



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی ماهانه

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۴/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۵/۳۱		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش			
داروسازی سینا	۱,۵۱۹,۹۴۲	۵۱,۳۸۵,۹۷۱,۰۲۱	۶۷,۷۴۶,۰۱۵,۰۵۶	۳۴۷,۱۸۰	۱۴,۱۳۰,۳۰۹,۲۰۸	(۵۷۸,۸۶۱)	۲۳,۴۷۳,۸۴۳,۰۲۴	۱,۲۸۸,۲۶۱	۳۸,۱۹۰	۴۹,۰۴۱,۶۴۵,۳۷۹
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۶۹۱,۵۰۰	۳۰,۰۷۵,۸۳۵,۸۷۸	۲۸,۶۱۰,۳۹۷,۶۰۹	۱,۶۱۱,۹۸۱	۷۳,۴۹۲,۸۸۳,۷۷۰	(۱,۳۸۰,۷۴۲)	۵۹,۵۰۲,۴۶۰,۳۵۸	۹۲۲,۷۳۹	۴۹,۴۷۵	۴۵,۵۰۶,۷۸۹,۲۰۷
ویتانا	۹۰۰,۹۶۸	۳۹,۹۶۹,۷۹۱,۰۲۰	۴۱,۶۳۰,۹۳۴,۶۰۳	۲,۲۴۱,۸۴۱	۱۲۴,۹۲۶,۳۸۸,۲۰۲	(۲,۳۹۸,۰۵۶)	۱۲۵,۸۴۶,۲۵۹,۴۳۰	۷۴۴,۷۵۳	۶۵,۲۱۶	۴۸,۴۱۴,۷۷۶,۸۰۹
صندوق س. دارا الگوریتم	۸۸۰,۶۰۷	۹,۱۴۲,۲۱۰,۷۷۵	۹,۱۴۱,۶۷۳,۳۳۷	۱۲۶,۳۳۹,۶۹۸	۱,۲۶۷,۳۹۶,۴۳۹,۸۹۰	(۱۲۳,۸۰۷,۳۲۸)	۱,۲۴۳,۸۷۸,۵۸۳,۴۱۶	۳,۴۱۲,۹۷۷	۱۰,۱۸۰	۳۴,۷۴۱,۲۳۹,۴۷۱
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۰	۰	۰	۶,۸۶۴,۴۲۲	۷۹,۷۹۲,۷۵۹,۶۲۸	(۲,۸۴۵,۳۲۸)	۳۴,۶۷۰,۸۴۳,۴۴۰	۴,۰۱۹,۰۹۴	۱۰,۳۱۰	۴۱,۳۹۵,۵۲۵,۸۷۳
جمع	۳,۹۹۳,۰۱۷	۱۳۰,۵۷۳,۸۰۸,۶۹۴	۱۴۷,۱۲۸,۹۲۰,۶۰۵	۱۳۷,۴۰۵,۱۲۲	۱,۵۵۹,۷۳۸,۶۸۰,۶۹۸	(۱۳۱,۰۱۰,۳۱۵)	۱,۴۸۷,۳۷۱,۹۸۹,۶۶۸	۱۰,۳۸۷,۸۲۴	۱۷۳,۳۷۱	۲۱۹,۰۹۹,۹۷۶,۷۳۹

درصد به کل دارایی‌های صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																		۱۳۹۹/۰۴/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۵/۳۱			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فراپورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سر رسید	نرخ سود	نرخ موثر	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	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															
۱۴۰۰۱۲۲۲ منفعت صبا ارونند سپهر	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۶,۴۰۱	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۶,۶۴۸,۱۵۶,۳۶۴	۰	۰	۰	۰	۶,۴۰۱	۹۷۳,۰۰۲	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۶,۷۵۷,۲۹۴,۰۰۸	۰.۰۲										
۱۴۰۰۱۲۲۲ منفعت صبا ارونند لوتوس	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۱,۰۰۰	۹۳۰,۶۷۴,۳۵۰	۱,۰۶۱,۵۹۵,۴۷۳	۰	۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۱,۰۳۰,۰۰۰	۹۳۰,۶۷۴,۳۵۰	۱,۱۱۲,۶۱۸,۹۱۷	۰.۰۰										
جمع							۷,۴۰۱	۷,۰۷۲,۳۱۷,۴۸۷	۷,۷۰۹,۷۵۱,۸۳۷	۰	۰	۰	۰	۷,۴۰۱	-	۷,۰۷۲,۳۱۷,۴۸۷	۷,۸۶۹,۹۱۲,۹۲۵	۰.۰۳										

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۵/۳۱	
	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 شمار۸٪	۱۰,۵۰۳,۳۹۷	۱۴,۴۸۷,۶۱۲,۲۷۸	۷,۵۳۷,۰۷۹,۸۴۲	۶,۹۶۱,۰۳۵,۸۳۳
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار۸٪	۲۴,۵۵۱,۲۷۹,۸۰۳	۳۰,۱۰۱,۱۱۰,۴۳۶	۳۶,۶۰۴,۱۰۳,۳۴۸	۱۸,۰۴۸,۲۸۶,۸۹۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار۸٪	۳۶,۰۰۱,۴۳۱,۲۶۸	۴۹,۴۶۵,۵۷۳,۹۰۰	۶۱,۴۲۳,۳۷۳,۱۰۱	۲۴,۰۴۳,۶۳۲,۰۶۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ماه شمار۸٪	۱۳,۳۳۱,۳۹۰,۷۵۹	۹۲۹,۶۸۶,۲۵۷,۸۹۹	۹۴۳,۰۱۶,۶۴۰,۲۷۵	۱,۰۰۸,۳۸۳
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۴/۳۱	ماه شمار۸٪	۵۰۳,۳۹۷	۵۷,۱۷۳,۱۲۳,۹۹۱	۵۱,۳۳۱,۰۰۳,۴۹۹	۵,۸۴۲,۶۲۳,۸۸۹
جمع					۷۳,۸۹۵,۱۰۸,۶۲۴	۱,۰۸۰,۹۱۳,۶۷۸,۵۰۴	۱,۰۹۹,۹۱۲,۲۰۰,۰۶۵	۵۴,۸۹۶,۵۸۷,۰۶۳

۱۳۹۹/۰۵/۳۱

درصد به کل
دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

مشخصات			طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
توضیحات	روز دریافت سود	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	۱۷,۰۵۰,۰۹۳	۰	۱۷,۰۵۰,۰۹۳	۱۴۵,۸۲۰,۷۲۰	۰
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۰۹,۱۳۷,۶۴۴	۰	۱۰۹,۱۳۷,۶۴۴	۹۹۷,۵۰۱,۹۹۵	۰
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	۰	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۲۱	۰	۰	۰	۹۸۴,۳۸۵,۷۵۳	۰
بانک سامان سی تیر	۱۹م	۰	۸	۷۸,۳۵۶	۰	۷۸,۳۵۶	۲۳۲,۵۳۱,۴۳۲	۰
بانک سامان سی تیر	۱۴م	۰	۸	۹۶,۴۴۲,۵۶۹	۰	۹۶,۴۴۲,۵۶۹	۵۲۵,۴۷۶,۳۹۹	۰
بانک سامان سی تیر	۱۴م	۰	۸	۹۵,۹۴۸,۱۵۱	۰	۹۵,۹۴۸,۱۵۱	۳۲۴,۹۸۴,۲۶۸	۰
بانک سامان سی تیر	۱۷م	۰	۸	۸,۳۸۳	۰	۸,۳۸۳	۴۴,۸۵۴,۷۵۷	۰
بانک سامان سی تیر	۲۹م	۰	۸	۴,۱۹۲	۰	۴,۱۹۲	۴,۱۹۲	۰
جمع				۳۱۸,۶۶۹,۳۸۸	۰	۳۱۸,۶۶۹,۳۸۸	۳,۲۵۵,۵۵۹,۵۱۶	۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	۹۷,۵۷۲,۱۴۸,۵۱۵	۰.۹۰	۰.۳۴
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۲,۳۷۸,۳۳۲,۲۸۶	۰.۰۲	۰.۰۱
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۱,۱۲۷,۸۵۱,۰۴۸	۰.۰۱	۰.۰۰
سایر درآمدها	۴-۲	۷,۵۲۱,۸۹۲,۳۴۱	۰.۰۷	۰.۰۳
جمع		۱۰۸,۶۰۰,۲۲۴,۱۹۰	۱۰۰٪	۰.۳۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل
داروسازی سینا	۱۳۹۹/۰۴/۱۵	۱,۴۹۵,۸۹۱	۶۲۵	۰	۰	۰	۹۳۴,۹۳۱,۸۷۵	۱۱۰,۶۵۶,۱۸۸
ویتانا	۱۳۹۸/۱۱/۲۶	۹۵۴,۰۳۷	۵۵۰	۰	۰	۰	۵۲۴,۷۲۰,۳۵۰	۱۹,۷۱۵,۹۲۶
سود صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم	-	-	-	۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	۰	۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	۴,۵۶۰,۱۸۳,۶۱۴	۰
				۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	-	۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	۶,۰۱۹,۸۳۵,۸۳۹	۱۳۰,۳۷۲,۱۱۴
							۵,۸۸۹,۴۶۳,۷۲۵	۱۲۴,۳۷۲,۱۱۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	۱,۳۸۰,۷۴۲	۵۹,۵۰۲,۴۶۰,۳۵۸	۵۸,۸۰۴,۶۹۹,۷۷۹	۶۹۷,۷۶۰,۵۷۹	۱۴,۴۹۸,۴۴۲	۳۳۸,۴۶۱,۲۶۸,۳۷۱	۳۱۰,۳۷۹,۶۷۸,۶۳۶	۲۸,۰۸۱,۵۸۹,۷۴۵
داروسازی سینا	۵۷۸,۸۶۱	۲۳,۴۷۳,۸۴۳,۰۲۴	۲۰,۴۴۰,۹۵۳,۲۹۳	۳,۰۳۲,۸۸۹,۷۳۱	۳,۱۸۸,۵۷۵	۹۶,۸۷۶,۴۶۱,۵۹۵	۷۷,۷۶۹,۹۹۷,۲۲۵	۱۹,۱۰۶,۴۶۴,۳۷۰
ویتانا	۲,۳۹۸,۰۵۶	۱۲۵,۸۴۶,۲۵۹,۴۳۰	۱۱۸,۴۰۷,۷۳۳,۴۵۷	۷,۴۳۸,۵۲۵,۹۷۳	۱۴,۶۹۰,۲۵۳	۵۱۲,۹۱۴,۹۵۸,۴۷۱	۴۶۵,۱۲۰,۴۳۰,۶۴۹	۴۷,۷۹۴,۵۲۷,۸۲۲
صندوق س. دارا الگوریتم	۱۲۳,۸۰۷,۳۲۸	۱,۲۴۳,۸۷۸,۵۸۳,۴۱۶	۱,۲۴۲,۰۱۹,۴۸۰,۰۲۳	۱,۸۵۹,۱۰۳,۳۹۳	۵۰۶,۴۷۸,۷۲۸	۵,۱۸۰,۷۵۸,۹۹۴,۶۲۷	۵,۱۸۵,۶۰۰,۸۰۳,۴۴۸	(۴,۸۴۱,۸۰۸,۸۲۱)
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۲,۸۴۵,۳۲۸	۳۴,۶۸۵,۵۰۵,۵۰۴	۳۳,۵۵۷,۶۳۰,۲۸۲	۱,۱۲۷,۸۷۵,۲۲۲	۲,۸۴۵,۳۲۸	۳۴,۶۸۵,۵۰۵,۵۰۴	۳۳,۵۵۷,۶۳۰,۲۸۲	۱,۱۲۷,۸۷۵,۲۲۲
سنگ آهن گهرزمین	-	-	-	-	۲۶,۰۲۷	۷۰۱,۹۲۶,۵۵۱	۷۱۶,۳۷۴,۹۵۶	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)
اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳	-	-	-	-	۹,۵۰۰	۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۵۹۵,۴۶۴,۹۸۹	(۹۵,۴۶۴,۹۸۹)
اسناد خزانه-م ۴بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۴,۴۲۳,۰۳۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰
اسناد خزانه-م ۶بودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲	-	-	-	-	۷,۹۰۰	۷,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۸۰۲,۸۲۵,۲۴۷	۹۷,۱۷۴,۷۵۳
اسناد خزانه-م ۱۲بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۷۴,۱۶۰,۹۸۵	۹۳۲,۳۹۶,۵۲۲	۴۱,۷۶۴,۴۶۳
اسناد خزانه-م ۲۰بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶	-	-	-	-	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۶,۱۶۰,۵۶۳,۱۶۳	۹۶۶,۴۹۱
جمع	۱۳۱,۰۱۰,۳۱۵	۱,۴۸۷,۳۸۶,۶۵۱,۷۳۲	۱,۴۷۳,۲۳۰,۴۹۶,۸۳۴	۱۴,۱۵۶,۱۵۴,۸۹۸	۵۴۱,۷۵۶,۷۵۳	۶,۱۸۹,۹۳۴,۸۰۵,۷۵۸	۶,۰۹۸,۶۱۰,۵۸۸,۱۳۷	۹۱,۳۲۴,۲۱۷,۶۲۱

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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۲۲,۷۳۹	۴۵,۵۰۶,۷۸۹,۲۰۷	۴۳,۲۹۸,۴۸۱,۶۰۰	۲,۲۰۸,۳۰۷,۶۰۷	۹۲۲,۷۳۹	۴۵,۵۰۶,۷۸۹,۲۰۶	۴۴,۷۶۴,۰۲۱,۸۳۴	۷۴۲,۷۶۷,۳۷۲
داروسازی سینا	۱,۲۸۸,۲۶۱	۴۹,۰۴۱,۶۴۵,۳۷۹	۶۱,۴۳۵,۲۷۰,۹۷۱	(۱۲,۳۹۳,۶۲۵,۵۹۲)	۱,۲۸۸,۲۶۱	۴۹,۰۴۱,۶۴۵,۳۷۹	۴۶,۶۶۴,۷۲۴,۲۳۵	۲,۳۷۶,۹۲۱,۱۴۴
ویتانا	۷۴۴,۷۵۳	۴۸,۴۱۴,۷۷۶,۸۰۹	۴۸,۱۴۹,۵۸۹,۳۴۸	۲۶۵,۱۸۷,۴۶۱	۷۴۴,۷۵۳	۴۸,۴۱۴,۷۷۶,۸۰۹	۴۶,۴۸۸,۴۴۵,۸۲۴	۱,۹۲۶,۳۳۰,۹۸۵
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۳,۴۱۲,۹۷۷	۳۴,۷۴۱,۲۳۹,۴۷۱	۳۴,۵۱۸,۶۳۳,۲۰۳	۲۲۲,۶۰۶,۲۶۸	۳,۴۱۲,۹۷۷	۳۴,۷۴۱,۲۳۹,۴۷۲	۳۴,۵۱۹,۱۷۰,۶۴۳	۲۲۲,۰۶۸,۸۲۹
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۴,۰۱۹,۰۹۴	۴۱,۳۹۵,۵۲۵,۸۷۳	۴۶,۲۳۵,۱۲۹,۳۴۶	(۴,۸۳۹,۶۰۳,۴۷۳)	۴,۰۱۹,۰۹۴	۴۱,۳۹۵,۵۲۵,۸۷۳	۴۶,۲۳۵,۱۲۹,۳۴۶	(۴,۸۳۹,۶۰۳,۴۷۳)
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱,۰۰۰	۱,۰۲۹,۲۵۳,۲۵۰	۹۹۵,۲۷۹,۸۹۸	۳۳,۹۷۳,۳۵۲	۱,۰۰۰	۱,۰۲۹,۲۵۳,۲۵۰	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۹۸,۵۷۹,۰۰۰
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۰	۰	۰	-	۶,۴۰۱	۶,۲۲۳,۶۷۰,۳۶۷	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۸۲,۰۲۷,۱۳۰
جمع	۱۰,۳۸۸,۸۲۴	۲۲۰,۱۲۹,۲۲۹,۹۸۹	۲۳۴,۶۳۲,۳۸۴,۳۶۶	(۱۴,۵۰۳,۱۵۴,۳۷۷)	۱۰,۳۹۵,۲۲۵	۲۲۶,۳۵۲,۹۰۰,۳۵۶	۲۲۵,۷۴۳,۸۰۹,۳۶۹	۶۰۹,۰۹۰,۹۸۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۱-۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری 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	
۰.۲۱	۲۲,۳۰۷,۶۶۱,۳۰۱	۱۹,۱۰۶,۴۶۴,۳۷۰	۲,۳۷۶,۹۳۱,۱۴۴	۸۲۴,۲۷۵,۶۸۷	(۰.۰۹)	(۹,۳۶۰,۷۳۵,۸۶۱)	۳,۰۳۲,۸۸۹,۷۳۱	(۱۲,۳۹۳,۶۲۵,۵۹۲)	-	داروسازی سینا
۰.۴۶	۵۰,۲۲۵,۸۶۳,۲۳۱	۴۷,۷۹۴,۵۲۷,۸۲۲	۱,۹۲۶,۳۳۰,۹۸۵	۵۰۵,۰۰۴,۴۲۴	۰.۰۷	۷,۷۰۳,۷۱۳,۴۳۴	۷,۴۳۸,۵۲۵,۹۷۳	۲۶۵,۱۸۷,۴۶۱	-	ویتانا
۰.۲۷	۲۸,۸۲۴,۳۵۷,۱۱۷	۲۸,۰۸۱,۵۸۹,۷۴۵	۷۴۲,۷۶۷,۳۷۲	۰	۰.۰۳	۲,۹۰۶,۰۶۸,۱۸۶	۶۹۷,۷۶۰,۵۷۹	۲,۲۰۸,۳۰۷,۶۰۷	-	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۰.۰۳)	(۳,۷۱۱,۷۲۸,۲۵۱)	۱,۱۲۷,۸۷۵,۲۲۲	(۴,۸۳۹,۶۰۳,۴۷۳)	۰	(۰.۰۳)	(۳,۷۱۱,۷۲۸,۲۵۱)	۱,۱۲۷,۸۷۵,۲۲۲	(۴,۸۳۹,۶۰۳,۴۷۳)	-	صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام
(۰.۰۰)	(۵۹,۵۵۶,۳۷۸)	(۴,۸۴۱,۸۰۸,۸۲۱)	۲۲۲,۰۶۸,۸۲۹	۴,۵۶۰,۱۸۳,۶۱۴	۰.۰۲	۲,۳۴۵,۸۹۱,۷۶۱	۱,۸۵۹,۱۰۳,۳۹۳	۲۲۲,۶۰۶,۲۶۸	۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	صندوق س. دارا الگوریتم-د
(۰.۰۰)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	(۱۴,۴۴۸,۴۰۵)	۰	۰	۰.۰۰	-	-	-	-	سنگ آهن گهرزمین
۰.۹۰	۹۷,۵۷۲,۱۴۸,۵۱۵	۹۱,۲۵۴,۱۹۹,۹۳۳	۴۲۸,۴۸۴,۸۵۷	۵,۸۸۹,۴۶۳,۷۲۵	(۰.۰۰۱)	(۱۱۶,۷۹۰,۷۳۱)	۱۴,۱۵۶,۱۵۴,۸۹۸	(۱۴,۵۳۷,۱۲۷,۷۲۹)	۲۶۴,۱۸۲,۱۰۰	جمع

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 ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	
۸۸۸,۹۲۰,۷۶۴	(۹۵,۴۶۴,۹۸۹)	-	۹۸۴,۳۸۵,۷۵۳	-	-	-	-	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۴۴,۳۹۹,۷۲۰	-	۹۸,۵۷۹,۰۰۰	۱۴۵,۸۲۰,۷۲۰	۵۱,۰۲۳,۴۴۵	-	۳۳,۹۷۳,۳۵۲	۱۷,۰۵۰,۰۹۳	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱,۰۷۹,۵۲۹,۱۲۵	-	۸۲,۰۲۷,۱۳۰	۹۹۷,۵۰۱,۹۹۵	۱۰۹,۱۳۷,۶۴۴	-	-	۱۰۹,۱۳۷,۶۴۴	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
۲,۳۷۸,۳۳۲,۲۸۶	۷۰,۰۱۷,۶۸۸	۱۸۰,۶۰۶,۱۳۰	۲,۱۲۷,۷۰۸,۴۶۸	۱۶۰,۱۶۱,۰۸۹	-	۳۳,۹۷۳,۳۵۲	۱۲۶,۱۸۷,۷۳۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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	۷۸,۳۵۶	۰.۰۰	۲۳۲,۵۳۱,۴۳۲	۰.۲۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۹۶,۴۴۲,۵۶۹	۰.۵۰	۵۲۵,۴۷۶,۳۹۹	۰.۴۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۹۵,۹۴۸,۱۵۱	۰.۵۰	۳۲۴,۹۸۴,۲۶۸	۰.۲۹
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۸,۳۸۳	۰.۰۰	۴۴,۸۵۴,۷۵۷	۰.۰۴
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	۴,۱۹۲	۰.۰۰	۴,۱۹۲	۰.۰۰
جمع		۱۹۲,۴۸۱,۶۵۱	۱.۰۰	۱,۱۲۷,۸۵۱,۰۴۸	۱.۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۰۵/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۱۴۹,۳۶۵,۹۲۰	۱۳,۲۷۶,۴۱۰	سایر درآمدها
۷,۳۷۲,۵۲۶,۴۲۱	۶,۳۳۷,۲۳۷,۶۵۵	درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی
۷,۵۲۱,۸۹۲,۳۴۱	۶,۳۵۰,۵۱۴,۰۶۵	جمع