مدت-۱۵۱۵۵۹۴۰۱-۲۹۰۸۱۰۰۱۵ بانک پاسارگاد
۷,۶۲۳,۴۶۰	—	۷,۶۲۳,۴۶۰	۷,۶۲۳,۴۶۰	—	۷,۶۲۳,۴۶۰	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۸۵۸۶۷۰-۷۰۰۱۰۰۰ بانک شهر-چکاپا
۰	—	۰	۰	—	۰	۰.۰۰	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کوپر
۱,۷۹۰,۸۹۶,۸۰۴	—	۱,۷۹۰,۸۹۶,۸۰۴	۱,۷۹۰,۸۹۶,۸۰۴	—	۱,۷۹۰,۸۹۶,۸۰۴	۰.۰۰			صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۱,۷۹۸,۵۲۴,۶۵۸	—	۱,۷۹۸,۵۲۴,۶۵۸	۱,۷۹۸,۵۲۴,۶۵۸	—	۱,۷۹۸,۵۲۴,۶۵۸				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمد‌ها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

طی دوره				طی دوره			
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری
سندوق س. اعتماد آفرین پاریسان د	۴۵۴,۱۶۰	۲۱,۲۵۳,۴۲۷,۱۹۵	۲۰,۸۷۷,۳۴۳,۹۶۷	۳۷۶,۰۸۳,۲۳۸	۴۵۴,۱۶۰	۲۱,۲۵۳,۴۲۷,۱۹۵	۲۰,۸۷۷,۳۴۳,۹۶۷
سندوق س. با درآمد ثابت کمند	۹,۹۹۱,۴۸۶	۱۰۰,۷۹۵,۱۹۱,۰۹۷	۱۰۰,۶۸۵,۳۰۵,۳۵۸	۱۰۹,۸۸۵,۷۳۹	۹,۹۹۱,۴۸۶	۱۰۰,۷۹۵,۱۹۱,۰۹۷	۱۰۰,۶۸۵,۳۰۵,۳۵۸
سپید ماکیان	۱۸,۷۷۱,۵۸۹	۱,۴۳۴,۱۲۷,۵۸۵,۶۳۲	۱,۵۱۰,۳۰۹,۸۱۲,۳۷۰	(۷۶,۱۸۲,۲۲۶,۷۳۸)	۱۸,۷۷۱,۵۸۹	۱,۴۳۴,۱۲۷,۵۸۵,۶۳۲	۱,۵۱۰,۳۰۹,۸۱۲,۳۷۰
تروه صنایع کاغذ پارس	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۷۴,۰۵۰,۴۶۶,۴۲۴	۲۷۷,۰۲۵,۰۳۶,۲۵۳	(۲,۵۲۰,۳۷۰,۸۲۹)	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۷۴,۰۵۰,۴۶۶,۴۲۴	۲۷۷,۰۲۵,۰۳۶,۲۵۳
ولیدی فولاد سپید فراب کویر	(۱۰,۰۰۰,۰۰۰)	-	-	-	(۱۰,۰۰۰,۰۰۰)	-	-
جمع کل	۶۳,۳۱۴,۷۹۰	۱,۸۳۰,۶۸۰,۸۶۹,۳۴۸	۱,۹۰۸,۸۹۷,۴۹۷,۹۴۸	(۷۸,۲۱۶,۶۲۸,۶۰۰)	۶۳,۳۱۴,۷۹۰	۱,۸۳۰,۶۸۰,۸۶۹,۳۴۸	۱,۹۰۸,۸۹۷,۴۹۷,۹۴۸

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 ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

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

طی دوره						۱۴۰۱/۰۵/۳۱					
سهام	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمد ها	سهام	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمد ها
سپید ماکیان	۶۶۳,۱۴۸,۳۲۳	(۷۶,۱۸۲,۲۲۶,۷۳۸)	۱۸۷,۲۲۵,۹۳۸	(۷۵,۳۳۱,۸۵۲,۴۷۷)	-	۶۶۳,۱۴۸,۳۲۳	(۷۶,۱۸۲,۲۲۶,۷۳۸)	۱۸۷,۲۲۵,۹۳۸	(۷۵,۳۳۱,۸۵۲,۴۷۷)	-	
گروه صنایع کاغذ پارس	۲۵۲,۰۶۶,۱۱۲	(۲,۵۲۰,۳۷۰,۸۲۹)	(۶۷,۶۷۷,۵۱۳)	(۲,۳۳۵,۹۸۲,۲۳۰)	-	۲۵۲,۰۶۶,۱۱۲	(۲,۵۲۰,۳۷۰,۸۲۹)	(۶۷,۶۷۷,۵۱۳)	(۲,۳۳۵,۹۸۲,۲۳۰)	-	
تولیدی فولاد سپید فراب کویر	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
صندوق س.اعتماد آفرین	-	۳۷۶,۰۸۳,۲۲۸	-	۳۷۶,۰۸۳,۲۲۸	-	-	۳۷۶,۰۸۳,۲۲۸	-	۳۷۶,۰۸۳,۲۲۸	-	
صندوق س. با درآمد ثابت کمند	-	۱۰۹,۸۸۵,۷۳۹	۱۳,۸۶۰,۶۷۷	۱۲۳,۷۴۶,۴۱۶	-	-	۱۰۹,۸۸۵,۷۳۹	۱۳,۸۶۰,۶۷۷	۱۲۳,۷۴۶,۴۱۶	-	
صندوق س. پارس پایدار سپهر	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
جمع کل	۹۱۵,۲۱۴,۴۲۵	(۷۸,۲۱۶,۶۲۸,۶۰۰)	۱۳۳,۴۰۹,۱۰۲	(۷۷,۱۶۸,۰۰۵,۰۶۳)	-	۹۱۵,۲۱۴,۴۲۵	(۷۸,۲۱۶,۶۲۸,۶۰۰)	۱۳۳,۴۰۹,۱۰۲	(۷۷,۱۶۸,۰۰۵,۰۶۳)	-	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۵/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۱/۰۵/۳۱	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
سپرده کوتاه مدت-۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	۴,۳۹۴	۰.۰۶	۴,۳۹۴	۰.۰۶
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	۷,۶۲۳,۴۶۰	۹۹.۹۴	۷,۶۲۳,۴۶۰	۹۹.۹۴
جمع کل		۷,۶۲۷,۸۵۴	۱۰۰.۰۰	۷,۶۲۷,۸۵۴	۱۰۰.۰۰