



## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

### صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

#### ۱- سرمایه گذاری ها

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

| ۱۴۰۱/۱۱/۳۰           |                |                |                   |           | تغییرات طی دوره |           |              |               | ۱۴۰۱/۱۰/۳۰     |                |           | شرکت                           |
|----------------------|----------------|----------------|-------------------|-----------|-----------------|-----------|--------------|---------------|----------------|----------------|-----------|--------------------------------|
| 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     |                                |
|                      |                |                |                   |           | تعداد           | مبلغ فروش | تعداد        | بهای تمام شده |                |                |           |                                |
| ۴۹.۰۳٪               | ۲۳,۳۶۳,۴۵۴,۵۴۸ | ۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲ | ۱۳,۴۱۱            | ۱,۷۴۲,۴۳۸ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۷   | -۹۰,۹۳۴   | .            | .             | ۲۴,۰۹۵,۱۵۶,۲۵۰ | ۲۳,۰۵۵,۳۰۸,۲۱۵ | ۱,۸۳۳,۲۷۲ | صندوق س. نوع دوم کارا -د       |
| ۴۹.۵۷٪               | ۲۳,۶۱۶,۴۳۲,۶۸۸ | ۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶ | ۵۲,۰۱۰            | ۴۵۴,۱۶۰   | .               | .         | .            | .             | ۲۳,۱۸۰,۵۲۰,۸۳۷ | ۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶ | ۴۵۴,۱۶۰   | صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د |
| ۹۸.۶۰٪               | ۴۶,۹۷۹,۸۸۷,۲۳۶ | ۴۱,۸۳۲,۶۷۳,۶۱۸ |                   | ۲,۱۹۶,۵۹۸ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۷   | -۹۰,۹۳۴   | .            | .             | ۴۷,۲۷۵,۶۷۷,۰۸۷ | ۴۲,۹۷۶,۲۰۱,۱۷۱ | ۲,۲۸۷,۵۳۲ | جمع کل                         |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| سپرده های بانکی |                 | مشخصات حساب بانکی |                    |            |               | تغییرات طی دوره |            | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰           | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰ |
|-----------------|-----------------|-------------------|--------------------|------------|---------------|-----------------|------------|----------------------|------------|
| شماره حساب      | نوع سپرده       | تاریخ افتتاح حساب | نرخ سود علی الحساب | مبلغ       | افزایش        | کاهش            | مبلغ       | درصد به کل دارایی ها | مبلغ       |
| ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰   | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۹/۲۹        | ۰.۰۰               | ۱۶,۹۰۳,۰۵۳ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۶ | ۱,۲۰۹,۹۷۷,۴۱۵   | ۱۶,۹۳۹,۳۲۴ | ۰.۰۴%                | ۱۶,۹۳۹,۳۲۴ |
| جمع کل          |                 |                   |                    |            |               |                 |            |                      | ۱۶,۹۳۹,۳۲۴ |
|                 |                 |                   |                    | ۱۶,۹۰۳,۰۵۳ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۶ | ۱,۲۰۹,۹۷۷,۴۱۵   | ۱۶,۹۳۹,۳۲۴ | ۰.۰۴%                | ۱۶,۹۳۹,۳۲۴ |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

#### 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     | ۵۰,۹۲۷,۱۵۴,۲۷۸- | ۰                  | ۱۰۶.۹٪-              |
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده | ۳-۲     | ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰     | ۰                  | ۰.۶٪                 |
| جمع کل                                                  |         | ۵۰,۶۶۲,۲۸۹,۳۴۸- | ۰                  | ۱۰۶-                 |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

## صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

درآمد سود سهام

| نام سهام         |                         | اطلاعات مجمع        |                    | طی دوره     |                     | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰   |                     |
|------------------|-------------------------|---------------------|--------------------|-------------|---------------------|--------------|---------------------|
| تاریخ تشکیل مجمع | تعداد سهام در زمان مجمع | سود متعلق به هر سهم | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام | هزینه تنزیل  | خالص درآمد سود سهام |
| ۱۴۰۰/۱۲/۲۵       | ۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱             | ۱۲۵                 | ۰                  | ۰           | ۰                   | -۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹ | ۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹         |
| جمع کل           |                         |                     | ۰                  | ۰           | ۰                   | -۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹ | ۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹         |

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| ۱۴۰۱/۱۱/۳۰  |             |             | طی دوره    |             |           |                    |              |                  |                                               |
|-------------|-------------|-------------|------------|-------------|-----------|--------------------|--------------|------------------|-----------------------------------------------|
| خالص درآمد  | هزینه تنزیل | درآمد سود   | خالص درآمد | هزینه تنزیل | درآمد سود | نرخ سود علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت سود | شرح                                           |
| ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰ | ۰           | ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰ | ۰          | ۰           | ۰         | ۰.۰۰               | ۱۴۰۲/۰۹/۲۹   | ۱۴۰۱/۱۱/۰۱       | سپرده کوتاه مدت-۸۵۸۶۷۰-۷۰۰۱۰۰۰-بانک شهر-چکاپا |
| ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰ | ۰           | ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰ | ۰          | ۰           | ۰         |                    |              |                  | جمع کل                                        |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

### صورت وضعیت درآمد‌ها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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

| طی دوره                                                                                                                    |        |                |                | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰              |             |                   |                    |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------|----------------|-------------------------|-------------|-------------------|--------------------|
| شرح                                                                                                                        | تعداد  | خالص ارزش فروش | ارزش دفتری     | سود و زیان ناشی از فروش | تعداد       | خالص ارزش فروش    | ارزش دفتری         |
| سندوق س. نوع دوم کارا -د                                                                                                   | ۹۰,۹۳۴ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۷  | -۱,۱۴۳,۳۰۰,۶۳۴ | ۶۶,۷۱۳,۰۵۳              | ۹۴,۷۶۳      | ۱,۲۶۰,۰۱۱,۰۵۲     | -۱,۱۹۱,۴۴۲,۳۰۳     |
| سندوق س. پارند پایدار سپهر                                                                                                 | .      | .              | .              | .                       | ۲,۹۶۷,۰۶۳   | ۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵    | -۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵    |
| سندوق س. با درآمد ثابت کمند                                                                                                | .      | .              | .              | .                       | ۱۰,۲۶۷,۹۸۰  | ۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶   | -۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶   |
| سپید ماکیان                                                                                                                | .      | .              | .              | .                       | ۸۰,۰۲۹,۰۰۶  | ۱,۵۶۵,۰۰۲,۸۵۷,۳۶۳ | -۱,۵۶۵,۰۰۲,۸۵۷,۳۶۳ |
| گروه صنایع کاغذ پارس                                                                                                       | .      | .              | .              | .                       | ۱۰۵,۰۲۷,۵۵۵ | ۲۲۳,۶۰۲,۳۶۲,۴۰۲   | -۲۷۹,۴۸۷,۷۷۱,۷۸۵   |
| ولیدی فولاد سپید فراب کویر                                                                                                 | .      | .              | .              | .                       | ۲۲,۲۸۱,۷۸۴  | ۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶    | -۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶    |
| جمع کل                                                                                                                     | ۹۰,۹۳۴ | ۱,۲۱۰,۰۱۳,۶۸۷  | -۱,۱۴۳,۳۰۰,۶۳۴ | ۶۶,۷۱۳,۰۵۳              | ۲۲۰,۶۶۸,۱۵۱ | ۲,۰۰۹,۴۷۷,۹۹۳,۳۰۴ | -۲,۰۶۵,۲۹۴,۸۳۳,۹۳۸ |
| 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 بازاریگردانی الگوریتم سرمایه بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| ۱۴۰۱/۱۱/۳۰                    |                 |                |           | طی دوره                       |                 |                |             | شرح                          |
|-------------------------------|-----------------|----------------|-----------|-------------------------------|-----------------|----------------|-------------|------------------------------|
| سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری      | خالص ارزش فروش | تعداد     | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری      | خالص ارزش فروش | تعداد       |                              |
| ۱,۴۵۱,۶۷۳,۸۸۶                 | -۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲ | ۲۳,۳۶۳,۴۵۴,۵۴۸ | ۱,۷۴۲,۴۳۸ | ۴۱۱,۸۲۵,۸۵۱                   | -۲۲,۹۵۱,۶۲۸,۶۹۷ | ۲۳,۳۶۳,۴۵۴,۵۴۸ | ۱,۷۴۲,۴۳۸   | صندوق س. نوع دوم کارا -د     |
| ۲,۷۳۹,۰۸۸,۷۲۱                 | -۲۰,۸۱۷,۳۴۳,۹۶۷ | ۲۳,۶۱۶,۴۳۲,۶۸۸ | ۴۵۴,۱۶۰   | ۴۳۵,۹۱۱,۸۵۱                   | -۲۳,۱۸۰,۵۲۰,۸۳۷ | ۲۳,۶۱۶,۴۳۲,۶۸۸ | ۴۵۴,۱۶۰     | صندوق س.اعتماد آفرین پاریس-د |
| ۴,۱۹۰,۷۶۲,۶۰۷                 | -۴۲,۷۸۹,۱۲۴,۶۲۹ | ۴۶,۹۷۹,۸۸۷,۲۳۶ | ۲,۱۹۶,۵۹۸ | ۸۴۷,۷۳۷,۷۰۲                   | -۴۶,۱۳۲,۱۴۹,۵۳۴ | ۴۶,۹۷۹,۸۸۷,۲۳۶ | ۱۲۷,۸۰۳,۴۰۲ | 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 ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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

| ۱۴۰۱/۱۱/۳۰       |                 |                 |                  |                | طی دوره             |             |            |                  |                | سهام                           |
|------------------|-----------------|-----------------|------------------|----------------|---------------------|-------------|------------|------------------|----------------|--------------------------------|
| درصد از کل درآمد | 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 |                                |
| ۰.۰۰٪            | ۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴- | ۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳- | ۰                | ۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹    | ۰.۰٪                | ۰           | ۰          | ۰                | ۰              | گروه صنایع کاغذ پارس           |
| ۰.۰۰٪            | ۱,۵۲۰,۲۴۲,۶۳۵   | ۶۸,۵۶۸,۷۴۹      | ۱,۴۵۱,۶۷۳,۸۸۶    | ۰              | ۵۲.۳٪               | ۴۷۸,۵۳۸,۹۰۴ | ۶۶,۷۱۳,۰۵۳ | ۴۱۱,۸۲۵,۸۵۱      | ۰              | صندوق س. نوع دوم کارا -د       |
| ۰.۰۰٪            | ۲,۷۳۹,۰۸۸,۷۲۱   | ۰               | ۲,۷۳۹,۰۸۸,۷۲۱    | ۰              | ۴۷.۷٪               | ۴۳۵,۹۱۱,۸۵۱ | ۰          | ۴۳۵,۹۱۱,۸۵۱      | ۰              | صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د |
| ۰.۰۰٪            | ۵۰,۹۲۷,۱۵۴,۲۷۸- | ۵۵,۸۱۶,۸۴۰,۶۳۴- | ۴,۱۹۰,۷۶۲,۶۰۷    | ۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹    | ۱۰۰.۰٪              | ۹۱۴,۴۵۰,۷۵۵ | ۶۶,۷۱۳,۰۵۳ | ۸۴۷,۷۳۷,۷۰۲      | ۰              | <b>جمع کل</b>                  |

## صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۱/۳۰

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

| نام سپرده بانکی                              |               | طی دوره           |                     | ۱۴۰۱/۱۱/۳۰        |                     |
|----------------------------------------------|---------------|-------------------|---------------------|-------------------|---------------------|
| 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 | ۰                 | ۰.۰۰                | ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰       | ۱۰۰٪                |
| جمع کل                                       |               | ۰                 | ۰.۰۰                | ۲۶۴,۸۶۴,۹۳۰       | ۱۰۰٪                |