



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی ماهانه

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورنقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

— سرمایه‌گذاری‌ها

—۱—سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره					۱۳۹۹/۰۲/۳۱				
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	درصد به کل دارایی‌های صندوق		
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۸۲۲,۹۹۸	۲۴,۶۲۴,۸۰۰,۱۰۸	۲۷,۳۶۷,۷۹۴,۱۲۶	۳۷,۱۲۹,۱۰۹,۶۵۸	(۸۳۹,۴۷۶)	۳۰,۴۷۷,۶۳۸,۸۵۱	۳۰,۴۷۷,۶۳۸,۸۵۱	۱۰,۱۵,۲۷۲	۳۹,۲۹۷,۹۳۲,۴۹۸	۳۴,۵۵۶,۰۱۳,۹۷۶	۳۹,۲۹۷,۹۳۲,۴۹۸	۱۸,۲۶%			
داروسازی سینا	۱,۳۵۵,۴۹۹	۲۵,۹۶۶,۳۱۱,۹۱۵	۳۷,۰۱۸,۱۳۳,۰۳۷	۱۰,۱۵۴,۵۶۴,۴۹۰	(۳۷۵,۰۰۰)	۱۳,۷۷۹,۸۳۶,۷۳۴	۱۳,۷۷۹,۸۳۶,۷۳۴	۲۵۳,۱۸۰	۵۵,۲۳۰,۱۵۲,۵۹۱	۲۸,۶۳۹,۸۶۹,۵۸۲	۵۵,۲۳۰,۱۵۲,۵۹۱	۲۵,۶۶%			
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۳,۱۷۲,۱۷۶	۳۲,۳۴۳,۶۰۸,۴۳۷	۳۲,۴۰۵,۷۶۹,۱۱۰	۱,۶۰۱,۲۱۸,۳۰۱,۳۱۵	(۱۵۵,۷۸۳,۸۵۷)	۱,۶۱۱,۱۲۳,۸۰۶,۸۸۸	۱,۶۱۱,۱۲۳,۸۰۶,۸۸۸	۱۵۴,۲۹۴,۴۴۳	۱۷,۵۷۴,۹۳۳,۱۲۱	۱۷,۴۸۷,۴۲۰,۶۰۸	۱۷,۵۷۴,۹۳۳,۱۲۱	۸,۱۶%			
وینانا	۶۶۶,۰۴۶	۲۵,۱۸۸,۵۰۵,۹۹۸	۲۹,۵۶۷,۸۸۷,۷۸۴	۳۷,۳۹۹,۵۵۲,۷۶۷	(۸۵۷,۴۶۸)	۴۹,۸۰۷,۵۲۸,۲۷۴	۴۹,۸۰۷,۵۲۸,۲۷۴	۶۵۰,۶۱۷	۳۲,۹۶۸,۵۴۰,۹۳۷	۲۴,۴۴۹,۵۹۱,۰۱۳	۳۲,۹۶۸,۵۴۰,۹۳۷	۱۵,۲۳%			
جمع	۶,۰۱۶,۷۱۹	۱۰۸,۱۲۳,۲۲۶,۴۵۸	۱۲۶,۲۵۹,۵۸۴,۰۵۸	۱,۶۸۵,۹۰۱,۴۲۸,۲۳۰	(۱۵۷,۸۵۵,۸۰۱)	۱,۷۰۵,۱۸۷,۸۱۰,۷۴۷	۱,۷۰۵,۱۸۷,۸۱۰,۷۴۷	۱۵۶,۳۱۳,۵۱۲	۱۴۵,۰۷۱,۵۵۹,۱۴۷	۱۰۵,۱۳۲,۸۹۵,۱۷۹	۱۴۵,۰۷۱,۵۵۹,۱۴۷	۶۷,۴%			

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
صورت وضعیت پورتنوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱					
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سر رسید	نرخ سود	نرخ موثر	خالص ارزش		تعداد	بهای تمام شده	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌های صندوق
							تعداد	بهای تمام شده			تعداد	مبلغ فروش	تعداد	مبلغ فروش					
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	بله	بله	۱۳۹۵/۰۳/۰۹	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۳۱	۳۱	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۶۵,۴۷۱,۲۷۶	۰	۰	۰	۰	۴,۷۵۰	۱,۰۰۱,۱۵۴	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۲,۰۳۳,۷۷۵	۲,۲۱	%
منفعت صبا از روند سپهر ۱۴۰۰۱۳۳۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۶,۱۴۱,۶۴۳,۳۳۷	۶,۱۴۱,۶۴۳,۳۳۷	۶,۲۰۴,۴۶۸,۴۹۶	۰	۰	۰	۰	۶,۴۰۱	۱,۰۱۰,۰۰۰	۶,۱۴۱,۶۴۳,۳۳۷	۶,۴۶۰,۳۲۲,۸۶۷	۳,۰۰	%
منفعت صبا از روند لوتوس ۱۴۰۰۱۳۳۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۹۳۹,۵۱۷,۳۵۵	۰	۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۹۸۵,۰۰۱	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۹۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۰,۴۶	%
اسناد خزانه -م-۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶	بله	بله	۱۳۹۹/۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۸/۰۶	۰	۰	۰	۰	۰	۶,۱۶۰,۵۶۳,۱۶۳	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۱۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع							۱۱,۸۲۲,۳۱۷,۴۸۷	۱۱,۹۰۹,۴۵۷,۱۲۷	۱۲,۱۵۱	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۰,۵۶۳,۱۶۳	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۱۲,۱۵۱		۱۱,۸۲۲,۳۱۷,۴۸۷	۱۲,۱۹۶,۶۴۳,۵۱۶	۵,۶۷	%

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	مشخصات حساب بانکی				۱۳۹۹/۰۱/۳۱	تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۲/۳۱
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	ماه شمار ۱۰٪	۵,۰۰۰,۶۴۶,۹۹۳	۱۰,۲۷۴,۴۳۳,۳۰۳	۳,۲۸۶,۸۳۰,۳۴۸	۱۱,۹۸۸,۲۵۰,۰۴۸
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۱۵,۹۶۹,۶۰۶,۷۵۱	۳,۵۲۹,۴۴۹,۲۹۵	۷,۹۶۴,۶۶۱,۶۰۵	۱۱,۵۳۴,۳۹۴,۴۴۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۶,۰۴۸,۱۱۶,۷۰۶	۲۰,۵۹۴,۶۰۶,۲۷۱	۴,۶۷۸,۳۹۰,۰۲۸	۲۱,۹۶۴,۳۳۲,۹۴۹
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ماه شمار ۱۰٪	۵,۹۵۴,۰۴۳,۶۱۵	۱,۵۵۶,۱۵۴,۴۵۳,۵۷۱	۱,۵۶۱,۶۶۷,۷۱۰,۸۸۷	۱۰,۴۴۰,۷۸۶,۲۹۹
جمع					۳۲,۹۷۲,۴۱۴,۰۶۵	۱,۶۰۰,۵۵۲,۹۴۲,۴۴۰	۱,۵۷۷,۵۹۷,۵۹۲,۷۶۸	۵۵,۹۲۷,۷۶۳,۷۳۷
								۲۵.۹۸٪
								درصد به کل دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

مشخصات			طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
توضیحات	روز دریافت	تاریخ سر رسید	نرخ سود	درآمد سود	هزینه تنزیل	خالص درآمد	درآمد سود	هزینه تنزیل
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۵,۴۹۱,۹۴۷	-	۱۵,۴۹۱,۹۴۷	۹۶,۲۲۸,۵۸۶	-
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۹۹,۱۶۳,۹۵۸	-	۹۹,۱۶۳,۹۵۸	۶۸۰,۰۶۲,۷۵۰	-
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۰	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۲۱	۸۶,۷۹۴,۷۹۸	-	۸۶,۷۹۴,۷۹۸	۹۳۳,۴۲۶,۴۶۷	-
بانک سامان سی تیر	۱۹	۰	ماه شمار ۱۰٪	۳۳,۶۹۵,۹۷۸	-	۳۳,۶۹۵,۹۷۸	۲۲۳,۸۵۳,۴۰۹	-
بانک سامان سی تیر	۱۴	۰	ماه شمار ۱۰٪	۱۰۳,۹۴۸,۴۶۵	-	۱۰۳,۹۴۸,۴۶۵	۳۵۱,۸۶۵,۵۰۱	-
بانک سامان سی تیر	۱۴	۰	ماه شمار ۱۰٪	۲۸,۸۵۷,۴۷۸	-	۲۸,۸۵۷,۴۷۸	۱۲۱,۵۱۳,۰۹۹	-
بانک سامان سی تیر	۱۷	۰	ماه شمار ۱۰٪	۶,۹۵۹	-	۶,۹۵۹	۴۴,۸۳۱,۷۱۱	-
جمع				۳۶۷,۹۵۹,۵۸۳	۰	۳۶۷,۹۵۹,۵۸۳	۲,۴۵۱,۷۸۱,۵۲۳	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری ها

توضیحات	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام	۱-۲	۸۲,۸۶۰,۳۴۵,۲۲۳	۹۵/۷۵٪	۸۴/۲۴٪
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۲,۱۵۴,۰۶۱,۵۵۲	۲/۴۹٪	۲/۱۹٪
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۷۴۲,۰۶۳,۷۲۰	۰/۸۶٪	۰/۷۵٪
سایر درآمدها	۴-۲	۷۸۱,۴۸۷,۲۱۵	۰/۹۰٪	۰/۷۹٪
جمع		۸۶,۵۳۷,۹۵۷,۷۱۰	۱۰۰٪	۸۷/۹۸٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

درآمد سود سهام و سود صندوق سرمایه گذاری:

اطلاعات مجمع		طی ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
نام سهام	تاریخ تشکیل مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
ویتانا	۱۳۹۸/۱/۲۶	۹۵۴,۰۳۷	۵۵۰	-	-	۴۷۵,۸۳۳,۳۶۱
سود صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم	-	-	-	۱,۱۰۰,۷۴۵,۰۷۲	-	۲,۰۶۹,۵۰۲,۱۶۶
				۱,۱۰۰,۷۴۵,۰۷۲	-	۲,۵۴۵,۲۳۵,۵۲۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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	۳۷۵,۰۰۰	۱۳,۷۷۹,۸۳۶,۷۳۴	۸,۲۸۱,۴۵۸,۳۶۰	۵,۴۹۸,۳۷۸,۳۷۴	۲,۰۸۶,۰۶۶	۴۸,۱۶۷,۹۳۴,۶۹۸	۴۰,۸۱۹,۸۶۱,۲۹۲	۷,۳۴۸,۰۷۳,۴۰۶
وینتانا	۸۵۷,۴۶۸	۴۹,۸۰۷,۵۲۸,۲۷۴	۳۸,۱۳۸,۴۷۳,۴۷۰	۱۱,۶۶۹,۰۵۴,۸۰۴	۹,۳۸۶,۲۹۷	۲۵۶,۹۲۱,۳۶۹,۶۵۲	۲۳۲,۵۲۴,۹۸۵,۶۸۳	۲۳,۳۹۶,۳۸۳,۹۶۹
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۱۵۵,۷۸۳,۸۵۷	۱,۶۱۱,۱۳۲,۸۰۶,۸۸۷	۱,۶۱۶,۰۷۴,۳۸۹,۱۴۴	(۴,۹۵۱,۵۸۲,۳۵۶)	۲۳۸,۱۵۳,۳۴۷	۳,۳۴۰,۳۸۶,۱۸۲,۳۰۶	۲,۳۴۶,۴۷۰,۳۶۷,۴۹۰	(۶,۱۸۴,۱۸۵,۱۸۴)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۸۳۹,۴۷۶	۳۰,۴۷۷,۶۳۸,۸۵۱	۲۷,۱۹۷,۹۲۵,۹۴۹	۳,۲۷۹,۷۱۲,۹۰۲	۱۱,۲۳۹,۹۰۲	۱۹۳,۶۸۷,۹۷۰,۳۴۸	۱۷۵,۵۸۷,۴۷۹,۰۵۳	۱۸,۱۰۰,۴۹۱,۱۹۵
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	۲۶,۰۲۷	۷۰۱,۹۲۶,۵۵۱	۷۱۶,۳۷۴,۹۵۶	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)
اسناد خزانه-م۲ ابودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۷۴,۱۶۰,۹۸۵	۹۳۲,۰۵۲,۵۰۷	۴۱,۷۶۴,۴۶۳
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	-	-	-	-	۴,۷۵۰	۴,۷۴۶,۵۵۶,۳۸۱	۴,۷۹۶,۰۱۰,۶۲۰	(۴۹,۴۵۴,۳۳۹)
اسناد خزانه-م۴ ابودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	۱,۵۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۴,۴۲۳,۰۳۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰
اسناد خزانه-م۶ ابودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲	-	-	-	-	۷,۹۰۰	۷,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۸۰۳,۸۲۵,۳۴۷	۹۷,۱۷۴,۷۵۳
اسناد خزانه-م۲۰ ابودجه ۹۸-۲۰۸۰۶	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۶,۱۵۶,۰۹۲,۸۱۷	۵,۴۳۶,۸۳۷	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۶,۱۵۶,۰۹۲,۸۱۷	۹۶۶,۴۹۱
جمع	۱۵۷,۸۶۵,۸۰۱	۱,۷۱۱,۳۴۹,۲۴۰,۴۰۰	۱,۶۹۵,۸۴۸,۳۳۹,۷۴۰	۱۵,۵۰۱,۰۰۰,۰۶۶۱	۲۵۰,۹۱۶,۷۸۹	۲,۸۶۰,۵۴۷,۶۳۰,۳۷۵	۲,۸۱۷,۷۸۰,۴۷۲,۶۹۵	۴۲,۷۶۲,۳۴۳,۳۱۹

ارزش دفتری برابر است با میانگین هموزن خالصی 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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار:

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
وینانا	۴۵۹,۱۹۵	۳۲,۹۶۸,۵۴۰,۹۳۶	۲۸,۸۲۸,۹۶۷,۰۸۱	۴,۱۳۹,۵۷۳,۸۵۵	۴۵۹,۱۹۵	۳۲,۹۶۸,۵۴۰,۹۳۶	۲۴,۴۴۹,۵۹۲,۸۱۱	۸,۵۱۸,۹۴۸,۱۲۵
داروسازی سینا	۱,۲۳۳,۶۷۹	۵۵,۲۳۰,۱۵۲,۵۹۱	۳۸,۸۹۱,۲۳۹,۱۶۶	۱۶,۳۳۸,۹۱۳,۴۲۵	۱,۲۳۳,۶۷۹	۵۵,۲۳۰,۱۵۲,۵۹۱	۳۰,۹۰۹,۸۱۷,۶۳۹	۲۴,۳۲۰,۳۳۴,۹۵۲
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۱,۶۸۲,۷۶۲	۱۷,۵۷۴,۹۳۳,۱۲۱	۱۷,۵۴۹,۵۸۱,۲۸۱	۲۵,۳۵۱,۸۴۰	۱,۶۸۲,۷۶۲	۱۷,۵۷۴,۹۳۳,۱۲۱	۱۷,۴۸۷,۴۲۰,۶۰۸	۸۷,۵۱۲,۵۱۳
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۹۸,۷۹۴	۳۹,۳۹۷,۹۳۲,۴۹۸	۳۷,۱۹۸,۹۷۷,۸۳۵	۲,۰۹۸,۹۵۴,۶۶۳	۹۹۸,۷۹۴	۳۹,۳۹۷,۹۳۲,۴۹۸	۳۴,۵۵۶,۰۳۳,۳۷۳	۴,۷۴۱,۸۹۹,۱۲۵
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱,۰۰۰	۹۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۹۳۹,۵۱۷,۳۵۵	۴۴,۷۶۹,۵۱۹	۱,۰۰۰	۹۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۵۳,۶۱۲,۶۲۴
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۴,۷۵۰	۴,۷۵۲,۰۳۳,۷۷۵	۴,۷۶۵,۴۷۱,۲۷۵	(۱۳,۴۳۷,۴۹۹)	۴,۷۵۰	۴,۷۵۲,۰۳۳,۷۷۵	۴,۷۹۶,۰۱۰,۶۱۹	(۴۳,۹۷۶,۸۴۳)
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۶,۴۰۱	۶,۴۶۰,۳۲۲,۸۶۷	۶,۲۰۴,۴۶۸,۴۹۶	۲۵۵,۸۵۴,۳۷۱	۶,۴۰۱	۶,۴۶۰,۳۲۲,۸۶۷	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۳۱۸,۶۷۹,۶۳۰
جمع	۴,۳۸۶,۵۸۱	۱۵۷,۲۶۸,۲۰۲,۶۶۲	۱۳۴,۳۷۸,۲۲۲,۴۸۹	۲۲,۸۸۹,۹۸۰,۱۷۴	۴,۳۸۶,۵۸۱	۱۵۷,۲۶۸,۲۰۲,۶۶۲	۱۱۹,۲۷۱,۱۹۲,۵۳۷	۳۷,۹۹۷,۰۱۰,۱۳۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه					طی ماه					نام شرکت
درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۳۵.۷۸٪	۳۱,۶۶۸,۴۰۸,۳۵۸	۷,۳۴۸,۰۷۳,۴۰۶	۲۴,۳۲۰,۳۳۴,۹۵۲	-	۵۳.۹۷٪	۲۱,۸۳۷,۲۹۱,۷۹۹	۵,۴۹۸,۳۷۸,۳۷۴	۱۶,۳۳۸,۹۱۳,۴۲۵	-	داروسازی سینا
۳۵.۸۱٪	۳۲,۸۴۲,۳۹۰,۳۲۰	۱۸,۱۰۰,۴۹۱,۱۹۵	۴,۷۴۱,۸۹۹,۱۲۵	-	۱۳.۳۹٪	۵,۳۷۸,۶۶۷,۵۶۵	۳,۲۷۹,۷۱۲,۹۰۲	۲,۰۹۸,۹۵۴,۶۶۳	-	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۳۶.۶۰٪	۳۲,۳۹۱,۱۶۵,۴۵۵	۲۳,۳۹۶,۳۸۳,۹۶۹	۸,۵۱۸,۹۴۸,۱۲۵	۴۷۵,۸۳۳,۳۶۱	۳۹.۰۷٪	۱۵,۸۰۸,۶۲۸,۶۵۹	۱۱,۶۶۹,۰۵۴,۸۰۴	۴,۱۳۹,۵۷۳,۸۵۵	-	ویتانا
(۶.۸۹)٪	(۴,۰۲۷,۱۷۰,۵۰۵)	(۶,۱۸۴,۱۸۵,۱۸۴)	۸۷,۵۱۲,۵۱۳	۲,۰۶۹,۵۰۲,۱۶۶	(۱۲.۱۷)٪	(۳,۸۲۵,۴۸۵,۳۴۴)	(۴,۹۵۱,۵۸۲,۳۵۶)	۲۵,۳۵۱,۸۴۰	۱,۱۰۰,۷۴۵,۰۷۲	صندوق س. دارا الگوریتم-د
(۰.۰۲)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	-	-	۰٪	-	-	-	-	سنگ آهن گهرزمین
۹۱.۲۸٪	۸۲,۸۶۰,۳۴۵,۲۲۳	۴۲,۶۴۶,۳۱۴,۹۸۱	۳۷,۶۶۸,۶۹۴,۷۱۵	۲,۵۴۵,۳۳۵,۵۲۷	۹۴.۱۴٪	۳۹,۱۹۹,۱۰۲,۶۷۹	۱۵,۴۹۵,۵۶۳,۸۲۴	۲۲,۶۰۲,۷۹۳,۷۸۳	۱,۱۰۰,۷۴۵,۰۷۲	جمع

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره یا خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

توضیحات	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع	درآمد سود اوراق	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۸۶,۷۹۴,۷۹۸	(۱۳,۴۳۷,۴۹۹)	-	۷۳,۳۵۷,۲۹۹	۹۳۳,۴۲۶,۴۶۷	(۴۳,۹۷۶,۸۴۳)	(۴۹,۴۵۴,۳۳۹)	۸۳۹,۹۹۵,۲۸۵
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱۵,۴۹۱,۹۴۷	۴۴,۷۶۹,۵۱۹	-	۶۰,۲۶۱,۴۶۶	۹۶,۲۲۸,۵۸۶	۵۳,۶۱۲,۶۲۴	-	۱۴۹,۸۴۱,۲۱۰
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۹۹,۱۶۳,۹۵۸	۲۵۵,۸۵۴,۳۷۱	-	۳۵۵,۰۱۸,۳۲۹	۶۸۰,۰۶۲,۷۵۰	۳۱۸,۶۷۹,۶۳۰	-	۹۹۸,۷۴۲,۳۸۰
اسناد خزانه-م-۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶	-	۵,۴۳۶,۸۳۷	۵,۴۳۶,۸۳۷	-	-	-	۹۶۶,۴۹۱	۹۶۶,۴۹۱
اسناد خزانه-م-۴ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	-	-	۲۵,۵۷۶,۹۷۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰
اسناد خزانه-م-۶ بودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲	-	-	-	-	-	-	۹۷,۱۷۴,۷۵۳	۹۷,۱۷۴,۷۵۳
اسناد خزانه-م-۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	-	-	۴۱,۷۶۴,۴۶۳	۴۱,۷۶۴,۴۶۳
جمع	۲۰۱,۴۵۰,۷۰۳	۲۸۷,۱۸۶,۳۹۱	۵,۴۳۶,۸۳۷	۴۹۴,۰۷۳,۹۳۱	۱,۷۰۹,۷۱۷,۸۰۳	۳۲۸,۳۱۵,۴۱۱	۱۱۶,۰۲۸,۳۳۸	۲,۱۵۴,۰۶۱,۵۵۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

نام سپرده بانکی		طی ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی	درصد سود به میانگین سپرده
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	۳۳,۶۹۵,۹۷۸	۲۰/۲۴٪	۲۲۳,۸۵۳,۴۰۹	۳۰/۱۷٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۱۰۳,۹۴۸,۴۶۵	۶۲/۴۳٪	۳۵۱,۸۶۵,۵۰۱	۴۷/۴۳٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۲۸,۸۵۷,۴۷۸	۱۷/۳۳٪	۱۲۱,۵۱۳,۰۹۹	۱۶/۳۸٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۶,۹۵۹	۰/۰۰٪	۴۴,۸۳۱,۷۱۱	۶/۰۴٪
جمع		۱۶۶,۵۰۸,۸۸۰	۱۰۰٪	۷۴۲,۰۶۳,۷۲۰	۱۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۰۲/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۱۳۶,۰۸۴,۵۷۸	-	سایر درآمدها
۶۴۵,۴۰۲,۶۳۷	۲۱۷,۸۶۵,۷۴۹	درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی
۷۸۱,۴۸۷,۲۱۵	۲۱۷,۸۶۵,۷۴۹	جمع