

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

رای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

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

تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۰۶/۳۱			۱۴۰۱/۰۷/۳۰				
شرکت	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	قیمت بازار هر سهم	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				
صندوق س.اعتماد آفرین پاریسان-د	۴۵۴,۱۶۰	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۲۱,۶۳۴,۴۰۶,۳۴۳	-	-	-	-	۴۵۴,۱۶۰	۴۸,۴۵۴	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۲۲,۰۰۱,۷۴۲,۵۳۹
گروه صنایع کاغذ پارس	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۸۳,۵۶۳,۰۷۴,۰۰۰	۲۵۷,۸۶۱,۷۱۴,۸۸۷	-	-	-	-	۱۰۴,۰۹۷,۵۵۵	۲,۳۵۱	۲۸۳,۵۶۳,۰۷۴,۰۰۰	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷
جمع کل	۱۰۴,۵۵۱,۷۱۵	۳۰۳,۴۸۳,۹۶۶,۹۵۶	۲۷۹,۴۹۶,۱۲۱,۲۳۰	-	-	-	-	۱۰۴,۵۵۱,۷۱۵		۳۰۳,۴۸۳,۹۶۶,۹۵۶	۲۶۶,۵۴۹,۰۹۶,۹۹۶
درصد به کل دارایی ها											

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

سپرده های بانکی	مشخصات حساب بانکی			تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۰۷/۳۰	
	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	مبلغ	افزایش	کاهش
سپرده کوتاه مدت- ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰- بانک شهر- چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت	-	-	۳۱,۳۰۹,۵۵۱,۷۹۸	۱۲,۹۹۳,۲۵۱,۸۱۸	۱۴,۰۰۲,۰۰۰
جمع کل					۳۱,۳۰۹,۵۵۱,۷۹۸	۱۲,۹۹۳,۲۵۱,۸۱۸	۱۴,۰۰۲,۰۰۰
						۴۴,۲۸۸,۸۰۱,۶۱۶	۴۴,۲۸۸,۸۰۱,۶۱۶
						۱۴.۲٪	۱۴.۲٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

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	(۳۰,۷۲۲,۰۳۶,۹۸۰)	-۱۰۰٪	-۹.۸۸٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۷,۶۳۶,۸۴۶	۰٪	۰.۰٪
جمع کل		(۳۰,۷۱۴,۴۰۰,۱۳۴)	-	-۹.۸۸٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

درآمد سود سهام

نام سهام	اطلاعات مجمع			طی دوره		۱۴۰۱/۰۷/۳۰	
	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
سپید ماکیان	۱۴۰۱/۰۳/۰۸	۷۶,۴۶۹,۲۹۱	۸۰۰	-	-	-	-
گروه صنایع کاغذ پارس	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۲۵	-	۱۸۴,۲۳۹,۱۲۷	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-
تولیدی فولاد سپید فراب کویر	۱۴۰۱/۰۴/۲۹	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	۸۵	-	-	-	-
جمع کل				-	۱۸۴,۲۳۹,۱۲۷	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۱/۰۷/۳۰			طی دوره			نرخ سود علی	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	الحساب			
۷,۶۳۶,۸۴۶	-	۷,۶۳۶,۸۴۶	۶,۶۹۳	-	۶,۶۹۳	-	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت - ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰ - بانک شهر - چکاپا
۷,۶۳۶,۸۴۶	-	۷,۶۳۶,۸۴۶	۶,۶۹۳	-	۶,۶۹۳				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۴۰۱/۰۷/۳۰				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
-	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	۲,۹۶۷,۰۶۳	-	-	-	-	صندوق س. پارت پایداری سپهر
-	۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶	۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶	۱۰,۲۶۷,۹۸۰	-	-	-	-	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
-	۱,۵۶۵,۰۰۲,۸۵۷,۳۶۳	۱,۵۶۵,۰۰۲,۸۵۷,۳۶۳	۸۰,۰۲۹,۰۰۶	-	-	-	-	سپید ماکیان
(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)	۲,۴۶۲,۷۳۵,۵۳۲	۲,۳۹۵,۰۵۸,۰۲۷	۹۳۰,۰۰۰	-	-	-	-	گروه صنایع کاغذ پارس
-	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	-	-	-	-	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)	۱,۷۸۷,۰۷۸,۳۵۵,۳۸۲	۱,۷۸۷,۰۱۰,۶۷۷,۸۷۷	۱۱۶,۴۷۵,۸۳۳	-	-	-	-	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 سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

طی دوره				۱۴۰۱/۰۷/۳۰				
شرح	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د	۴۵۴,۱۶۰	۲۲,۰۰۱,۷۴۲,۵۳۹	۲۱,۶۲۴,۴۰۶,۳۴۳	۳۷۷,۳۳۶,۱۹۶	۴۵۴,۱۶۰	۲۲,۰۰۱,۷۴۲,۵۳۹	۲۰,۸۷۷,۳۴۳,۹۶۷	۱,۱۲۴,۳۹۸,۵۷۲
گروه صنایع کاغذ پارس	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷	۲۵۷,۸۶۱,۷۱۴,۸۸۷	(۱۳,۳۱۴,۳۶۰,۴۳۰)	۴۴,۰۹۷,۵۵۵	۲۴۴,۵۴۷,۳۵۴,۴۵۷	۲۷۷,۰۲۵,۰۳۶,۲۵۳	(۳۲,۴۷۷,۶۸۱,۷۹۶)
جمع کل	۴۴,۵۵۱,۷۱۵	۲۶۶,۵۴۹,۰۹۶,۹۹۶	۲۷۹,۴۸۶,۱۲۱,۲۳۰	(۱۲,۹۳۷,۰۲۴,۲۳۴)	۴۴,۵۵۱,۷۱۵	۲۶۶,۵۴۹,۰۹۶,۹۹۶	۲۹۷,۹۰۲,۳۸۰,۲۲۰	(۳۱,۳۵۳,۲۸۳,۲۲۴)
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 سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

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

۱۴۰۱/۰۷/۳۰					طی دوره					سهام
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	
-	(۳۱,۸۴۶,۴۳۵,۵۵۲)	(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)	(۳۲,۴۷۷,۶۸۱,۷۹۶)	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-	(۱۳,۱۳۰,۱۲۱,۳۰۳)	-	(۱۳,۳۱۴,۳۶۰,۴۳۰)	۱۸۴,۲۳۹,۱۲۷	گروه صنایع کاغذ پارس
-	۱,۱۲۴,۳۹۸,۵۷۲	-	۱,۱۲۴,۳۹۸,۵۷۲	-	-	۳۷۷,۳۳۶,۱۹۶	-	۳۷۷,۳۳۶,۱۹۶	-	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
-	(۳۰,۷۲۲,۰۳۶,۹۸۰)	(۶۷,۶۷۷,۵۰۵)	(۳۱,۳۵۳,۲۸۳,۲۲۴)	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-	(۱۲,۷۵۲,۷۸۵,۱۰۷)	-	(۱۲,۹۳۷,۰۲۴,۲۳۴)	۱۸۴,۲۳۹,۱۲۷	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۰۷/۳۰

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۱/۰۷/۳۰	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و	درصد سود به میانگین	سود سپرده بانکی و	درصد سود به میانگین
		گواهی سپرده	سپرده	گواهی سپرده	سپرده
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	۶,۶۹۳		۷,۶۳۶,۸۴۶	
جمع کل		۶,۶۹۳		۷,۶۳۶,۸۴۶	