

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۵/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۶/۳۱		
	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	۱,۲۸۸,۲۶۱	۴۵,۶۳۴,۴۸۹,۶۴۴	۴۹,۰۴۱,۶۴۵,۳۷۹	۴۱۰,۰۰۰	۱۳,۹۰۳,۴۹۵,۴۰۰	(۸۵,۰۰۰)	۳,۰۳۵,۱۰۶,۱۱۳	۱,۶۱۳,۲۶۱	۵۶,۵۲۴,۳۴۴,۶۹۱	۵۲,۸۴۲,۵۴۲,۹۳۳
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۲۲,۷۳۹	۴۴,۷۶۴,۰۲۱,۶۷۷	۴۵,۵۰۶,۷۸۹,۲۰۷	۲,۵۷۰,۸۴۶	۱۲۴,۶۳۳,۵۲۲,۵۷۰	(۲,۲۹۶,۶۰۴)	۱۰۴,۲۶۱,۷۴۹,۹۰۳	۱,۱۹۶,۹۸۱	۵۹,۸۵۴,۷۹۷,۱۸۵	۵۶,۲۱۶,۹۳۷,۷۱۰
وینانا	۷۴۴,۷۵۳	۴۶,۴۸۸,۴۴۵,۸۲۳	۴۸,۴۱۴,۷۷۶,۸۰۹	۱,۵۵۵,۷۱۰	۹۵,۸۸۹,۰۰۵,۴۳۳	(۱,۲۶۲,۰۱۷)	۸۰,۰۶۸,۰۶۳,۱۴۲	۱,۰۳۸,۴۴۶	۶۴,۶۵۶,۹۳۴,۴۷۹	۷۳,۴۰۲,۱۹۴,۲۲۲
صندوق س. دارا الگوریتم	۳,۴۱۲,۹۷۷	۳۴,۵۱۹,۱۷۰,۶۴۲	۳۴,۷۴۱,۲۳۹,۴۷۱	۵۴,۶۵۸,۱۳۰	۵۵۱,۸۷۶,۷۱۸,۴۱۸	(۵۲,۸۳۹,۹۱۶)	۵۳۳,۹۶۱,۱۴۰,۵۰۷	۵,۲۳۱,۱۹۱	۵۳,۰۳۷,۲۶۱,۹۶۶	۵۳,۰۲۹,۴۳۹,۰۶۸
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۴,۰۱۹,۰۹۴	۴۶,۲۳۵,۱۲۹,۳۴۶	۴۱,۳۹۵,۵۲۵,۸۷۳	۸,۴۸۵,۵۱۰	۹۵,۹۵۷,۷۷۰,۲۷۳	(۶,۵۰۴,۶۰۴)	۷۴,۶۰۶,۱۴۸,۵۹۸	۶,۰۰۰,۰۰۰	۷۰,۱۶۸,۴۴۷,۳۰۰	۶۶,۴۱۳,۶۸۶,۲۰۰
جمع	۱۰,۳۸۷,۸۲۴	۲۱۷,۶۴۱,۲۵۷,۱۳۲	۲۱۹,۰۹۹,۹۷۶,۷۳۹	۶۷,۶۸۰,۱۹۶	۸۸۲,۲۶۰,۵۱۲,۰۹۴	۶۲,۹۸۸,۱۴۱-	۷۹۵,۹۳۲,۲۰۸,۲۶۳	۱۵,۰۷۹,۸۷۹	۳۰۴,۲۴۱,۷۸۵,۶۲۱	۳۰۱,۹۰۴,۸۰۰,۱۳۴

درصد به کل
دارایی‌های
صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورنقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۵/۳۱				۱۳۹۹/۰۶/۳۱			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	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								
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۶,۴۰۱	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۶,۷۵۷,۲۹۴,۰۰۸	۰	۰	۰	۰	۶,۴۰۱	۹۷۵,۰۱۲	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۶,۲۶۳,۷۹۳,۰۲۸	۱/۸۸			
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	بله	بله	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۱۹	۱,۰۰۰	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۱,۱۱۲,۶۱۸,۹۱۷	۰	۰	۰	۰	۱,۰۰۰	۱,۰۰۵,۸۸۳	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۱,۰۰۹,۴۱۳,۳۷۷	۰/۳۰			
جمع							۷,۴۰۱	۷,۰۷۲,۳۱۷,۴۸۷	۷,۸۶۹,۹۱۲,۹۲۵	۰	۰	۰	۰	۷,۴۰۱	-	۷,۰۷۲,۳۱۷,۴۸۷	۷,۲۷۳,۲۰۶,۴۰۵	۲/۱۸			

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۶/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۵/۳۱	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰/۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۲,۵۳۰,۷۳۵,۱۰۸	۵,۵۷۹,۶۹۹,۲۷۵	۶,۹۶۱,۰۳۵,۸۳۳	ماه شمار/۸	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۳/۶۷	۱۲,۲۲۷,۰۴۵,۱۸۵	۳۹,۰۷۷,۱۴۹,۱۳۳	۳۳,۲۵۵,۹۰۷,۴۲۷	۱۸,۰۴۸,۲۸۶,۸۹۱	ماه شمار/۸	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۰/۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۴۳,۰۳۲,۱۷۳,۹۶۲	۱۸,۹۸۹,۵۴۱,۸۹۵	۲۴,۰۴۳,۶۳۲,۰۶۷	ماه شمار/۸	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۰/۰۰	۱۴,۴۹۹,۶۸۷	۴۲۴,۶۳۹,۶۹۵,۷۵۰	۴۲۴,۶۵۳,۱۸۷,۰۵۴	۱,۰۰۸,۳۸۳	ماه شمار/۸	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۰/۰۰	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۴,۷۳۱,۴۵۶,۷۳۰	۲۸,۸۹۸,۸۳۲,۸۴۱	۵,۸۴۲,۲۳۳,۸۸۹	ماه شمار/۸	۱۳۹۹/۰۴/۳۱	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	بانک سامان سی تیر
۳/۶۸	۱۲,۲۶۲,۵۴۴,۸۷۲	۵۵۴,۰۱۱,۲۱۰,۶۸۳	۵۱۱,۳۷۷,۱۶۸,۴۹۲	۵۴,۸۹۶,۵۸۷,۰۶۳					جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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
۱۶۲,۴۹۵,۵۱۷	۰	۱۶۲,۴۹۵,۵۱۷	۱۶,۶۷۴,۷۹۷	۰	۱۶,۶۷۴,۷۹۷	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۱,۱۰۴,۲۳۷,۳۷۴	۰	۱,۱۰۴,۲۳۷,۳۷۴	۱۰۶,۷۳۵,۳۷۹	۰	۱۰۶,۷۳۵,۳۷۹	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۹۸۴,۳۸۵,۷۵۳	۰	۹۸۴,۳۸۵,۷۵۳	۰	۰	۰	۲۱	۱۳۹۹/۰۳/۰۹	۰	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۸۳,۱۸۵,۳۲۷	۰	۲۸۳,۱۸۵,۳۲۷	۵۰,۶۵۳,۸۹۵	۰	۵۰,۶۵۳,۸۹۵	۸	۰	۱۹م	بانک سامان سی تیر
۵۲۵,۴۸۴,۸۹۲	۰	۵۲۵,۴۸۴,۸۹۲	۸,۴۹۳	۰	۸,۴۹۳	۸	۰	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۳۲۴,۹۹۲,۷۶۱	۰	۳۲۴,۹۹۲,۷۶۱	۸,۴۹۳	۰	۸,۴۹۳	۸	۰	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۴۴,۸۶۳,۲۵۰	۰	۴۴,۸۶۳,۲۵۰	۸,۴۹۳	۰	۸,۴۹۳	۸	۰	۱۷م	بانک سامان سی تیر
۱۲,۶۸۵	۰	۱۲,۶۸۵	۸,۴۹۳	۰	۸,۴۹۳	۸	۰	۲۹م	بانک سامان سی تیر
۳,۴۲۹,۶۵۷,۵۵۹	۰	۳,۴۲۹,۶۵۷,۵۵۹	۱۷۴,۰۹۸,۰۴۳	۰	۱۷۴,۰۹۸,۰۴۳				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۹۴,۷۱۹,۲۶۳,۹۸۲	۰/۸۶	۲۸/۴۲
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۲,۴۹۰,۴۹۹,۶۲۸	۰/۰۲	۰/۷۵
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۱,۱۷۸,۵۳۸,۹۱۵	۰/۰۱	۰/۳۵
سایر درآمدها	۴-۲	۱۱,۳۸۸,۱۶۰,۵۲۰	۰/۱۰	۳/۴۲
جمع		۱۰۹,۷۷۶,۴۶۳,۰۴۵	۱۰۰٪	۳۲/۹۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۸۸,۱۵۷,۳۴۸
ویتانا	۱۳۹۸/۱۱/۲۶	۹۵۴,۰۳۷	۵۵۰	۰	۰	۰	۵۲۴,۷۲۰,۳۵۰	۹,۱۸۰,۸۴۱
سود صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم	-	-	-	۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	۰	۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	۵,۱۷۱,۱۰۶,۴۹۷	۰
				۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	-	۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	۶,۶۳۰,۷۵۸,۷۲۲	۹۷,۳۳۸,۱۸۹
							۸۴۶,۷۷۴,۵۲۷	۵۱۵,۵۳۹,۵۰۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۲,۲۹۶,۶۰۴	۱۰۴,۲۶۱,۷۴۹,۹۰۳	۱۰۹,۵۴۲,۷۴۷,۲۱۹	(۵,۲۸۰,۹۹۷,۳۱۶)	۱۶,۷۹۵,۰۴۶	۴۴۲,۷۲۲,۹۵۷,۹۴۲	۴۱۹,۹۲۲,۴۲۵,۸۴۵	۲۲,۸۰۰,۵۳۲,۰۹۷
داروسازی سینا	۸۵,۰۰۰	۳,۰۳۵,۱۰۶,۱۱۳	۳,۰۷۸,۲۷۷,۳۴۸	(۴۳,۱۷۱,۲۳۵)	۳,۲۷۳,۵۷۵	۹۹,۹۱۱,۵۲۸,۱۶۶	۸۰,۸۴۸,۲۷۴,۵۷۳	۱۹,۰۶۳,۲۵۳,۵۹۳
ویتانا	۱,۲۶۲,۰۱۷	۸۰,۰۶۸,۰۶۳,۱۴۲	۷۷,۷۲۰,۵۱۶,۷۷۷	۲,۳۴۷,۵۴۶,۳۶۵	۱۵,۹۵۲,۲۷۰	۵۹۳,۰۰۹,۷۶۰,۵۸۱	۵۴۲,۸۴۰,۹۴۷,۴۲۵	۵۰,۱۶۸,۸۱۳,۱۵۶
صندوق س. دارا الگوریتم	۵۲,۸۳۹,۹۱۶	۵۳۳,۹۶۱,۱۴۰,۵۰۷	۵۳۳,۳۵۸,۶۲۷,۰۹۴	۶۰۲,۵۱۳,۴۱۳	۵۵۹,۳۱۸,۶۴۴	۵,۷۱۴,۷۲۰,۱۳۵,۱۳۳	۵,۷۱۸,۹۵۹,۴۳۰,۵۴۳	(۴,۲۳۹,۲۹۵,۴۱۰)
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۶,۵۰۴,۶۰۴	۷۴,۶۰۶,۱۴۸,۵۹۸	۷۲,۰۲۴,۴۵۲,۳۱۹	۲,۵۸۱,۶۹۶,۲۷۹	۹,۳۴۹,۹۳۲	۱۰۹,۲۹۱,۶۵۴,۱۰۲	۱۰۵,۵۸۲,۰۸۲,۶۰۱	۳,۷۰۹,۵۷۱,۵۰۱
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)
اسنادخزانه-م۴بودجه۹۶-۹۸۰۸۲۰	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۷۴,۴۲۳,۰۳۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰
اسنادخزانه-م۶بودجه۹۶-۹۸۰۷۲۲	-	-	-	-	۷,۹۰۰	۷,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۷,۸۰۲,۸۲۵,۲۴۷	۹۷,۱۷۴,۷۵۳
اسنادخزانه-م۱۲بودجه۹۶-۹۸۱۱۱۴	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۷۴,۱۶۰,۹۸۵	۹۳۲,۳۹۶,۵۲۲	۴۱,۷۶۴,۴۶۳
اسنادخزانه-م۲۰بودجه۹۸-۲۰۸۰۶	-	-	-	-	۱۰,۰۰۰	۶,۱۶۱,۵۲۹,۶۵۴	۶,۱۶۰,۵۶۳,۱۶۳	۹۶۶,۴۹۱
جمع	۶۲,۹۸۸,۱۴۱	۷۹۵,۹۳۲,۲۰۸,۲۶۳	۷۹۵,۷۲۴,۶۲۰,۷۵۷	۲۰۷,۵۸۷,۵۰۶	۶۰۴,۷۴۴,۸۹۴	۶,۹۸۵,۸۹۳,۶۵۳,۱۱۴	۶,۸۹۴,۳۳۵,۲۰۸,۸۹۴	۹۱,۵۵۸,۴۴۴,۲۲۰

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 (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۱,۱۹۶,۹۸۱	۵۶,۲۱۶,۹۳۷,۷۰۹	۶۰,۵۹۷,۵۶۴,۵۵۷	(۴,۳۸۰,۶۲۶,۸۴۷)	۱,۱۹۶,۹۸۱	۵۶,۲۱۶,۹۳۷,۷۰۹	۵۹,۸۵۴,۷۹۷,۱۸۵	(۳,۶۳۷,۸۵۹,۴۷۵)
داروسازی سینا	۱,۶۱۳,۲۶۱	۵۲,۸۴۲,۵۴۲,۹۳۳	۵۹,۸۶۶,۸۶۳,۴۳۱	(۷,۰۲۴,۳۲۰,۴۹۷)	۱,۶۱۳,۲۶۱	۵۲,۸۴۲,۵۴۲,۹۳۳	۵۷,۴۸۹,۹۴۲,۲۸۷	(۴,۶۴۷,۳۹۹,۳۵۳)
ویتانا	۱,۰۳۸,۴۴۶	۷۳,۴۰۲,۱۹۴,۲۲۲	۶۶,۵۸۳,۲۶۵,۴۶۵	۶,۸۱۸,۹۲۸,۷۵۷	۱,۰۳۸,۴۴۶	۷۳,۴۰۲,۱۹۴,۲۲۲	۶۴,۶۵۶,۹۳۴,۴۸۰	۸,۷۴۵,۲۵۹,۷۴۲
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۵,۲۳۱,۱۹۱	۵۳,۰۲۹,۴۳۹,۰۶۸	۵۳,۲۵۹,۳۳۰,۷۹۵	(۲۲۹,۸۹۱,۷۲۶)	۵,۲۳۱,۱۹۱	۵۳,۰۲۹,۴۳۹,۰۶۸	۵۳,۰۳۷,۲۶۱,۹۶۶	(۷,۸۲۲,۸۹۷)
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۶,۰۰۰,۰۰۰	۶۶,۴۱۳,۶۸۶,۲۰۰	۶۵,۳۲۸,۸۴۳,۸۲۷	۱,۰۸۴,۸۴۲,۳۷۳	۶,۰۰۰,۰۰۰	۶۶,۴۱۳,۶۸۶,۲۰۰	۷۰,۱۶۸,۴۴۷,۳۰۰	(۳,۷۵۴,۷۶۱,۱۰۰)
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	۱,۰۰۰	۱,۰۰۵,۱۵۳,۷۳۴	۱,۰۲۹,۲۵۳,۲۵۰	(۲۴,۰۹۹,۵۱۵)	۱,۰۰۰	۱,۰۰۵,۱۵۳,۷۳۴	۹۳۰,۶۷۴,۲۵۰	۷۴,۴۷۹,۴۸۴
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	۶,۴۰۱	۶,۲۳۶,۵۲۷,۰۴۹	۶,۲۲۳,۶۷۰,۳۶۷	۱۲,۸۵۶,۶۸۲	۶,۴۰۱	۶,۲۳۶,۵۲۷,۰۴۹	۶,۱۴۱,۶۴۳,۲۳۷	۹۴,۸۸۳,۸۱۲
جمع	۱۵,۰۸۷,۲۸۰	۲۰۹,۱۴۶,۴۸۰,۹۱۵	۲۱۲,۸۸۸,۷۹۱,۶۹۲	۳,۷۴۲,۳۱۰,۷۷۳-	۱۵,۰۸۷,۲۸۰	۲۰۹,۱۴۶,۴۸۰,۹۱۵	۳۱۲,۲۷۹,۷۰۰,۷۰۵	-۳,۱۳۳,۲۱۹,۷۸۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	
۰/۱۴	۱۵,۳۶۳,۶۲۸,۷۶۷	۱۹,۰۶۳,۲۵۳,۵۹۳	۴,۶۴۷,۳۹۹,۳۵۳-	۸۴۶,۷۷۴,۵۲۷	(۰/۰۶)	(۷,۰۶۷,۴۹۱,۷۳۲)	(۴۳,۱۷۱,۲۳۵)	(۷,۰۲۴,۳۲۰,۴۹۷)	-	داروسازی سینا
۰/۵۴	۵۹,۴۲۹,۶۱۳,۴۰۷	۵۰,۱۶۸,۸۱۳,۱۵۶	۸,۷۴۵,۲۵۹,۷۴۲	۵۱۵,۵۳۹,۵۰۹	۰/۰۸	۹,۱۶۶,۴۷۵,۱۲۲	۲,۳۴۷,۵۴۶,۳۶۵	۶,۸۱۸,۹۲۸,۷۵۷	-	ویتانا
۰/۱۷	۱۹,۱۶۳,۶۷۲,۶۲۲	۲۲,۸۰۰,۵۳۲,۰۹۷	۳,۶۳۷,۸۵۹,۴۷۵-	۰	(۰/۰۹)	(۹,۶۶۱,۶۲۴,۱۶۳)	(۵,۲۸۰,۹۹۷,۳۱۶)	(۴,۳۸۰,۶۲۶,۸۴۷)	-	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
(۰/۰۰)	۴۵,۱۸۹,۵۹۹-	۳,۷۰۹,۵۷۱,۵۰۱	۳,۷۵۴,۷۶۱,۱۰۰-	۰	۰/۰۳	۳,۶۶۶,۵۳۸,۶۵۲	۲,۵۸۱,۶۹۶,۲۷۹	۱,۰۸۴,۸۴۲,۳۷۳	-	صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام
۰/۰۱	۹۲۳,۹۸۸,۱۹۰	۴,۳۳۹,۲۹۵,۴۱۰-	۷,۸۲۲,۸۹۷-	۵,۱۷۱,۱۰۶,۴۹۷	۰/۰۱	۹۸۳,۵۴۴,۵۷۰	۶۰۲,۵۱۳,۴۱۳	(۲۲۹,۸۹۱,۷۲۶)	۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	صندوق س. دارا الگوریتم-د
(۰/۰۰)	۱۴,۴۴۸,۴۰۵-	۱۴,۴۴۸,۴۰۵-	۰	۰	۰/۰۰	-	-	-	-	سنگ آهن گهرزمین
۰/۸۶	۹۴,۷۱۹,۳۶۳,۹۸۲	۹۱,۴۸۸,۴۲۶,۵۳۲	(۳,۳۰۲,۵۸۳,۰۸۳)	۶,۵۳۳,۴۲۰,۵۳۳	(۰/۰۲۷)	(۲,۹۱۲,۵۵۷,۵۵۱)	۲۰۷,۵۸۷,۵۰۶	(۳,۷۳۱,۰۶۷,۹۴۰)	۶۱۰,۹۲۲,۸۸۳	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 (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	
۸۸۸,۹۳۰,۷۶۴	(۹۵,۴۶۴,۹۸۹)	-	۹۸۴,۳۸۵,۷۵۳	-	-	-	-	اجاره هواپیمایی ماهان ۹۹۰۳
۲۳۶,۹۷۵,۰۰۱	-	۷۴,۴۷۹,۴۸۴	۱۶۲,۴۹۵,۵۱۷	(۷,۴۲۴,۷۱۸)	-	(۲۴,۰۹۹,۵۱۵)	۱۶,۶۷۴,۷۹۷	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱,۱۹۹,۱۲۱,۱۸۶	-	۹۴,۸۸۳,۸۱۲	۱,۱۰۴,۲۳۷,۳۷۴	۱۱۹,۵۹۲,۰۶۱	-	۱۲,۸۵۶,۶۸۲	۱۰۶,۷۳۵,۳۷۹	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۹۶۶,۴۹۱	۹۶۶,۴۹۱	-	-	-	-	-	-	اسنادخزانه-م ۲۰بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶
۲۵,۵۷۶,۹۷۰	۲۵,۵۷۶,۹۷۰	-	-	-	-	-	-	اسنادخزانه-م ۴بودجه ۹۶-۹۸۰۸۲۰
۹۷,۱۷۴,۷۵۳	۹۷,۱۷۴,۷۵۳	-	-	-	-	-	-	اسنادخزانه-م ۶بودجه ۹۶-۹۸۰۷۲۲
۴۱,۷۶۴,۴۶۳	۴۱,۷۶۴,۴۶۳	-	-	-	-	-	-	اسنادخزانه-م ۱۲بودجه ۹۶-۹۸۱۱۱۴
۲,۴۹۰,۴۹۹,۶۲۸	۷۰,۰۱۷,۶۸۸	۱۶۹,۳۶۳,۲۹۶	۲,۲۵۱,۱۱۸,۶۴۴	۱۱۲,۱۶۷,۳۴۳	-	(۱۱,۲۴۲,۸۳۳)	۱۲۳,۴۱۰,۱۷۶	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

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	۵۰,۶۵۳,۸۹۵	۱/۰۰	۲۸۳,۱۸۵,۳۲۷	۰/۲۴
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۸,۴۹۳	۰/۰۰	۵۲۵,۴۸۴,۸۹۲	۰/۴۵
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۸,۴۹۳	۰/۰۰	۳۲۴,۹۹۲,۷۶۱	۰/۲۸
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۸,۴۹۳	۰/۰۰	۴۴,۸۶۳,۲۵۰	۰/۰۴
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	۸,۴۹۳	۰/۰۰	۱۲,۶۸۵	۰/۰۰
جمع		۵۰,۶۸۷,۸۶۷	۱/۰۰	۱,۱۷۸,۵۳۸,۹۱۵	۱/۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۰۶/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۱۸۱,۶۵۵,۷۹۹	۳۲,۲۸۹,۸۷۹	سایر درآمدها
۱۱,۲۰۶,۵۰۴,۷۲۱	۳,۸۳۳,۹۷۸,۳۰۰	درآمد حاصل از کارمزد بازارگردانی
۱۱,۳۸۸,۱۶۰,۵۲۰	۳,۸۶۶,۲۶۸,۱۷۹	جمع