

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۸/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹	
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی دوره		تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده
				تعداد	مبلغ فروش			
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۴۳۳,۶۲۷	۶,۶۷۸,۳۶۶,۳۰۸	۸,۴۰۳,۸۴۸,۴۸۴	۱,۸۷۴,۱۵۰	۳۰,۱۴۹,۵۴۱,۶۵۰	۹۸۳,۰۲۷	۲۲,۶۶۶,۵۰۸,۵۹۶	۲۱,۵۳۵,۴۰۸,۳۶۶
داروسازی سینا	۱,۱۷۴,۶۴۷	۱۷,۱۵۵,۹۴۳,۲۸۲	۲۴,۴۰۳,۰۲۸,۹۸۵	۳۳۰,۰۰۰	۵,۸۶۶,۱۳۸,۸۹۳	۱,۲۷۱,۳۱۶	۲۱,۷۳۳,۰۹۶,۶۵۰	۲۹,۱۲۷,۳۹۸,۰۶۱
شرکت ویتانا	۸۵۱,۱۷۶	۲۱,۳۹۲,۴۴۴,۷۹۳	۲۲,۲۹۳,۲۱۷,۸۲۵	۱,۱۰۶,۰۹۸	۳۸,۶۸۵,۲۶۳,۰۲۴	۵۳۱,۸۸۱	۱۴,۰۲۹,۸۶۴,۶۸۷	۱۴,۶۵۸,۹۵۵,۶۱۱
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳,۴۰۳,۸۸۸	۳۴,۴۸۹,۱۴۹,۸۸۳	۳۴,۶۰۶,۱۱۷,۱۷۱	۷,۱۹۰,۲۴۹	۱۰۴,۵۸۸,۹۵۰,۹۵۱	۲۰۲,۹۰۱	۲۰,۴۱۰,۴۷۲,۸۰۰	۲۰,۳۷۶,۶۷۰,۷۹۳
جمع	۵,۸۶۳,۳۳۸	۷۹,۷۱۵,۹۰۴,۲۶۶	۸۹,۷۰۶,۲۱۲,۴۶۶	۱۰,۵۰۰,۴۹۷	۱۷۹,۲۸۹,۸۹۴,۵۱۸	۲,۹۸۹,۱۲۵	۶۰,۴۷۰,۹۴۲,۷۳۳	۶۷,۳۵۹,۴۳۲,۸۳۱

درصد به کل دارایی‌های صندوق

خالص ارزش فروش

بهای تمام شده

قیمت بازار

تعداد

تعداد

مبلغ فروش

تعداد

بهای تمام شده

تعداد

خالص ارزش فروش

بهای تمام شده

تعداد

تعداد

تعداد

تعداد

تعداد

تعداد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۲-۱- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

درصد به کل دارایی‌های صندوق	۱۳۹۸/۱۲/۲۹			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۱/۳۰			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فراپورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده										
۳.۱۸٪	۴,۷۸۴,۴۹۵,۴۷۴	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۷,۹۹۳	۴,۷۵۰	-	-	-	۴,۷۶۰,۳۶۳,۹۸۲	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۰	۲۱	۲۱	۱۳۹۹/۰۲/۰۹	۱۳۹۵/۰۲/۰۹	بله	بله	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۳.۹۵٪	۵,۹۴۸,۶۱۴,۱۲۵	۶,۱۴۱,۶۴۳,۳۳۷	۹۳۰,۰۰۰	۶,۴۰۱	-	-	-	۵,۸۷۱,۸۶۴,۲۱۰	۶,۱۴۱,۶۴۳,۳۳۷	۶,۴۰۱	۱۹	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	بله	بله	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۰.۶۲٪	۹۳۷,۳۶۵,۹۱۶	۹۳۰,۶۷۴,۳۵۰	۹۳۸,۰۴۶	۱,۰۰۰	-	-	-	۹۳۹,۷۸۶,۱۶۰	۹۳۰,۶۷۴,۳۵۰	۱,۰۰۰	۱۹	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	بله	بله	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۷.۷۵٪	۱۱,۶۷۰,۴۷۵,۵۱۵	۱۱,۸۲۲,۳۱۷,۴۸۷		۱۲,۱۵۱	-	-	-	۱۱,۵۷۲,۰۱۴,۳۵۲	۱۱,۸۲۲,۳۱۷,۴۸۷	۱۲,۱۵۱							جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۱/۳۰		مشخصات حساب بانکی			سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۴.۹۷ %	۷,۴۸۸,۷۲۱,۹۳۱	۵,۹۱۷,۰۳۸,۶۰۳	۵,۱۳۵,۶۱۵,۴۱۵	۸,۲۷۰,۱۴۵,۱۱۹	ماه شمار ۱۰٪	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۷.۳۱ %	۱۱,۰۰۷,۲۱۹,۴۰۲	۲۹,۹۳۱,۵۶۹,۸۵۳	۲۰,۱۴۷,۵۱۲,۰۳۹	۲۰,۷۹۱,۲۷۷,۲۱۶	ماه شمار ۱۰٪	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۲.۶۸ %	۴,۰۳۶,۶۱۵,۲۸۷	۱۴,۲۲۵,۳۳۸,۲۵۸	۱۲,۸۴۸,۸۶۵,۱۱۱	۵,۴۱۳,۰۸۸,۴۳۴	ماه شمار ۱۰٪	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۱۳.۴۸ %	۲۰,۳۰۱,۴۲۹,۴۵۷	۳۴,۷۳۰,۲۸۶,۷۶۱	۵۲,۳۱۴,۵۴۵,۳۹۰	۲,۷۱۷,۱۷۰,۸۲۸	ماه شمار ۱۰٪	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۲۸.۴۴%	۴۲,۸۳۳,۹۸۶,۰۷۷	۸۴,۸۰۴,۲۳۳,۴۷۵	۹۰,۴۴۶,۵۳۷,۹۵۵	۳۷,۱۹۱,۶۸۱,۵۹۷					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			طی ماه			مشخصات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود	تاریخ سر رسید	روز دریافت سود	توضیحات
۶۵,۷۶۴,۰۷۳	-	۶۵,۷۶۴,۰۷۳	۱۵,۷۲۲,۰۹۳	-	۱۵,۷۲۲,۰۹۳	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۴۸۵,۰۵۹,۳۹۶	-	۴۸۵,۰۵۹,۳۹۶	۱۰۰,۶۳۷,۱۲۳	-	۱۰۰,۶۳۷,۱۲۳	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۷۶۲,۹۰۰,۸۸۱	-	۷۶۲,۹۰۰,۸۸۱	۵۷,۳۶۰,۴۲۷	-	۵۷,۳۶۰,۴۲۷	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۱۳۴,۰۳۰,۷۸۳	-	۱۳۴,۰۳۰,۷۸۳	۵۴,۸۵۱,۵۳۸	-	۵۴,۸۵۱,۵۳۸	ماه شمار ۱۰٪	۰	۱۹	بانک سامان سی تیر
۲۰۶,۳۴۱,۱۰۶	-	۲۰۶,۳۴۱,۱۰۶	۸۲,۷۱۸,۵۶۷	-	۸۲,۷۱۸,۵۶۷	ماه شمار ۱۰٪	۰	۱۴	بانک سامان سی تیر
۷۳,۷۶۲,۹۷۳	-	۷۳,۷۶۲,۹۷۳	۳۰,۱۰۰,۷۹۸	-	۳۰,۱۰۰,۷۹۸	ماه شمار ۱۰٪	۰	۱۴	بانک سامان سی تیر
۸,۲۱۹	-	۸,۲۱۹	۰	-	۰	ماه شمار ۱۰٪	۰	۱۷	بانک سامان سی تیر
۱,۷۲۷,۸۶۷,۴۳۱	۰	۱,۷۲۷,۸۶۷,۴۳۱	۳۴۱,۳۹۰,۵۴۶	۰	۳۴۱,۳۹۰,۵۴۶				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

توضیحات	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام	۱-۲	۱۹,۷۶۸,۲۸۲,۸۵۰	۹۰.۵۱٪	۲۰.۱۰٪
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۱,۲۳۱,۲۷۷,۶۲۳	۵.۶۴٪	۱.۲۵٪
درآمد حاصل از سپرده بانکی	۳-۲	۴۱۴,۱۴۳,۰۸۱	۱.۹۰٪	۰.۴۲٪
سایر درآمدها	۴-۲	۴۲۶,۰۸۳,۱۱۷	۱.۹۵٪	۰.۴۳٪
جمع		۲۱,۸۳۹,۷۸۶,۶۷۱	۹۸٪	۲۱.۷۷٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

درآمد سود سهام و صندوق سرمایه‌گذاری:

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه				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 متعلقه در زمان مجمع		تاریخ تشکیل مجمع
۴۵۸,۱۸۸,۸۲۲	(۶۶,۵۳۱,۵۲۸)	۵۲۴,۷۲۰,۳۵۰	-	-	-	۵۵۰	۹۵۴,۰۳۷	۱۳۹۸/۱۱/۲۶	ویتانا
۹۶۸,۷۵۷,۰۹۴	-	۹۶۸,۷۵۷,۰۹۴	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	-	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	-	-	-	سود صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم
۱,۴۲۶,۹۴۵,۹۱۶	(۶۶,۵۳۱,۵۲۸)	۱,۴۹۳,۴۷۷,۴۴۴	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	-	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	-	-	-	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار:

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش
داروسازی سینا	۲۳۳,۳۳۱	۵,۸۶۶,۱۳۸,۸۹۳	۴,۴۴۵,۳۹۷,۵۲۶	۱,۴۲۰,۷۴۱,۳۶۷	۱,۴۸۰,۶۷۶	۲۸,۳۹۳,۷۲۴,۱۹۴	۲۷,۷۹۳,۱۷۶,۴۷۴	۶۰۰,۵۴۷,۷۲۰
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱,۳۲۴,۷۵۰	۳۰,۱۴۹,۵۴۱,۶۵۰	۲۷,۶۵۸,۴۳۱,۰۶۳	۲,۴۹۱,۱۱۰,۵۸۷	۹,۳۴۰,۳۹۷	۱۲۸,۲۶۷,۱۷۸,۰۹۱	۱۱۹,۲۲۰,۴۹۷,۵۹۲	۹,۰۴۶,۶۸۰,۴۹۹
ویانا	۱,۴۲۵,۳۹۳	۳۸,۶۸۵,۲۶۳,۰۲۴	۳۶,۹۶۳,۱۸۴,۳۹۶	۱,۷۲۲,۰۷۸,۶۲۸	۶,۸۰۳,۶۰۴	۱۴۶,۲۷۸,۲۶۹,۷۴۱	۱۴۰,۱۶۵,۲۴۴,۱۶۹	۶,۱۱۳,۰۲۵,۵۷۲
صندوق س. دارا الگوریتم	۱۰,۳۹۱,۲۳۶	۱۰۴,۵۸۸,۹۵۰,۹۵۱	۱۰۴,۹۱۵,۲۹۵,۷۲۴	(۳۶,۳۴۴,۷۷۳)	۴۵,۱۶۱,۴۶۰	۴۵۴,۱۴۸,۰۹۳,۸۵۱	۴۵۴,۷۶۳,۰۱۶,۴۸۷	(۶۱۴,۹۲۳,۶۳۶)
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	۲۶,۰۲۷	۷۰,۱۹۲۶,۵۵۱	۷۱۶,۳۷۴,۹۵۶	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)
اسناد خزانه-م ۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۷۴,۱۶۰,۹۸۵	۹۳۲,۰۵۲,۵۰۷	۴۲,۱۰۸,۴۷۸
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	-	-	-	-	۴,۷۵۰	۴,۷۴۶,۵۵۶,۲۸۱	۴,۷۹۶,۰۱۰,۶۲۰	(۴۹,۴۵۴,۳۳۹)
اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	۱,۵۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۴,۴۲۳,۰۳۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰
اسناد خزانه-م ۶ بودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲	-	-	-	-	۷,۹۰۰	۷,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۸۰۲,۸۲۵,۲۴۷	۹۷,۱۷۴,۷۵۳
جمع	۱۳,۳۷۴,۷۱۰	۱۷۹,۲۸۹,۸۹۴,۵۱۸	۱۷۳,۹۸۲,۳۰۸,۷۰۹	۵,۳۰۷,۵۸۵,۸۰۹	۶۲,۷۲۷,۳۱۴	۷۷۲,۴۰۹,۹۰۸,۶۹۴	۷۵۷,۱۶۳,۶۲۱,۰۸۲	۱۵,۲۴۶,۲۸۷,۶۱۳

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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار:

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری
ویتانا	۵۳۱,۸۸۱	۱۴,۶۵۸,۹۵۵,۶۱۱	۱۴,۹۲۷,۶۰۱,۴۰۷	۵۳۱,۸۸۱	۱۴,۶۵۸,۹۵۵,۶۱۱	۱۴,۰۳۰,۴۷۵,۴۸۷
داروسازی سینا	۱,۳۷۱,۳۱۶	۲۹,۱۲۷,۳۹۸,۰۶۱	۲۸,۱۷۲,۱۵۷,۷۹۵	۱,۳۷۱,۳۱۶	۲۹,۱۲۷,۳۹۸,۰۶۱	۲۵,۴۱۰,۳۱۶,۸۲۴
صندوق س. دارا الگوریتم	۲۰۲,۹۰۱	۲,۰۳۷,۶۷۰,۷۹۲	۲,۱۵۸,۴۴۵,۰۶۳	۲۰۲,۹۰۱	۲,۰۳۷,۶۷۰,۷۹۲	۲,۰۴۱,۴۷۲,۷۸۱
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۸۳,۰۲۷	۲۱,۵۳۵,۴۰۸,۳۶۶	۲۴,۳۹۱,۰۹۰,۹۸۳	۹۸۳,۰۲۷	۲۱,۵۳۵,۴۰۸,۳۶۶	۲۲,۶۶۶,۷۱۲,۵۵۶
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱,۰۰۰	۹۳۷,۳۶۵,۹۱۶	۹۳۹,۷۸۶,۱۶۰	۱,۰۰۰	۹۳۷,۳۶۵,۹۱۶	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۴,۷۵۰	۴,۷۸۴,۴۹۵,۴۷۴	۴,۷۶۰,۳۶۳,۹۸۱	۴,۷۵۰	۴,۷۸۴,۴۹۵,۴۷۴	۴,۷۹۶,۰۱۰,۶۱۹
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۶,۴۰۱	۵,۹۴۸,۶۱۴,۱۲۵	۵,۸۷۱,۸۶۴,۳۱۰	۶,۴۰۱	۵,۹۴۸,۶۱۴,۱۲۵	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷
جمع	۳,۰۰۱,۲۷۶	۷۹,۰۲۹,۹۰۸,۳۴۵	۸۱,۲۲۱,۳۰۹,۵۹۹	۳,۰۰۱,۲۷۶	۷۹,۰۲۹,۹۰۸,۳۴۵	۷۶,۰۱۷,۳۰۵,۷۵۴
						۳,۰۱۲,۶۰۲,۵۹۵

سود و زیان ناشی از
تغییر قیمت

سود و زیان ناشی
از تغییر قیمت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها
داروسازی سینا	-	۹۵۵,۲۴۰,۲۶۶	۱,۴۲۰,۷۴۱,۳۶۷	۲,۳۷۵,۹۸۱,۶۳۳	۱۷,۴۳٪	-	-	۴,۳۱۷,۶۲۸,۹۵۷	۱۹,۷۷٪
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	-	(۲,۸۵۵,۶۸۲,۶۱۶)	۲,۴۹۱,۱۱۰,۵۸۷	(۳۶۴,۵۷۲,۰۲۹)	-۲,۶۷٪	-	-	۷,۹۱۵,۳۷۶,۳۱۰	۳۶,۲۴٪
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	۰,۰۰٪	-	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	-۰,۰۷٪
ویتانا	-	(۲۶۸,۶۴۵,۷۹۵)	۱,۷۲۲,۰۷۸,۶۲۸	۱,۴۵۳,۴۳۲,۸۳۳	۱۰,۶۶٪	۶۲۸,۴۸۰,۱۲۴	۶,۱۱۳,۰۲۵,۵۷۲	۷,۱۹۹,۶۹۴,۵۱۸	۳۲,۹۷٪
صندوق س. دارا الگوریتم	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	(۱۲۰,۷۷۴,۲۷۰)	(۳۲۶,۳۴۴,۷۷۳)	(۴۴۷,۱۱۹,۰۴۳)	-۳,۲۸٪	۹۶۸,۷۵۷,۰۹۴	(۶۱۴,۹۲۳,۶۳۶)	۳۵۰,۰۳۱,۴۷۰	۱,۶۰٪
جمع	۳۴۵,۸۴۵,۵۹۰	(۲,۲۸۹,۸۶۲,۴۱۵)	۵,۳۰۷,۵۸۵,۸۰۹	۳,۰۱۷,۷۲۳,۳۹۴	۲۲,۱۳٪	۱,۴۲۶,۹۴۵,۹۱۶	۲,۳۱۰,۴۵۵,۱۸۴	۱۹,۷۶۸,۲۸۲,۸۵۰	۹۰,۵۰٪

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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
۴۲,۱۰۸,۴۷۸	۴۲,۱۰۸,۴۷۸	-	-	-	-	-	-	اسناد خزانه-م ۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴
۷۰۱,۹۳۱,۳۹۸	(۴۹,۴۵۴,۳۳۹)	(۱۱,۵۱۵,۱۴۴)	۷۶۲,۹۰۰,۸۸۱	۸۱,۴۹۱,۹۲۰	-	۲۴,۱۳۱,۴۹۳	۵۷,۳۶۰,۴۲۷	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۵,۵۷۶,۹۷۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰	-	-	-	-	-	-	اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
۹۷,۱۷۴,۷۵۳	۹۷,۱۷۴,۷۵۳	-	-	-	-	-	-	اسناد خزانه-م ۶ بودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲
۷۲,۴۵۵,۷۳۹	-	۶,۶۹۱,۶۶۶	۶۵,۷۶۴,۰۷۳	۱۳,۳۰۱,۸۵۰	-	(۲,۴۲۰,۲۴۳)	۱۵,۷۲۲,۰۹۳	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۲۹۲,۰۳۰,۲۸۵	-	(۱۹۳,۰۲۹,۱۱۱)	۴۸۵,۰۵۹,۳۹۶	۱۷۷,۳۸۷,۰۳۸	-	۷۶,۷۴۹,۹۱۵	۱۰۰,۶۳۷,۱۲۳	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱,۲۳۱,۲۷۷,۶۲۳	۱۱۵,۴۰۵,۸۶۲	(۱۹۷,۸۵۲,۵۸۹)	۱,۳۱۳,۷۲۴,۳۵۰	۲۷۲,۱۸۰,۸۰۸	-	۹۸,۴۶۱,۱۶۵	۱۷۳,۷۱۹,۶۴۳	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

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

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۳۲.۳۶٪	۱۳۴,۰۳۰,۷۸۳	۳۲.۷۱٪	۵۴,۸۵۱,۵۳۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۴۹.۸۲٪	۲۰۶,۳۴۱,۱۰۶	۴۹.۳۳٪	۸۲,۷۱۸,۵۶۷	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۱۷.۸۱٪	۷۳,۷۶۲,۹۷۳	۱۷.۹۵٪	۳۰,۱۰۰,۷۹۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۰.۰۰٪	۸,۲۱۹	۰.۰۰٪	۰	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۱۰۰٪	۴۱۴,۱۴۳,۰۸۱	۱۰۰٪	۱۶۷,۶۷۰,۹۰۳		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۸/۱۲/۲۹	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۱۳۶,۰۸۴,۵۷۸	۱۸,۶۸۰,۹۳۱	سایر درآمدها
۲۸۹,۹۹۸,۵۳۹	۱۲۱,۸۲۲,۱۲۸	درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی
۴۲۶,۰۸۳,۱۱۷	۱۴۰,۵۰۳,۰۵۹	جمع