

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۹/۰۳/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱			نام شرکت
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۱۵.۲۷٪	۴۲,۴۸۹,۶۰۰,۵۹۵	۳۷,۸۵۷,۵۳۳,۵۴۱	۴۶,۱۳۵	۹۲۴,۸۷۴	۳۸,۹۷۵,۵۲۱,۹۹۱	(۸۷۳,۹۲۰)	۳۶,۳۳۵,۹۲۳,۷۰۳	۸۰۰,۰۰۰	۳۹,۲۹۷,۹۳۲,۴۹۸	۳۴,۵۵۶,۰۱۳,۹۷۶	۹۹۸,۷۹۴	سعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۲۸.۶۰٪	۷۸,۹۳۰,۸۸۱,۹۶۰	۴۵,۸۰۵,۵۲۶,۰۹۶	۵۵,۱۱۰	۱,۴۳۷,۹۸۰	۱۴,۹۹۸,۹۵۵,۶۲۳	(۳۰۷,۶۹۹)	۲۴,۰۳۸,۱۴۲,۲۰۰	۵۱۲,۰۰۰	۵۵,۲۳۰,۱۵۲,۵۹۱	۲۸,۶۳۹,۸۶۹,۵۸۲	۱,۲۳۳,۶۷۹	داروسازی سینا
۲۰.۲۳٪	۵۶,۲۶۷,۱۸۸,۹۰۰	۵۵,۶۶۸,۵۰۷,۹۵۰	۱۰,۲۷۷	۵,۴۷۵,۵۳۲	۱۵۳,۱۰۳,۳۲۲,۲۳۲	(۱۵,۱۶۵,۸۶۹)	۱۹۱,۳۳۹,۳۱۳,۳۵۲	۱۸,۹۵۸,۶۳۹	۱۷,۵۷۴,۹۳۳,۱۲۱	۱۷,۴۸۷,۴۲۰,۶۰۸	۱,۶۸۲,۷۶۲	صندوق س. دارا الگوریتم-د
۱۷.۵۹٪	۴۸,۹۳۴,۲۹۲,۴۴۹	۴۰,۱۰۴,۷۵۹,۱۳۲	۵۱,۸۲۶	۹۴۷,۹۸۶	۴۸,۱۹۱,۸۵۰,۷۴۰	(۱,۱۰۹,۱۹۵)	۴۹,۲۱۱,۷۶۵,۴۸۸	۱,۵۹۷,۹۸۶	۳۲,۹۶۸,۵۴۰,۹۳۷	۲۴,۴۴۹,۵۹۱,۰۱۳	۴۵۹,۱۹۵	ویتانا
۸۱.۶۹٪	۲۲۶,۶۲۱,۹۶۳,۹۰۴	۱۷۹,۴۳۶,۳۲۶,۷۱۹		۸,۷۸۶,۳۷۲	۲۵۵,۲۶۹,۶۵۰,۵۸۶	(۱۷,۴۵۶,۶۸۳)	۳۰۰,۹۲۵,۱۴۴,۷۴۳	۲۱,۸۶۸,۶۲۵	۱۴۵,۰۷۱,۵۵۹,۱۴۷	۱۰۵,۱۳۲,۸۹۵,۱۷۹	۴,۳۷۴,۴۳۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																		
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فراپورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سر رسید	نرخ سود	نرخ موثر	۱۳۹۹/۰۲/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۳/۳۱				
							تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	
										تعداد	مبلغ فروش							
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	بله	بله	۱۳۹۵/۰۳/۰۹	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۲۱	۲۱	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۲,۰۳۳,۷۷۵	۰	۰	۴,۷۵۰	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	درصد به کل
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۶,۴۶۰,۳۲۳,۸۶۷	۶,۴۶۰,۳۲۳,۸۶۷	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱,۰۲۰,۰۰۰	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۶,۵۲۴,۲۸۶,۴۶۱	۲,۳۴٪
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۹,۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۹,۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱,۰۵۱,۰۷۳	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۱,۰۵۰,۳۱۰,۹۷۲	۰,۳۸٪
جمع					۱۲,۱۵۱	۱۲,۱۹۶,۶۴۳,۵۱۶	۱۱,۸۲۲,۳۱۷,۴۸۷	۱۲,۱۹۶,۶۴۳,۵۱۶	۰	۰	۴,۷۵۰	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۴۰۱	۷,۰۷۲,۳۱۷,۴۸۷	۷,۵۷۴,۵۹۷,۴۳۳	۲,۷۳٪		

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۲/۳۱		مشخصات حساب بانکی			سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰.۹۱٪	۲,۵۴۴,۶۰۱,۲۶۸	۱۷,۸۵۷,۰۱۷,۹۴۱	۸,۴۱۳,۳۶۹,۱۶۱	۱۱,۹۸۸,۲۵۰,۰۴۸	ماه شمار۸٪	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۰.۶۸٪	۱,۸۹۷,۲۴۲,۴۵۵	۱۵,۶۷۵,۸۶۸,۳۹۶	۶,۰۳۸,۷۱۶,۴۱۰	۱۱,۵۳۴,۳۹۴,۴۴۱	ماه شمار۸٪	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۸.۶۸٪	۲۴,۱۶۳,۷۴۴,۲۵۳	۲,۷۶۴,۰۲۸,۹۹۳	۴,۹۶۳,۴۴۰,۲۹۷	۳۱,۹۶۴,۳۳۲,۹۴۹	ماه شمار۸٪	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۴.۹۸٪	۱۳,۸۶۳,۵۴۲,۹۳۷	۵۰,۱۳۳,۳۶۴,۲۷۴	۵۳,۵۵۶,۱۲۰,۹۱۲	۱۰,۴۴۰,۷۸۶,۲۹۹	ماه شمار۸٪	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۱۵.۲۶٪	۴۲,۴۶۹,۱۳۰,۹۱۳	۸۶,۴۳۰,۲۷۹,۶۰۴	۷۲,۹۷۱,۶۴۶,۷۸۰	۵۵,۹۲۷,۷۶۳,۷۳۷					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

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
۱۱۲,۳۳۹,۹۱۵	-	۱۱۲,۳۳۹,۹۱۵	۱۶,۰۱۱,۳۲۹	-	۱۶,۰۱۱,۳۲۹	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۷۸۲,۵۵۱,۳۷۰	-	۷۸۲,۵۵۱,۳۷۰	۱۰۲,۴۸۸,۵۲۰	-	۱۰۲,۴۸۸,۵۲۰	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۹۸۰,۰۰۳,۳۳۹	-	۹۸۰,۰۰۳,۳۳۹	۴۶,۵۷۶,۸۷۲	-	۴۶,۵۷۶,۸۷۲	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۳۲,۱۶۶,۲۹۵	-	۲۳۲,۱۶۶,۲۹۵	۸,۳۱۲,۸۸۶	-	۸,۳۱۲,۸۸۶	ماه شمار ۸٪	۰	۱۹	بانک سامان سی تیر
۴۱۶,۱۷۲,۷۷۰	-	۴۱۶,۱۷۲,۷۷۰	۶۴,۳۰۷,۲۶۹	-	۶۴,۳۰۷,۲۶۹	ماه شمار ۸٪	۰	۱۴	بانک سامان سی تیر
۱۷۹,۵۲۱,۵۵۴	-	۱۷۹,۵۲۱,۵۵۴	۵۸,۰۰۸,۴۵۵	-	۵۸,۰۰۸,۴۵۵	ماه شمار ۸٪	۰	۱۴	بانک سامان سی تیر
۴۴,۸۳۸,۵۰۶	-	۴۴,۸۳۸,۵۰۶	۶,۷۹۵	-	۶,۷۹۵	ماه شمار ۸٪	۰	۱۷	بانک سامان سی تیر
۲,۷۴۷,۴۹۳,۶۴۹	۰	۲,۷۴۷,۴۹۳,۶۴۹	۲۹۵,۷۱۲,۱۲۶	۰	۲۹۵,۷۱۲,۱۲۶				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

توضیحات	یادداشت	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام	۱-۲	۱۱۹,۴۱۴,۰۰۱,۳۶۰	۹۶.۵۵٪	۴۷.۷۶٪
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۲,۴۴۷,۰۹۲,۱۵۷	۱.۹۸٪	۰.۹۸٪
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۸۷۲,۶۹۹,۱۲۵	۰.۷۱٪	۰.۳۵٪
سایر درآمدها	۴-۲	۹۴۶,۵۳۳,۸۱۹	۰.۷۷٪	۰.۳۸٪
جمع		۱۲۳,۶۸۰,۳۲۶,۴۶۱	۱۰۰٪	۴۹.۴۶٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

مد 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	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام
ویتانا	۱۳۹۸/۱۱/۲۶	۹۵۴,۰۳۷	۵۵۰	-	-	-	۵۲۴,۷۲۰,۳۵۰	(۳۹,۵۴۵,۱۰۶)	۴۸۵,۱۷۵,۲۴۴
سود صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم	-	-	-	۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	-	۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	۲,۷۱۹,۰۴۸,۲۹۸	-	۲,۷۱۹,۰۴۸,۲۹۸
				۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	-	۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	۳,۲۴۳,۷۶۸,۶۴۸	(۳۹,۵۴۵,۱۰۶)	۳,۲۰۴,۲۲۳,۵۴۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

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
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۸۷۳,۹۲۰	۳۸,۹۷۵,۵۲۱,۹۹۱	۳۳,۰۳۴,۴۱۵,۷۳۸	۵,۹۴۱,۱۰۶,۲۵۳	۱۲,۱۱۳,۸۲۲	۲۳۲,۶۶۳,۴۹۲,۲۳۹	۲۰۸,۶۲۱,۸۹۴,۷۹۱	۲۴,۰۴۱,۵۹۷,۴۴۸
داروسازی سینا	۳۰۷,۶۹۹	۱۴,۹۹۸,۹۵۵,۶۲۳	۹,۱۴۲,۴۴۲,۰۱۰	۵,۸۵۶,۵۱۳,۶۱۳	۲,۳۹۳,۷۶۵	۶۳,۱۶۶,۸۹۰,۳۲۱	۴۹,۹۶۲,۳۰۳,۳۰۲	۱۳,۲۰۴,۵۸۷,۰۱۹
وینانا	۱,۱۰۹,۱۹۵	۴۸,۱۹۱,۸۵۰,۷۴۰	۳۳,۵۵۶,۵۹۸,۶۹۷	۱۴,۶۳۵,۲۵۲,۰۴۳	۱۰,۴۹۵,۴۹۲	۳۰۵,۱۱۳,۲۲۰,۳۹۲	۲۶۷,۰۸۱,۵۸۴,۳۸۰	۳۸,۰۳۱,۶۳۶,۰۱۲
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۱۵,۱۶۵,۸۶۹	۱۵۳,۱۰۳,۳۲۲,۲۳۲	۱۵۳,۱۵۸,۲۲۶,۰۰۹	(۵۴,۹۰۳,۷۷۷)	۲۴۳,۳۱۹,۲۱۶	۲,۴۹۳,۳۸۹,۵۰۴,۵۳۸	۲,۴۹۹,۶۲۸,۷۳۵,۹۷۸	(۶,۲۳۹,۲۳۱,۴۴۰)
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	۲۶,۰۲۷	۷۰۱,۹۲۶,۵۵۱	۷۱۶,۳۷۴,۹۵۶	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۴,۷۵۰	۴,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۷۰۶,۰۲۳,۱۵۴	۴۳,۹۷۶,۸۴۶	۹,۵۰۰	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۵۹۵,۴۶۴,۹۸۹	(۹۵,۴۶۴,۹۸۹)
اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	۱,۰۰۰	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
اسناد خزانه-م ۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۷۴,۱۶۰,۹۸۵	۹۳۲,۳۹۶,۵۲۲	۴۱,۷۶۴,۴۶۳
اسناد خزانه-م ۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶	-	-	-	-	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۶,۱۶۰,۵۶۳,۱۶۳	۹۶۶,۴۹۱
جمع	۱۷,۴۶۱,۴۳۲	۲۶۰,۰۱۹,۶۵۰,۵۸۶	۲۳۳,۵۹۷,۷۰۵,۶۰۸	۲۶,۴۲۱,۹۴۴,۹۷۸	۲۶۸,۳۷۷,۷۲۲	۳,۱۲۰,۵۷۰,۷۲۴,۶۸۰	۳,۰۵۱,۴۷۶,۵۶۶,۳۵۸	۶۹,۰۹۴,۱۵۸,۳۲۲

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم پورقه 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 ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

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	۹۴۷,۹۸۶	۴۸,۹۳۴,۲۹۲,۴۴۹	۴۸,۶۲۳,۷۰۷,۷۲۷	۳۱۰,۵۸۴,۷۲۲	۹۴۷,۹۸۶	۴۸,۹۳۴,۲۹۲,۴۴۹	۴۰,۱۰۴,۷۵۹,۶۰۲	۸,۸۲۹,۵۳۲,۸۴۷
داروسازی سینا	۱,۴۳۷,۹۸۰	۷۸,۹۳۰,۸۸۱,۹۵۹	۷۰,۱۲۵,۸۵۲,۷۸۱	۸,۸۰۵,۰۲۹,۱۷۸	۱,۴۳۷,۹۸۰	۷۸,۹۳۰,۸۸۱,۹۵۹	۴۵,۸۰۵,۵۱۷,۸۲۹	۳۳,۱۲۵,۳۶۴,۱۳۰
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۵,۴۷۵,۵۳۲	۵۶,۲۶۷,۱۸۸,۹۰۰	۵۵,۷۵۶,۰۲۰,۴۶۳	۵۱۱,۱۶۸,۴۳۷	۵,۴۷۵,۵۳۲	۵۶,۲۶۷,۱۸۸,۹۰۰	۵۵,۶۶۸,۵۰۷,۹۵۰	۵۹۸,۶۸۰,۹۵۰
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۲۴,۸۷۴	۴۲,۴۸۹,۶۰۰,۵۹۵	۴۲,۵۹۹,۴۴۰,۴۶۳	(۱۰۹,۸۳۹,۸۶۷)	۹۲۴,۸۷۴	۴۲,۴۸۹,۶۰۰,۵۹۵	۳۷,۸۵۷,۵۴۱,۳۳۸	۴,۶۳۲,۰۵۹,۲۵۷
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱,۰۰۰	۱,۰۵۰,۳۱۰,۹۷۲	۹۸۴,۲۸۶,۸۷۴	۶۶,۰۲۴,۰۹۸	۱,۰۰۰	۱,۰۵۰,۳۱۰,۹۷۲	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۱۱۹,۶۳۶,۷۲۲
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۶,۴۰۱	۶,۵۲۴,۲۸۶,۴۶۰	۶,۴۶۰,۳۲۲,۸۶۷	۶۳,۹۶۳,۵۹۳	۶,۴۰۱	۶,۵۲۴,۲۸۶,۴۶۰	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۳۸۲,۶۴۳,۲۲۳
جمع	۸,۷۹۳,۷۷۳	۲۳۴,۱۹۶,۵۶۱,۳۳۵	۲۲۴,۵۴۹,۶۳۱,۱۷۵	۹,۶۴۶,۹۳۰,۱۶۱	۸,۷۹۳,۷۷۳	۲۳۴,۱۹۶,۵۶۱,۳۳۵	۱۸۶,۵۰۸,۶۴۴,۲۰۶	۴۷,۶۸۷,۹۱۷,۱۲۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۱-۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ
داروسازی سینا	-	۸,۸۰۵,۰۲۹,۱۷۸	۵,۸۵۶,۵۱۳,۶۱۳	۱۴,۶۶۱,۵۴۲,۷۹۱	-	۳۳,۱۲۵,۳۶۴,۱۳۰	۱۳,۲۰۴,۵۸۷,۰۱۹	۴۶,۳۲۹,۹۵۱,۱۴۹
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	-	(۱۰۹,۸۳۹,۸۶۷)	۵,۹۴۱,۱۰۶,۲۵۳	۵,۸۳۱,۲۶۶,۳۸۶	-	۴,۶۳۲,۰۵۹,۲۵۷	۲۴,۰۴۱,۵۹۷,۴۴۸	۲۸,۶۷۳,۶۵۶,۷۰۵
ویتانا	-	۳۱۰,۵۸۴,۷۲۲	۱۴,۶۳۵,۲۵۲,۰۴۳	۱۴,۹۴۵,۸۳۶,۷۶۵	۴۸۵,۱۷۵,۲۴۴	۸,۸۲۹,۵۳۲,۸۴۷	۳۸,۰۳۱,۶۳۶,۰۱۲	۴۷,۳۴۶,۳۴۴,۱۰۳
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	۵۱۱,۱۶۸,۴۳۷	(۵۴,۹۰۳,۷۷۷)	۱,۱۰۵,۸۱۰,۷۹۲	۲,۷۱۹,۰۴۸,۲۹۸	۵۹۸,۶۸۰,۹۵۰	(۶,۲۳۹,۲۳۱,۴۴۰)	(۲,۹۲۱,۵۰۲,۱۹۲)
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	-	-	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)
جمع	۶۴۹,۵۴۶,۱۳۲	۹,۵۱۶,۹۴۲,۴۷۰	۲۶,۳۷۷,۹۶۸,۱۳۲	۳۶,۵۴۴,۴۵۶,۷۳۴	۳,۲۰۴,۲۲۳,۵۴۲	۴۷,۱۸۵,۶۳۷,۱۸۴	۶۹,۰۲۴,۱۴۰,۶۳۴	۱۱۹,۴۱۴,۰۰۱,۳۶۰

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 ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

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	
۸۸۴,۵۳۸,۳۵۰	(۹۵,۴۶۴,۹۸۹)	-	۹۸۰,۰۰۳,۳۳۹	۹۰,۵۵۳,۷۱۸	۴۳,۹۷۶,۸۴۶	-	۴۶,۵۷۶,۸۷۲	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۳۱,۸۷۶,۶۳۷	-	۱۱۹,۶۳۶,۷۲۲	۱۱۲,۲۳۹,۹۱۵	۸۲,۰۳۵,۴۲۷	-	۶۶,۰۲۴,۰۹۸	۱۶,۰۱۱,۳۲۹	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱,۱۶۵,۱۹۴,۴۹۳	-	۳۸۲,۶۴۳,۲۲۳	۷۸۲,۵۵۱,۲۷۰	۱۶۶,۴۵۲,۱۱۳	-	۶۳,۹۶۳,۵۹۳	۱۰۲,۴۸۸,۵۲۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۹۶۶,۴۹۱	۹۶۶,۴۹۱	-	-	-	-	-	-	اسناد خزانه-م-۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶
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
۴۱,۷۶۴,۴۶۳	۴۱,۷۶۴,۴۶۳	-	-	-	-	-	-	اسناد خزانه-م-۱۲ بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴
۲,۴۴۷,۰۹۲,۱۵۷	۷۰,۰۱۷,۶۸۸	۵۰۲,۲۷۹,۹۴۵	۱,۸۷۴,۷۹۴,۵۲۴	۳۳۹,۰۴۱,۲۵۸	۴۳,۹۷۶,۸۴۶	۱۲۹,۹۸۷,۶۹۱	۱۶۵,۰۷۶,۷۲۱	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۲-۳-درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری 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	۸,۳۱۲,۸۸۶	۶.۳۶٪	۲۳۲,۱۶۶,۲۹۵	۲۶.۶۰٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۶۴,۳۰۷,۲۶۹	۴۹.۲۳٪	۴۱۶,۱۷۲,۷۷۰	۴۷.۶۹٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۵۸,۰۰۸,۴۵۵	۴۴.۴۰٪	۱۷۹,۵۲۱,۵۵۴	۲۰.۵۷٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۶,۷۹۵	۰.۰۱٪	۴۴,۸۳۸,۵۰۶	۵.۱۴٪
جمع		۱۳۰,۶۳۵,۴۰۵	۱۰۰٪	۸۷۲,۶۹۹,۱۲۵	۱۰۰٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۰۳/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۱۳۶,۰۸۹,۵۱۰	۴,۹۳۲	سایر درآمدها
۸۱۰,۴۴۴,۳۰۹	۱۵۵,۶۹۹,۷۸۹	درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی
۹۴۶,۵۳۳,۸۱۹	۱۵۵,۷۰۴,۷۲۱	جمع