

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری درصندوق های سرمایه گذاری

۱۴۰۱/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۱/۳۱				
شرکت	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره	فروش طی دوره	تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
صندوق س. نوع دوم کارا -د	۱,۷۴۲,۴۳۸	۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۲۳,۸۲۳,۳۷۱,۹۳۰	.	.	.	.	۱۳,۹۴۸	۲۴,۲۹۸,۹۶۸,۳۱۳	۴۷,۶۷٪
صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د	۴۴۷,۳۳۰	۱۹,۶۲۱,۳۰۷,۵۷۰	۲۳,۷۰۰,۰۱۹,۴۴۲	.	.	-۱,۸۶۷	۱۰۰,۰۳۵,۶۳۸	۵۴,۰۰۱	۲۴,۰۵۰,۹۳۷,۰۶۶	۴۷,۱۹٪
جمع کل	۲,۱۸۹,۷۶۸	۴۱,۵۳۳,۰۸۸,۲۳۲	۴۷,۵۲۳,۳۹۱,۳۷۲	.	.	-۱,۸۶۷	۱۰۰,۰۳۵,۶۳۸	۲,۱۸۷,۹۰۱	۴۸,۳۴۹,۹۰۵,۳۷۹	۹۴,۹٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل	درصد از کل
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق	۱-۲	۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴-	۱۱۳.۰۲٪	۱۰۸.۳٪-
سرمایه گذاری درصندوق های سرمایه گذاری	۲-۲	۶,۰۹۰,۳۵۵,۷۳۶	۱۲.۴۷٪	۱۱.۹٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی	۲-۳	۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	۰.۵۴٪	۰.۵٪
جمع کل		۴۸,۸۳۱,۰۸۴,۸۶۶-	۱۰۰٪	۹۵.۸۰٪-

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

درآمد سود سهام

۱۴۰۲/۰۱/۳۱			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	
۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰	۰	۰	۰	۱۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	گروه صنایع کاغذ پارس
۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰	۰	۰	۰				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۱/۳۱			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	۰	۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	۸۰,۷۵۲	۰	۸۰,۷۵۲	۰.۰۰	۱۴۰۲/۰۹/۲۹	۱۴۰۲/۰۱/۰۱	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	۰	۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	۸۰,۷۵۲	۰	۸۰,۷۵۲				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازر

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۱/۳۱				طی دوره				شرح
سود و زیان ناشی از	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	
۶۸,۵۶۸,۷۴۹	-۱,۱۹۱,۴۴۲,۳۰۳	۱,۲۶۰,۰۱۱,۰۵۲	۹۴,۷۶۳	.	.	.	.	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۶۱,۲۱۲,۶۳۸	-۳۹۹,۷۰۷,۱۶۵	۴۶۰,۹۱۹,۸۰۳	۸,۶۹۷	۱۴,۲۳۰,۰۱۵	-۸۵,۸۰۵,۶۲۳	۱۰۰,۰۳۵,۶۳۸	۱,۸۶۷	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
.	-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
-۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳	-۲۷۹,۴۸۷,۷۷۱,۷۸۵	۲۲۳,۶۰۲,۳۶۲,۴۰۲	۱۰۵,۰۲۷,۵۵۵	.	.	.	.	گروه صنایع کاغذ پارس
.	-۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	.	.	.	.	تولیدی فولاد سپید فراب کویر
-۵۵,۷۵۵,۶۲۷,۹۹۶	-۲,۰۶۵,۶۹۴,۵۴۱,۱۰۳	۲,۰۰۹,۹۳۸,۹۱۳,۱۰۷	۲۲۰,۶۷۶,۸۴۸	۱۴,۲۳۰,۰۱۵	-۸۵,۸۰۵,۶۲۳	۱۰۰,۰۳۵,۶۳۸	۱,۸۶۷	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 ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۱/۳۱				طی دوره				
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	شرح
۲,۳۸۷,۱۸۷,۶۵۱	۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۲۴,۲۹۸,۹۶۸,۳۱۳	۱,۷۴۲,۴۳۸	۴۷۵,۵۹۶,۳۸۳	۲۳,۸۲۳,۳۷۱,۹۳۰	۲۴,۲۹۸,۹۶۸,۳۱۳	۱,۷۴۲,۴۳۸	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۳,۵۷۳,۳۸۶,۶۹۸	۲۰,۴۷۷,۵۵۰,۳۶۸	۲۴,۰۵۰,۹۳۷,۰۶۶	۴۴۵,۴۶۳	۴۷۵,۵۹۶,۳۸۳	۲۳,۶۱۴,۱۹۵,۰۶۰	۲۴,۰۵۰,۹۳۷,۰۶۶	۴۴۵,۴۶۳	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۵,۹۶۰,۵۷۴,۳۴۹	۴۲,۳۸۹,۳۳۱,۰۳۰	۴۸,۳۴۹,۹۰۵,۳۷۹	۲,۱۸۷,۹۰۱	۹۵۱,۱۹۲,۷۶۶	۴۷,۴۳۷,۵۶۶,۹۹۰	۴۸,۳۴۹,۹۰۵,۳۷۹	۲,۱۸۷,۹۰۱	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 سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۱/۳۱					طی دوره					
درصد از کل درآمدها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام
-۱۱۳٪	-۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴	-۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳	۰	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰.۰۰	۰	۰	۰	۰	گروه صنایع کاغذ پارس
-۱۱۳٪	-۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴	-۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳	۰	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰.۰۰	۰	۰	۰	۰	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

۲-۲- سرمایه گذاری درصندوق های سرمایه گذاری :

۱۴۰۲/۰۱/۳۱					طی دوره					
درصد از کل درآمدها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود صندوق	سهام
۵.۰٪	۲,۴۵۵,۷۵۶,۴۰۰	۶۸,۵۶۸,۷۴۹	۲,۳۸۷,۱۸۷,۶۵۱	۰	۵۱.۳٪	۴۷۵,۵۹۶,۳۸۳	۰	۴۷۵,۵۹۶,۳۸۳	۰	صندوق س. نوع دوم کارا - د
۷.۴٪	۳,۶۳۴,۵۹۹,۳۳۶	۶۱,۲۱۲,۶۳۸	۳,۵۷۳,۳۸۶,۶۹۸	۰	۴۸.۷٪	۴۵۰,۹۷۲,۰۲۱	۱۴,۲۳۰,۰۱۵	۴۳۶,۷۴۲,۰۰۶	۰	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۱۲.۴۷٪	۶,۰۹۰,۳۵۵,۷۳۶	۱۲۹,۷۸۱,۳۸۷	۵,۹۶۰,۵۷۴,۳۴۹	۰	۹۹.۹۹٪	۹۲۶,۵۶۸,۴۰۴	۱۴,۲۳۰,۰۱۵	۹۱۲,۳۳۸,۳۸۹	۰	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرمایه بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۱/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۲/۰۱/۳۱	
نام سپرده		درصد سود به میانگین		سود سپرده بانکی و	
شماره حساب		سود سپرده بانکی و		گواهی سپرده	
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا		۸۰,۷۵۲		۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	
جمع کل		۸۰,۷۵۲		۲۶۵,۰۴۵,۰۳۲	
۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰		۱۰۰.۰۰		۱۰۰٪	
		۱۰۰.۰۰		۱۰۰٪	