



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۱- سرمایه گذاری ها

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

۱۴۰۱/۱۲/۲۹				تغییرات طی دوره				۱۴۰۱/۱۱/۳۰			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	بهای تمام شده				
۵۰.۱٪	۲۳,۸۲۳,۳۷۱,۹۳۰	۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۱۳,۶۷۵	۱,۷۴۲,۴۳۸	۰	۰	۰	۲۳,۳۶۳,۴۵۴,۵۴۸	۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۱,۷۴۲,۴۳۸	صندوق س. نوع دوم کارا - د
۴۹.۸٪	۲۳,۷۰۰,۰۱۹,۴۴۲	۱۹,۶۴۱,۳۰۷,۵۷۰	۵۲,۹۹۱	۴۴۷,۳۳۰	۳۶۰,۸۸۴,۱۶۵	۶,۸۳۰	۰	۲۳,۶۱۶,۴۳۲,۶۸۸	۱۹,۹۲۰,۸۹۲,۹۵۶	۴۵۴,۱۶۰	صندوق س. اعتماد آفرین پارسیان - د
۹۹.۸۶٪	۴۷,۵۲۳,۳۹۱,۳۷۲	۴۱,۵۳۳,۰۸۸,۲۳۲		۲,۱۸۹,۷۶۸	۳۶۰,۸۸۴,۱۶۵	۶,۸۳۰	۰	۴۶,۹۷۹,۸۸۷,۲۳۶	۴۱,۸۳۲,۶۷۳,۶۱۸	۲,۱۹۶,۵۹۸	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۳۰

۱-۳- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۴۰۱/۱۱/۳۰	مشخصات حساب بانکی				سپرده های بانکی
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	
۰.۰۸٪	۳۹,۹۴۷,۴۲۴	۳۳۸,۰۲۹,۵۵۷	۳۶۱,۰۳۷,۶۵۷	۱۶,۹۳۹,۳۲۴	۰.۰۰	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت - ۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰ - بانک شهر - چکپا
۰.۰۸٪	۳۹,۹۴۷,۴۲۴	۳۳۸,۰۲۹,۵۵۷	۳۶۱,۰۳۷,۶۵۷	۱۶,۹۳۹,۳۲۴					جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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	۵۰,۰۲۲,۶۹۸,۳۰۲-	۱۰۰.۵۳%	۱۰۵.۱%-
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۲	۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۰.۵۳%-	۰.۶%
جمع کل		۴۹,۷۵۷,۷۳۴,۰۲۲-	۱۰۰.۰%	۱۰۴.۵۵%-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

درآمد سود سهام								
نام سهام	اطلاعات مجمع			طی دوره		۱۴۰۱/۱۲/۳۰		
	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
گروه صنایع کاغذ پارس	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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۱/۱۲/۲۹			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۰	۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۹۹,۳۵۰	۰	۹۹,۳۵۰	۰.۰۰	۱۴۰۲/۰۹/۲۹	۱۴۰۱/۱۲/۰۱	سپرده کوتاه مدت--۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۰	۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۹۹,۳۵۰	۰	۹۹,۳۵۰				جمع کل

۱۴۰۱/۱۲/۲۹				طی دوره				
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.اعتماد آفرین پارسیان-د	۶,۸۳۰	۳۶۰,۸۸۴,۱۶۵	-۳۱۳,۹۰۱,۵۴۲	۴۶,۹۸۲,۶۲۳	۶,۸۳۰	۳۶۰,۸۸۴,۱۶۵	-۳۱۳,۹۰۱,۵۴۲	۴۶,۹۸۲,۶۲۳
صندوق س. نوع دوم کارا -د	.	.	.	.	۹۴,۷۶۳	۱,۲۶۰,۰۱۱,۰۵۲	-۱,۱۹۱,۴۴۲,۳۰۳	۶۸,۵۶۸,۷۴۹
صندوق س. پارند پایدار سپهر	.	.	.	.	۲,۹۶۷,۰۶۳	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	-۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	.
صندوق 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	-۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳
تولیدی فولاد سپید فراب کویر	.	.	.	.	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	-۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	.
جمع کل	۶,۸۳۰	۳۶۰,۸۸۴,۱۶۵	-۳۱۳,۹۰۱,۵۴۲	۴۶,۹۸۲,۶۲۳	۲۲۰,۶۷۴,۹۸۱	۲,۰۰۹,۸۳۸,۸۷۷,۴۶۹	-۲,۰۶۵,۶۰۸,۷۳۵,۴۸۰	-۵۵,۷۶۹,۸۵۸,۰۱۱

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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۴۰۱/۱۲/۲۹				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	
۱,۹۱۱,۵۹۱,۲۶۸	-۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۲۳,۸۲۳,۳۷۱,۹۳۰	۱,۷۴۲,۴۳۸	۴۵۹,۹۱۷,۳۸۲	-۲۳,۳۶۳,۴۵۴,۵۴۸	۲۳,۸۲۳,۳۷۱,۹۳۰	۱,۷۴۲,۴۳۸	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۳,۱۳۶,۶۴۴,۶۹۲	-۲۰,۵۶۳,۳۷۴,۷۵۰	۲۳,۷۰۰,۰۱۹,۴۴۲	۴۴۷,۳۳۰	۳۹۷,۵۵۵,۹۷۱	-۲۳,۳۰۲,۴۶۳,۴۷۱	۲۳,۷۰۰,۰۱۹,۴۴۲	۴۴۷,۳۳۰	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۵,۰۴۸,۲۳۵,۹۶۰	-۴۲,۴۷۵,۱۵۵,۴۱۲	۴۷,۵۲۳,۳۹۱,۳۷۲	۲,۱۸۹,۷۶۸	۸۵۷,۴۷۳,۳۵۳	-۴۶,۶۶۵,۹۱۸,۰۱۹	۴۷,۵۲۳,۳۹۱,۳۷۲	۲,۱۸۹,۷۶۸	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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

۱۴۰۱/۱۲/۲۹					طی دوره					سهام
درصد از کل درآمد	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۱۱۰.۹۱٪	-۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴	-۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳	۰	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹		۰	۰	۰	۰	گروه صنایع کاغذ پارس
-۳.۹۸٪	۱,۹۸۰,۱۶۰,۰۱۷	۶۸,۵۶۸,۷۴۹	۱,۹۱۱,۵۹۱,۲۶۸	۰		۴۵۹,۹۱۷,۳۸۲	۰	۴۵۹,۹۱۷,۳۸۲	۰	صندوق س. نوع دوم کارا -د
-۶.۴۰٪	۳,۱۸۳,۶۲۷,۳۱۵	۴۶,۹۸۲,۶۲۳	۳,۱۳۶,۶۴۴,۶۹۲	۰		۴۴۴,۵۳۸,۵۹۴	۴۶,۹۸۲,۶۲۳	۳۹۷,۵۵۵,۹۷۱	۰	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۱۰۰.۵٪	-۵۰,۰۲۲,۶۹۸,۳۰۲	-۵۵,۷۶۹,۸۵۸,۰۱۱	۵,۰۴۸,۲۳۵,۹۶۰	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰.۰۰٪	۹۰۴,۴۵۵,۹۷۶	۴۶,۹۸۲,۶۲۳	۸۵۷,۴۷۳,۳۵۳	۰	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۱/۱۲/۲۹	
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	۹۹,۳۵۰	۱۰۰.۰٪	۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۱۰۰٪
جمع کل		۹۹,۳۵۰	۰.۰۰	۲۶۴,۹۶۴,۲۸۰	۱۰۰٪