

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری

۱۴۰۲/۰۲/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۱/۳۱			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	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام	تعداد				
۴۷.۸٪	۲۴,۵۸۳,۹۷۷,۳۶۳	۲۱,۷۳۲,۵۱۸,۹۴۲	۱۴,۲۲۸	۱,۷۲۸,۱۸۳	(۲۰۰,۰۰۲,۹۰۸)	(۱۴,۲۵۵)	۰	۰	۲۴,۲۹۸,۹۶۸,۳۱۳	۲۱,۹۱۱,۷۸۰,۶۶۲	۱,۷۴۲,۴۳۸	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۴۷.۶٪	۲۴,۴۸۶,۰۷۲,۸۱۴	۱۹,۵۳۹,۴۱۵,۰۴۹	۵۴,۹۷۸	۴۴۵,۴۶۳	۰	۰	۰	۰	۲۴,۰۵۰,۹۳۷,۰۶۶	۱۹,۵۳۹,۴۱۵,۰۴۹	۴۴۵,۴۶۳	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان -د
۹۵.۳٪	۴۹,۰۷۰,۰۵۰,۱۷۷	۴۱,۲۷۱,۹۳۳,۹۹۱		۲,۱۷۳,۶۴۶	(۲۰۰,۰۰۲,۹۰۸)	(۱۴,۲۵۵)	۰	۰	۴۸,۳۴۹,۹۰۵,۳۷۹	۴۱,۴۵۱,۱۹۵,۷۱۱	۲,۱۸۷,۹۰۱	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۱-۲- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

سپرده های بانکی	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۲/۳۱	۱۴۰۲/۰۱/۳۱
	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	افزایش	کاهش	مبلغ	مبلغ
سپرده کوتاه مدت بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۵٪	۲۰۰,۰۵۲,۱۳۵	۱۸۸,۱۳۱,۶۹۵	۲۳,۵۱۲,۶۵۶	۱۱,۵۹۲,۲۱۶
جمع کل					۲۰۰,۰۵۲,۱۳۵	۱۸۸,۱۳۱,۶۹۵	۲۳,۵۱۲,۶۵۶	۱۱,۵۹۲,۲۱۶
					۰.۰٪		۰.۰٪	
					۰.۰٪		۰.۰٪	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

شرح	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی ها
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۱-۲	(۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴)	-۱۱۵.۲٪	-۱۰۷.۲٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری	۲-۲	۷,۰۱۰,۵۴۰,۹۴۹	۱۴.۶٪	۱۳.۶٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	۰.۶٪	۰.۵٪
جمع کل		(۴۷,۹۱۰,۸۵۰,۴۲۶)	-۱۰۰.۰٪	-۹۳.۱٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

درآمد سود سهام

اطلاعات مجمع			طی دوره		۱۴۰۲/۰۲/۳۱	
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
گروه صنایع کاغذ پارس	۱۴۰۰/۱۲/۲۵	۱۰۳,۹۴۵,۹۶۱	۱۲۵	-	(۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹)	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹
جمع کل				-	(۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹)	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

سود سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۲/۳۱			طی دوره								
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح		
۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	-	۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	۴۹,۲۲۷	-	۴۹,۲۲۷	۰.۰۵	۱۴۰۲/۰۹/۲۹	۱۴۰۲/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-		
۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	-	۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	۴۹,۲۲۷	-	۴۹,۲۲۷				جمع کل		

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۲/۳۱				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
۸۹,۳۴۷,۴۴۴	(۱,۳۷۰,۶۶۶,۵۱۶)	۱,۴۶۰,۰۱۳,۹۶۰	۱۰۹,۰۱۸	۲۰,۷۷۸,۶۹۵	(۱۷۹,۲۲۴,۲۱۳)	۲۰۰,۰۰۲,۹۰۸	۱۴,۲۵۵	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۶۱,۲۱۲,۶۳۸	(۳۹۹,۷۰۷,۱۶۵)	۴۶۰,۹۱۹,۸۰۳	۸,۶۹۷	-	-	-	-	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
-	(۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵)	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	۲,۹۶۷,۰۶۳	-	-	-	-	صندوق س. پारند پایدار 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
(۵۵,۷۳۴,۸۴۹,۳۰۱)	(۲,۰۶۵,۸۷۳,۷۶۵,۳۱۶)	۲,۰۱۰,۱۳۸,۹۱۶,۰۱۵	۲۲۰,۶۹۱,۱۰۳	۲۰,۷۷۸,۶۹۵	(۱۷۹,۲۲۴,۲۱۳)	۲۰۰,۰۰۲,۹۰۸	۱۴,۲۵۵	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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۲/۳۱				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
۲,۸۵۱,۴۵۸,۴۲۱	(۲۱,۷۳۲,۵۱۸,۹۴۲)	۲۴,۵۸۳,۹۷۷,۳۶۳	۱,۷۲۸,۱۸۳	۴۶۴,۲۷۰,۷۷۰	(۲۴,۱۱۹,۷۰۶,۵۹۳)	۲۴,۵۸۳,۹۷۷,۳۶۳	۱,۷۲۸,۱۸۳	صندوق س. نوع دوم کارا - د
۴,۰۰۸,۵۲۲,۴۴۶	(۲۰,۴۷۷,۵۵۰,۳۶۸)	۲۴,۴۸۶,۰۷۲,۸۱۴	۴۴۵,۴۶۳	۴۳۵,۱۳۵,۷۴۸	(۲۴,۰۵۰,۹۳۷,۰۶۶)	۲۴,۴۸۶,۰۷۲,۸۱۴	۴۴۵,۴۶۳	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان -
۶,۸۵۹,۹۸۰,۸۶۷	(۴۲,۲۱۰,۰۶۹,۳۱۰)	۴۹,۰۷۰,۰۵۰,۱۷۷	۲,۱۷۳,۶۴۶	۸۹۹,۴۰۶,۵۱۸	(۴۸,۱۷۰,۶۴۳,۶۵۹)	۴۹,۰۷۰,۰۵۰,۱۷۷	۲,۱۷۳,۶۴۶	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 ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۲/۳۱					طی دوره					
درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمدها	سهام
-	-	-	-	۰.۰٪	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰	(۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳)	(۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴)	-۱۱۵٪	گروه صنایع کاغذ پارس
-	۰	۰	۰	۰.۰۰٪	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۰	(۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳)	(۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴)	-۱۱۵.۲٪	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

۲-۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری:

۱۴۰۲/۰۲/۳۱					طی دوره					
درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل درآمدها	سهم
-	۴۶۴,۲۷۰,۷۷۰	۲۰,۷۷۸,۶۹۵	۴۸۵,۰۴۹,۴۶۵	۵۲.۷٪	-	۴۸۵,۰۴۹,۴۶۵	۲,۸۵۱,۴۵۸,۴۲۱	۸۹,۳۴۷,۴۴۴	۲,۹۴۰,۸۰۵,۸۶۵	۶.۱۴٪
-	۴۳۵,۱۳۵,۷۴۸	-	۴۳۵,۱۳۵,۷۴۸	۴۷.۳٪	-	۴۳۵,۱۳۵,۷۴۸	۴,۰۰۸,۵۲۲,۴۴۶	۶۱,۲۱۲,۶۳۸	۴,۰۶۹,۷۳۵,۰۸۴	۸.۴۹٪
-	۸۹۹,۴۰۶,۵۱۸	۲۰,۷۷۸,۶۹۵	۹۲۰,۱۸۵,۲۱۳	۹۹.۹۹٪	۰	۶,۸۵۹,۹۸۰,۸۶۷	۱۵۰,۵۶۰,۰۸۲	۷,۰۱۰,۵۴۰,۹۴۹	۷,۰۱۰,۵۴۰,۹۴۹	۱۴.۶٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۲/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۲/۳۱		طی دوره		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۱۰۰٪	۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	۱۰۰٪	۴۹,۲۲۷	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا
۱۰۰.۰٪	۲۶۵,۰۹۴,۲۵۹	۱۰۰.۰۰٪	۴۹,۲۲۷		جمع کل