

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

۱۴۰۱/۰۶/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۵/۳۱				
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	شرکت	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد					
۶۶٪	۲۱,۶۲۴,۴۰۶,۳۴۳	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۴۷,۶۲۳	۴۵۴,۱۶۰	-	-	-	-	۲۱,۲۵۳,۴۲۷,۱۹۵	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۴۵۴,۱۶۰	صندوق س.اعتماد افریحن پارس-خان د	
۰٪	-	-	-	-	۱۰۱,۵۷۴,۳۸۰,۸۸۳	(۹,۹۹۱,۴۸۶)	-	-	۱۰۰,۷۹۵,۱۹۱,۰۹۷	۱۰۰,۵۳۷,۸۰۷,۹۹۹	۹,۹۹۱,۴۸۶	صندوق س. با درآمد ثابت کمند	
۰٪	-	-	-	-	۱,۵۴۰,۷۷۲,۲۸۰,۸۴۰	(۷۸,۷۷۱,۵۸۹)	-	-	۱,۴۳۴,۱۲۷,۵۸۵,۶۳۲	۱,۶۵۰,۳۲۳,۶۷۹,۳۰۳	۷۸,۷۷۱,۵۸۹	سپید ماک-خان	
۷۹,۵۹٪	۲۵۷,۸۶۱,۷۱۴,۸۸۷	۲۸۳,۵۶۳,۰۷۴,۰۰۰	۲,۴۷۹	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	-	-	-	-	۲۷۴,۵۰۴,۶۶۵,۴۲۴	۲۸۳,۵۶۳,۰۷۴,۰۰۰	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	گروه صنایع کاغذ پارس	
۸۶,۲۶٪	۲۷۹,۴۸۶,۱۲۱,۲۳۰	۳۰۳,۴۸۳,۹۶۶,۹۵۶		۱۰۴,۵۵۱,۷۱۵	۱,۶۴۲,۳۴۶,۶۶۱,۷۲۳	(۸۸,۷۶۳,۰۷۵)	-	-	۱,۸۳۰,۶۸۰,۸۶۹,۳۴۸	۲,۰۵۴,۳۴۵,۴۵۴,۲۵۸	۱۹۳,۲۱۴,۷۹۰	جمع کل	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

سپرده های بانکی	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۰۶/۳۱	
	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی ها
سپرده کوتاه مدت- ۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۱۱/۱۳	۱۰	۶۱,۲۹۳,۷۲۲,۴۴۸	۱۰۱,۵۷۴,۵۴۵,۶۶۴	-	۰٪
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۰۷	۱۰	۷۸۸,۰۰۱	۸۹۴,۸۹۶	۳۱,۳۰۹,۵۵۱,۷۹۸	۹.۶۶٪
جمع کل					۶۱,۲۹۴,۵۱۰,۴۴۹	۱۳۲,۸۸۴,۲۰۴,۳۵۷	۳۱,۳۰۹,۵۵۱,۷۹۸	۹.۶۶٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایۀ گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد از کل دارایی ها
درآمد حاصل از سرمایۀ گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	(۳,۵۴۳,۲۸۰,۷۴۶)	۱۶۸.۷٪	-۱.۱٪
درآمد حاصل از سرمایۀ گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	-	۰.۰٪	۰.۰٪
درآمد حاصل از سرمایۀ گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۲۳۷,۸۶۲,۲۳۰	-۱۱.۳٪	۰.۱٪
سایر درآمدها	۴-۲	۱,۲۰۴,۷۲۳,۸۸۳	-۵۷.۳٪	۰.۴٪
جمع کل		(۲,۱۰۰,۶۹۴,۶۳۳)	۱۰۰.۰٪	-۰.۶٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۱/۰۶/۳۱			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۱۶۸,۶۷۱	-	۱۶۸,۶۷۱	۱۶۴,۲۷۷	-	۱۶۴,۲۷۷	۱۰	-	۱۳ هر ماه	سپرده کوتاه مدت-۴۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد
۲۳۰,۰۶۳,۴۰۶		۲۳۰,۰۶۳,۴۰۶	-	-	-	۱۰	-	ابتدای هر ماه	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر
۷,۶۳۰,۱۵۳	-	۷,۶۳۰,۱۵۳	۶,۶۹۳	-	۶,۶۹۳	۱۰	-	ابتدای هر ماه	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۲۳۷,۸۶۲,۲۳۰	-	۲۳۷,۸۶۲,۲۳۰	۱۷۰,۹۷۰	-	۱۷۰,۹۷۰				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

طی دوره				۱۴۰۱/۰۶/۳۱				
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش
صندوق س. پارند پایدار سپهر	-	-	-	-	۲,۹۶۷,۰۶۳	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	۲۹,۸۹۶,۷۹۶,۷۶۷	(۸۶,۳۷۱,۱۸۳)
صندوق س. با درآمد ثابت کمند	۹,۹۹۱,۴۸۶	۱۰۱,۵۷۴,۳۸۰,۸۸۳	۱۰۰,۶۶۶,۲۵۶,۵۹۳	۹۰۸,۱۲۴,۲۹۰	۱۰,۲۶۷,۹۸۰	۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶	۱۰۳,۴۵۱,۹۹۲,۰۷۹	۹۲۱,۹۸۴,۹۶۷
سپید ماکیان	۷۸,۷۷۱,۵۸۹	۱,۵۴۰,۷۷۲,۲۸۰,۸۴۰	۱,۵۱۰,۳۰۹,۸۱۲,۳۸۴	۳۰,۴۶۲,۴۶۸,۴۵۶	۸۰,۰۲۹,۰۰۶	۱,۵۶۵,۰۰۲,۸۵۷,۳۶۳	۱,۵۳۴,۳۵۳,۱۶۲,۹۶۹	۳۰,۶۴۹,۶۹۴,۳۹۴
گروه صنایع کاغذ پارس	-	-	-	-	۹۳۰,۰۰۰	۲,۳۹۵,۰۵۸,۰۲۷	۲,۴۶۲,۷۳۵,۵۳۲	(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)
تولیدی فولاد سپید فراب کویر	-	-	-	-	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۱۰۱,۹۷۳,۰۱۲,۲۸۶	(۱۶,۵۴۴,۶۵۲,۴۳۰)
جمع کل	۸۸,۷۶۳,۰۷۵	۱,۶۴۲,۳۴۶,۶۶۱,۷۲۳	۱,۶۱۰,۹۷۶,۰۶۸,۹۷۷	۳۱,۳۷۰,۵۹۲,۷۴۶	۱۱۶,۴۷۵,۸۳۳	۱,۷۸۷,۰۱۰,۶۷۷,۸۷۷	۱,۷۷۲,۱۳۷,۶۹۹,۶۳۳	۱۴,۸۷۲,۹۷۸,۲۴۴
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								

۱۴۰۱/۰۶/۳۱				طی دوره				
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د	۴۵۴,۱۶۰	۲۱,۶۳۴,۴۰۶,۳۴۳	۲۱,۲۵۳,۴۲۷,۱۹۵	۳۷۰,۹۷۹,۱۴۸	۴۵۴,۱۶۰	۲۱,۶۳۴,۴۰۶,۳۴۳	۲۰,۸۷۷,۳۴۳,۹۶۷	۷۴۷,۰۶۲,۳۷۶
گروه صنایع کاغذ پارس	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۵۷,۸۶۱,۷۱۴,۸۸۷	۲۷۴,۵۰۴,۶۶۵,۴۲۴	(۱۶,۶۴۲,۹۵۰,۵۳۷)	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۵۷,۸۶۱,۷۱۴,۸۸۷	۲۷۷,۰۲۵,۰۳۶,۲۵۳	(۱۹,۱۶۳,۳۲۱,۳۶۶)
جمع کل	(۲۵,۴۴۸,۲۸۵)	۲۷۹,۴۸۶,۱۲۱,۲۳۰	۲۱۹,۶۸۵,۷۵۱,۶۲۰	۵۹,۸۰۰,۳۶۹,۶۱۰	(۲۵,۴۴۸,۲۸۵)	۲۷۹,۴۸۶,۱۲۱,۲۳۰	۲۹۷,۹۰۲,۳۸۰,۲۲۰	(۱۸,۴۱۶,۲۵۸,۹۹۰)

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 ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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

۱۴۰۱/۰۶/۳۱					طی دوره					
درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام
-۱۴۵۹٪	۳۰,۶۴۹,۶۹۴,۳۹۴	۳۰,۶۴۹,۶۹۴,۳۹۴	-	-	-۱۴۵۰٪	۳۰,۴۶۲,۴۶۸,۴۵۶	۳۰,۴۶۲,۴۶۸,۴۵۶	-	-	سپید ماکیان
۹۱۵٪	(۱۹,۲۳۰,۹۹۸,۸۷۱)	(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)	(۱۹,۱۶۳,۳۲۱,۳۶۶)	-	۷۹۲٪	(۱۶,۶۴۲,۹۵۰,۵۳۷)	-	(۱۶,۶۴۲,۹۵۰,۵۳۷)	-	گروه صنایع کاغذ پارس
۷۸۸٪	(۱۶,۵۴۴,۶۵۲,۴۳۰)	(۱۶,۵۴۴,۶۵۲,۴۳۰)	-	-	۰٪	-	-	-	-	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
-۳۶٪	۷۴۷,۰۶۲,۳۷۶	-	۷۴۷,۰۶۲,۳۷۶	-	-۱۸٪	۳۷۰,۹۷۹,۱۴۸	-	۳۷۰,۹۷۹,۱۴۸	-	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
-۴۴٪	۹۲۱,۹۸۴,۹۶۷	۹۲۱,۹۸۴,۹۶۷	-	-	-۴۳٪	۹۰۸,۱۲۴,۲۹۰	۹۰۸,۱۲۴,۲۹۰	-	-	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۴٪	(۸۶,۳۷۱,۱۸۲)	(۸۶,۳۷۱,۱۸۲)	-	-	۰٪	-	-	-	-	صندوق س. یارند پایدار سپهر
۱۶۸.۷٪	(۳,۵۴۳,۲۸۰,۷۴۶)	۱۴,۸۷۲,۹۷۸,۲۴۴	(۱۸,۴۱۶,۲۵۸,۹۹۰)	-	-۷۱۹٪	۱۵,۰۹۸,۶۲۱,۳۵۷	۳۱,۳۷۰,۵۹۲,۷۴۶	(۱۶,۳۷۱,۹۷۱,۳۸۹)	-	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۱/۰۶/۳۱	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به جمع سود سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به جمع سود سپرده
سپرده کوتاه مدت-۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱-بانک پاسارگاد	۲۹۰۸۱۰۰۱۵۱۵۵۹۴۰۱	۱۶۴,۲۷۷	۹۶٪	۱۶۸,۶۷۱,۰۰۰	۰٪
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳-بانک شهر-کویر	۷۰۰۱۰۰۰۹۰۰۶۵۳	-	۰٪	۲۳۰,۰۶۳,۴۰۶,۰۰۰	۹۷٪
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	۶,۶۹۳	۴٪	۷,۶۳۰,۱۵۳,۰۰۰	۳٪
جمع کل		۱۷۰,۹۷۰	۱۰۰٪	۲۳۷,۸۶۲,۲۳۰	۳.۲٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۲- سایر درآمدها

۱۴۰۱/۰۶/۳۱

شرح	مبلغ	درصد از کل درآمدها
بازگشت هزینه تنزیل سود سهام	۱,۲۰۴,۷۲۳,۸۸۳	-
جمع کل	۱,۲۰۴,۷۲۳,۸۸۳	-