

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه گذاری در صندوق های سرمایه گذاری

۱۴۰۲/۰۳/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۲/۳۱				
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	شرکت
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام				
۴۷.۸٪	۲۴,۷۲۵,۵۸۰,۲۴۴	۲۱,۴۱۸,۱۳۵,۰۰۶	۱۴,۵۲۰	۱,۷۰۳,۱۸۳	(۳۶۰,۶۰۷,۳۷۶)	(۲۵,۰۰۰)	-	-	۲۴,۵۸۳,۹۷۷,۳۶۳	۲۱,۷۳۲,۵۱۸,۹۴۲	۱,۷۲۸,۱۸۳	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۴۸.۳٪	۲۵,۰۰۴,۹۳۹,۹۰۳	۱۹,۵۳۹,۴۱۵,۰۴۹	۵۶,۱۴۳	۴۴۵,۴۶۳	-	-	-	-	۲۴,۴۸۶,۰۷۲,۸۱۴	۱۹,۵۳۹,۴۱۵,۰۴۹	۴۴۵,۴۶۳	صندوق س.اعتماد آفرین
۹۶.۱۰	۴۹,۷۳۰,۵۲۰,۱۴۷	۴۰,۹۵۷,۵۵۰,۰۵۵		۲,۱۴۸,۶۴۶	(۳۶۰,۶۰۷,۳۷۶)	(۲۵,۰۰۰)	-	-	۴۹,۰۷۰,۰۵۰,۱۷۷	۴۱,۲۷۱,۹۳۳,۹۹۱	۲,۱۷۳,۶۴۶	جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

۱-۲- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

سپرده های بانکی	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۰۳/۳۱		درصد به کل دارایی ها
	شماره حساب	نوع سپرده	تاریخ افتتاح حساب	نرخ سود علی الحساب	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	
سپرده کوتاه مدت بانک شهر-چکاپا	۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰	کوتاه مدت	۱۴۰۰/۰۹/۲۹	۵٪	۲۳,۵۱۲,۶۵۶	۳۶۰,۶۵۵,۰۲۷	۳۴۹,۲۳۲,۳۷۱	۳۴,۹۳۵,۳۱۲	۰٪
جمع کل					۲۳,۵۱۲,۶۵۶	۳۶۰,۶۵۵,۰۲۷	۳۴۹,۲۳۲,۳۷۱	۳۴,۹۳۵,۳۱۲	۰٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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	(۴۷,۱۵۴,۷۹۹,۷۱۵)	-۱۰۰.۶٪	۹۱.۱٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۲-۲	۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	۰.۶٪	۰.۵٪
جمع کل		(۴۶,۸۸۹,۶۵۷,۸۰۳)	-۱۰۰.۰٪	۹۱.۶٪

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

درآمد سود سهام			اطلاعات مجمع			طی دوره			۱۴۰۲/۰۳/۳۱		
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	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	-	-	-	-	-	-	(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 ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

سود سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی

۱۴۰۲/۰۳/۳۱			طی دوره			نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	-	۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	۴۷,۶۵۳	-	۴۷,۶۵۳	۵٪	بدون سررسید	۱۴۰۲/۰۹/۲۹	سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر چکاپا
۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	-	۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	۴۷,۶۵۳	-	۴۷,۶۵۳				جمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمد‌ها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۳/۳۱				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
۱۳۵,۶۳۸,۵۰۸	(۱,۶۸۴,۹۸۲,۸۲۸)	۱,۸۲۰,۶۲۱,۳۳۶	۱۳۴,۰۱۸	۴۶,۲۹۱,۰۶۴	(۳۱۴,۳۱۶,۳۱۲)	۳۶۰,۶۰۷,۳۷۶	۲۵,۰۰۰	سندوق س. نوع دوم کارا -د
۶۱,۲۱۲,۶۳۸	(۳۹۹,۷۰۷,۱۶۵)	۴۶۰,۹۱۹,۸۰۳	۸,۶۹۷	-	-	-	-	سندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۰	(۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵)	۲۹,۸۱۰,۴۲۵,۵۸۵	۲,۹۶۷,۰۶۳	-	-	-	-	سندوق س. پارند پایدار سپهر
۰	(۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶)	۱۰۴,۳۷۳,۹۷۷,۰۴۶	۱۰,۲۶۷,۹۸۰	-	-	-	-	سندوق س. با درآمد ثابت کمند
۰	(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	-	-	-	-	ثروه صنایع کاغذ پارس
۰	(۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶)	۸۵,۴۲۸,۳۵۹,۸۵۶	۲۲,۲۸۱,۷۸۴	-	-	-	-	ولیدی فولاد سپید فراب کویر
(۵۵,۶۸۸,۵۵۸,۲۳۷)	(۲,۰۶۶,۱۸۸,۰۸۱,۶۲۸)	۲,۰۱۰,۴۹۹,۵۲۳,۳۹۱	۲۲۰,۷۱۶,۱۰۳	۴۶,۲۹۱,۰۶۴	(۳۱۴,۳۱۶,۳۱۲)	۳۶۰,۶۰۷,۳۷۶	۲۵,۰۰۰	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 ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۴۰۲/۰۳/۳۱				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	
۳,۳۰۷,۴۴۵,۲۳۸	(۲۱,۴۱۸,۱۳۵,۰۰۶)	۲۴,۷۲۵,۵۸۰,۲۴۴	۱,۷۰۳,۱۸۳	۴۵۵,۹۸۶,۸۱۷	(۲۴,۲۶۹,۵۹۳,۴۲۷)	۲۴,۷۲۵,۵۸۰,۲۴۴	۱,۷۰۳,۱۸۳	صندوق س. نوع دوم کارا -د
۴,۵۲۷,۳۸۹,۵۳۵	(۲۰,۴۷۷,۵۵۰,۳۶۸)	۲۵,۰۰۴,۹۳۹,۹۰۳	۴۴۵,۴۶۳	۵۱۸,۸۶۷,۰۸۹	(۲۴,۴۸۶,۰۷۲,۸۱۴)	۲۵,۰۰۴,۹۳۹,۹۰۳	۴۴۵,۴۶۳	صندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۷,۸۳۴,۸۳۴,۷۷۳	(۴۱,۸۹۵,۶۸۵,۳۷۴)	۴۹,۷۳۰,۵۲۰,۱۴۷	۲,۱۴۸,۶۴۶	۹۷۴,۸۵۳,۹۰۶	(۴۸,۷۵۵,۶۶۶,۲۴۱)	۴۹,۷۳۰,۵۲۰,۱۴۷	۲,۱۴۸,۶۴۶	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 ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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

۱۴۰۲/۰۳/۲۱					طی دوره					
درآمد سود	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل	درآمد سود	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع مبلغ	درصد از کل	سهام
۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-	(۵۵,۸۸۵,۴۰۹,۳۸۳)	(۵۵,۱۸۶,۴۸۵,۶۳۴)	-۱۱۷,۶۹٪	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	-	-	-	۰.۰٪	روه صنایع کاغذ پارس
-	۳,۳۰۷,۴۴۵,۲۳۸	۱۳۵,۶۳۸,۵۰۸	۳,۴۴۳,۰۸۳,۷۴۶	۷.۳۴٪	-	۴۶,۲۹۱,۰۶۴	۴۵۵,۹۸۶,۸۱۷	-	۱.۱٪	سندوق س. نوع دوم کارا -د
۰	۴,۵۲۷,۳۸۹,۵۳۵	۶۱,۲۱۲,۶۳۸	۴,۵۸۸,۶۰۲,۱۷۳	۹.۷۹٪	۰	۰	۵۱۸,۸۶۷,۰۸۹	-	۱.۱٪	سندوق س.اعتماد آفرین پارسیان-د
۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۷,۸۳۴,۸۳۴,۷۷۳	(۵۵,۶۸۸,۵۵۸,۲۳۷)	(۴۷,۱۵۴,۷۹۹,۷۱۵)	-۱۰.۱٪	۶۹۸,۹۲۳,۷۴۹	۴۶,۲۹۱,۰۶۴	۹۷۴,۸۵۳,۹۰۶	-	۲٪	مجمع کل

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی الگوریتم سرآمد بازار

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی دوره		۱۴۰۲/۰۳/۳۱	
نام سپرده		درصد سود به میانگین		درصد سود به میانگین سپرده	
شماره حساب		سود سپرده		سود سپرده	
سپرده کوتاه مدت-۷۰۰۱۰۰۰۸۵۸۶۷۰-بانک شهر-چکاپا		۱۰۰٪		۱۰۰٪	
جمع کل		۴۷,۶۵۳		۲۶۵,۱۴۱,۹۱۲	
		۱۰۰.۰۰٪		۱۰۰.۰۰٪	