



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱-سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۸/۳۰			تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۹/۳۰		
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		درصد به کل دارایی‌های صندوق
				تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	
داروسازی سینا	۲,۵۱۲,۸۶۲	۷۳,۱۳۸,۲۶۴,۰۸۳	۶۲,۸۴۹,۱۳۴,۱۸۹	۴,۹۳۲,۱۱۸	۱۴۷,۷۸۷,۲۳۳,۳۱۷	(۵,۰۰۳,۶۹۸)	۱۴۶,۲۳۸,۴۱۷,۹۵۳	۶.۱۶
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۸۵۲,۷۷۷	۳۹,۶۵۰,۴۱۱,۶۴۲	۳۴,۴۳۲,۸۲۴,۱۶۶	۱,۷۸۳,۸۰۴	۸۰,۳۹۷,۲۴۷,۷۹۲	(۱,۷۳۰,۵۵۴)	۷۳,۴۳۹,۵۹۹,۴۸۱	۳.۲۰
وینتا	۷۱۴,۷۴۰	۳۸,۸۷۴,۹۶۸,۰۸۷	۳۵,۷۶۳,۴۰۴,۶۴۰	۵,۲۴۴,۴۵۹	۲۵۸,۱۴۲,۳۴۵,۵۹۱	(۴,۶۹۴,۶۵۷)	۲۲۸,۹۸۳,۹۸۰,۴۶۷	۵.۲۹
بیمه سرمد	۳,۴۰۱,۵۱۵	۱۹,۴۵۰,۹۰۶,۱۲۳	۱۹,۰۹۵,۱۸۷,۸۸۹	۱۴,۱۵۶,۸۰۹	۱۰۳,۶۱۱,۴۷۱,۳۹۹	(۱۲,۷۲۳,۳۱۴)	۹۰,۱۵۶,۷۰۱,۰۳۵	۳.۳۴
باما	۴۶۸,۴۸۳	۸۲,۹۱۶,۱۱۷,۷۸۴	۸۷,۵۳۰,۳۷۷,۶۵۷	۶,۷۱۴,۲۲۳	۱۳۷,۵۰۷,۰۲۹,۸۶۲	(۹۲۰,۳۱۶)	۱۱۳,۸۷۴,۹۵۹,۲۵۳	۱۱.۴۳
سرمایه گذاری صنایع ایران	۶,۴۶۰,۰۰۰	۵۶,۸۱۴,۸۱۶,۹۳۲	۵۷,۹۰۲,۱۶۰,۸۸۸	۳,۳۴۲,۴۹۵	۲۸,۳۲۱,۷۸۰,۶۶۱	(۷۰۰۷۳,۰۱۶)	۶۵,۲۹۳,۲۲۲,۴۰۴	۲.۵۲
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	.	.	.	۳۰,۵۲۹,۷۵۶	۱۲۰,۷۳۲,۲۲۰,۸۳۶	(۱۲,۶۸۷,۲۱۵)	۵۱,۷۸۴,۸۸۹,۹۲۹	۵.۶۶
بیمه رازی	.	.	.	۵,۶۵۶,۶۵۷	۷۴,۴۶۳,۴۶۳,۳۴۰	(۳,۱۷۵,۹۱۸)	۴۲,۹۰۹,۷۰۱,۳۰۱	۳۰.۳
صندوق س. دارا الگوریتم	۵۲,۱۸۳,۶۴۰	۵۲۵,۷۵۴,۴۱۴,۲۴۶	۵۲۷,۷۷۳,۴۵۹,۷۹۰	۴۱,۶۲۶,۸۵۷	۴۱۸,۲۵۶,۶۳۰,۶۴۱	(۸۸,۸۵۷,۴۵۸)	۸۹۱,۵۳۶,۳۵۰,۲۹۴	۴.۲۸
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۳,۴۰۰,۰۰۰	۳۳,۱۴۰,۲۱۳,۰۹۹	۳۵,۴۱۹,۵۸۵,۸۵۰	۲۳,۵۳۷,۴۹۸	۲۶۴,۸۳۲,۱۱۶,۵۵۶	(۲۴,۶۳۷,۴۹۸)	۲۸۱,۳۳۷,۸۹۴,۳۵۸	۲.۱۶
جمع	۶۹,۹۹۴,۰۱۷	۸۶۹,۷۴۰,۱۱۱,۹۹۶	۸۶۰,۷۶۶,۱۳۵,۰۶۹	۱۳۷,۵۲۴,۶۷۶	۱,۶۳۴,۰۵۱,۷۳۸,۹۹۵	(۱۶۱,۵۰۳,۶۴۴)	۱,۹۸۵,۵۵۵,۷۱۶,۴۷۵	۴۷.۰۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۸/۲۰		مشخصات حساب بانکی			
سپرده	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۴/۱۲/۱۶	ماه شمار ۱۰٪	۱۴,۲۲۰,۴۹۲,۶۵۳	۹۰,۹۸۹,۵۸۵,۴۵۶	۴۷,۱۳۹,۴۹۱,۸۹۲	۵۸,۰۷۰,۵۸۶,۲۱۷	۴.۹۷٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۱۸,۵۶۴,۳۸۴	۳۹,۳۲۰,۶۰۹,۸۱۹	۳۵,۰۷۶,۷۱۳,۹۵۸	۴,۲۶۲,۴۶۰,۲۴۵	۰.۳۶٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۱۸,۵۶۴,۳۸۴	۸۳,۱۸۲,۹۵۳,۱۷۴	۶۲,۱۰۹,۴۰۱,۶۲۷	۲۱,۰۹۲,۱۱۵,۹۳۱	۱.۸۰٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ماه شمار ۱۰٪	۶,۲۱۵,۸۹۹,۷۳۷	۲۶۲,۹۴۷,۳۲۳,۸۴۰	۱۷,۸۴۱,۵۸۱,۱۳۱	۲۵۱,۳۲۱,۶۴۲,۴۴۶	۲۱.۵۰٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۴/۳۱	ماه شمار ۱۰٪	۱۱,۰۷۷,۸۹۱,۵۵۶	۱۳۴,۳۶۳,۰۲۸,۰۰۰	۱۱۰,۸۰۶,۲۱۴,۳۰۹	۳۴,۶۳۴,۷۰۵,۲۴۷	۲.۹۶٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	ماه شمار ۱۰٪	۱۷,۶۳۳,۲۹۴	۶۳,۶۲۳,۲۸۲,۶۳۵	۳۶,۲۵۱,۵۷۷,۰۶۱	۲۷,۳۸۹,۳۳۸,۸۶۸	۲.۳۴٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۵۲,۵۸۸,۸۴۳,۷۵۳	۵۲,۹۰۴,۷۱۸,۲۸۳	۱۱,۴۱۶,۲۶۰,۵۱۵	۹۴,۰۷۷,۳۰۱,۵۲۱	۸.۰۵٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۲۶	ماه شمار ۱۰٪	۲۲,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۹,۰۲۱,۵۸۵,۵۵۲	۷۴,۸۳۴,۷۳۹,۵۰۰	۴۶,۶۸۶,۸۴۶,۰۵۲	۳.۹۹٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۰۳	ماه شمار ۱۰٪	۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۵,۰۳۱,۳۶۲,۹۷۸	۴۴,۹۶۸,۶۳۷,۰۲۲	۳.۸۵٪
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۰	۷۴,۷۸۵,۱۸۸,۱۴۴	۵۳,۶۷۴,۱۳۵,۴۸۷	۲۱,۱۱۱,۰۵۲,۶۵۷	۱.۸۱٪
جمع					۱۰۶,۶۵۷,۸۸۹,۷۶۱	۱,۰۰۱,۱۳۸,۲۷۴,۹۰۳	۵۰۴,۱۸۱,۴۷۸,۴۵۸	۶۰۳,۶۱۴,۶۸۶,۲۰۶	۵۱.۶۴٪

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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
۲۲,۹۶۷,۹۰۶	-	۲۲,۹۶۷,۹۰۶	۰	-	۰	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	۰	-	۰	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۴۱۴,۳۹۸	۰	۴۱۴,۳۹۸	۱۶۵,۰۸۲	۰	۱۶۵,۰۸۲	۱۰	۰	۱۹م	بانک سامان سی تیر
۳۶۲,۹۹۱	۰	۳۶۲,۹۹۱	۱۵۲,۵۸۴	۰	۱۵۲,۵۸۴	۱۰	۰	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۳۲۵,۴۶۱	۰	۳۲۵,۴۶۱	۱۵۲,۵۸۴	۰	۱۵۲,۵۸۴	۱۰	۰	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۵۲,۹۸۹,۳۲۶	۰	۵۲,۹۸۹,۳۲۶	۵۱,۰۷۳,۹۱۴	۰	۵۱,۰۷۳,۹۱۴	۱۰	۰	۱۳م	بانک سامان سی تیر
۹۸۹,۰۴۲	۰	۹۸۹,۰۴۲	۸۲۱,۹۱۸	۰	۸۲۱,۹۱۸	۱۰	۰	۱۳م	بانک سامان سی تیر
۱۴۴,۹۳۱	۰	۱۴۴,۹۳۱	۱۴۴,۹۳۱	۰	۱۴۴,۹۳۱	۱۰	۰	۱۲م	بانک سامان سی تیر
۲۳۴,۸۵۹,۵۰۵	-	۲۳۴,۷۱۴,۵۷۴	۵۲,۵۱۱,۰۱۳	-	۵۲,۵۱۱,۰۱۳				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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	۳۱,۷۵۲,۳۰۷,۵۱۶	۰.۷۹	۲.۷۲
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۱۹۱,۳۳۶,۰۶۸	۰.۰۰	۰.۰۲
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۵۵,۲۲۶,۱۴۹	۰.۰۰	۰.۰۰
سایر درآمدها	۴-۲	۷,۹۸۰,۵۴۲,۴۳۱	۰.۲۰	۰.۶۸
جمع		۳۹,۹۷۹,۴۱۲,۱۶۴	۱۰۰٪	۳.۴۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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
صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم-درآمد ثابت	-	-	-	۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	۰	۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	۱۱,۱۴۴,۹۳۵,۵۴۱
				۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	-	۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	۱۱,۱۴۴,۹۳۵,۵۴۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار:

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش
داروسازی سینا	۵۰۰۳,۶۹۸	۱۴۶,۳۳۸,۴۱۷,۹۵۳	۱۴۳,۵۲۹,۱۳۳,۸۸۶	۲,۷۰۹,۲۸۴,۰۶۷	۵,۸۳۵,۲۰۱	۱۶۹,۱۸۷,۱۱۱,۲۸۱	۱۶۹,۳۰۲,۲۵۵,۳۶۵	(۱۱۵,۱۴۴,۰۸۴)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱,۷۳۰,۵۵۴	۷۳,۴۳۹,۵۹۹,۴۸۱	۷۹,۳۵۱,۳۰۸,۶۷۱	(۵,۹۱۱,۷۰۹,۱۹۰)	۳,۵۲۶,۲۰۱	۱۵۴,۶۵۷,۳۹۷,۱۰۹	۱۶۵,۷۳۸,۴۹۸,۳۳۱	(۱۱۰,۰۸۱,۱۰۱,۲۲۲)
ویتانا	۴,۶۹۴,۶۵۷	۲۲۸,۹۸۳,۹۸۰,۴۶۷	۲۳۲,۶۲۰,۶۲۸,۲۸۱	(۳,۶۳۶,۶۴۷,۸۱۴)	۶,۵۸۴,۴۴۲	۳۳۰,۱۵۰,۷۰۵,۵۳۱	۳۵۳,۱۸۹,۲۴۲,۴۰۳	(۲۳,۰۳۸,۵۳۶,۸۷۲)
بیمه سرمد	۱۲,۷۲۳,۳۱۴	۹۰,۱۷۸,۲۳۳,۳۹۳	۸۵,۹۷۲,۱۵۲,۷۲۵	۴,۲۰۶,۰۸۰,۶۶۸	۱۷,۸۵۸,۹۴۱	۱۱۹,۴۱۱,۴۰۵,۴۹۳	۱۱۵,۶۴۱,۸۳۲,۱۳۴	۳,۷۶۹,۵۷۳,۲۵۹
باما	۹۲۰,۳۱۶	۱۱۲,۷۳۹,۵۱۵,۳۶۵	۱۰۸,۲۵۳,۸۹۴,۰۶۲	۴,۴۸۵,۶۲۱,۳۰۳	۱,۹۸۰,۳۱۶	۲۸۹,۴۹۱,۱۸۲,۱۹۹	۲۶۷,۶۱۲,۶۲۶,۲۱۸	۲۱,۸۷۸,۵۵۵,۹۸۱
سرمایه گذاری صنایع ایران	۷۰۷۳,۰۱۶	۶۵,۲۹۳,۲۲۲,۴۰۴	۶۱,۲۹۰,۴۰۶,۱۶۳	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱	۷۰۷۳,۰۱۶	۶۵,۲۹۳,۲۲۲,۴۰۴	۶۱,۲۹۰,۴۰۶,۱۶۳	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۱۲,۶۸۷,۲۱۵	۵۱,۷۸۴,۸۸۹,۹۲۹	۵۰,۵۵۵,۲۵۷,۳۶۵	۱,۲۲۹,۶۳۲,۵۶۴	۱۲,۶۸۷,۲۱۵	۵۱,۷۸۴,۸۸۹,۹۲۹	۵۰,۵۵۵,۲۵۷,۳۶۵	۱,۲۲۹,۶۳۲,۵۶۴
بیمه رازی	۳,۱۷۵,۹۱۸	۴۲,۹۰۹,۷۰۱,۳۰۱	۴۱,۴۸۵,۶۸۵,۵۰۱	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰	۳,۱۷۵,۹۱۸	۴۲,۹۰۹,۷۰۱,۳۰۱	۴۱,۴۸۵,۶۸۵,۵۰۱	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰
صندوق س. دارا الگوریتم	۸۸,۸۵۷,۴۵۸	۸۹۱,۵۳۶,۳۵۰,۲۹۴	۸۹۴,۲۰۰,۷۲۱,۵۵۱	(۳,۶۶۴,۳۷۱,۲۵۷)	۲۸۵,۵۴۴,۹۲۳	۲,۸۶۳,۶۲۴,۹۶۷,۹۸۱	۲,۸۶۴,۳۲۷,۲۰۴,۰۵۱	(۷۰۲,۲۳۶,۰۷۰)
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۲۴,۶۳۷,۴۹۸	۲۸۱,۳۳۷,۸۹۴,۳۵۸	۲۷۱,۸۹۶,۲۷۰,۰۲۰	۹,۴۴۱,۶۲۴,۳۳۸	۴۲,۵۸۹,۸۰۳	۴۶۵,۰۷۵,۶۰۲,۴۵۷	۴۵۸,۷۲۷,۷۱۶,۳۶۴	۶,۳۴۷,۸۸۶,۰۹۳
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۹۱,۳۴۷,۷۶۲	۱,۰۰۵,۱۵۳,۷۳۴	(۱۳,۸۰۵,۹۷۲)
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	-	-	-	-	۶,۴۰۱	۶,۲۶۲,۰۳۵,۷۳۳	۶,۲۳۶,۵۲۷,۰۴۹	۲۵,۵۰۸,۶۸۴
جمع	۱۶۱,۵۰۳,۶۴۴	۱,۹۸۴,۴۴۱,۸۰۴,۹۴۵	۱,۹۶۹,۱۵۵,۴۵۸,۲۲۵	۱۵,۲۸۶,۳۴۶,۷۲۰	۳۸۶,۸۶۳,۳۷۷	۴,۵۵۸,۸۳۹,۵۶۹,۱۸۰	۴,۵۵۵,۱۱۲,۴۰۴,۶۷۸	۳,۷۲۷,۱۶۴,۵۰۲

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 الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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	۹۰۶,۰۲۷	۳۷,۴۳۸,۴۵۹,۶۶۰	۳۵,۴۷۸,۷۶۳,۲۸۷	۱,۹۵۹,۶۹۶,۳۷۳	۹۰۶,۰۲۷	۳۷,۴۳۸,۴۵۹,۶۶۰	۴۰,۴۳۵,۸۶۳,۶۸۳	(۲,۹۹۷,۴۰۴,۰۲۳)
داروسازی سینا	۲,۴۴۱,۲۸۲	۷۱,۹۸۷,۴۷۹,۷۲۳	۶۷,۱۰۷,۳۳۳,۶۱۹	۴,۸۸۰,۱۴۶,۱۰۴	۲,۴۴۱,۲۸۲	۷۱,۹۸۷,۴۷۹,۷۲۳	۷۵,۱۲۰,۹۲۶,۹۱۵	(۳,۱۳۳,۴۴۷,۱۹۲)
ویتانا	۱,۲۶۴,۵۴۲	۶۱,۸۱۳,۱۱۶,۳۹۹	۶۱,۲۸۵,۱۲۱,۹۴۹	۵۲۷,۹۹۴,۴۵۰	۱,۲۶۴,۵۴۲	۶۱,۸۱۳,۱۱۶,۳۹۹	۶۵,۶۴۳,۹۹۹,۶۲۴	(۳,۸۳۰,۸۸۳,۲۲۵)
بیمه سرمد	۴,۸۳۵,۰۱۰	۳۹,۰۱۳,۰۳۳,۲۹۳	۳۶,۷۳۴,۵۰۶,۵۶۳	۲,۲۷۸,۵۲۶,۷۳۰	۴,۸۳۵,۰۱۰	۳۹,۰۱۳,۰۳۳,۲۹۳	۳۷,۰۹۰,۲۲۴,۷۹۷	۱,۹۲۲,۸۰۸,۴۹۶
باما	۶,۲۶۲,۳۹۰	۱۳۳,۶۶۲,۹۸۹,۲۶۵	۱۱۶,۷۸۳,۵۱۳,۴۵۶	۱۶,۸۷۹,۴۷۵,۸۰۹	۶,۲۶۲,۳۹۰	۱۳۳,۶۶۲,۹۸۹,۲۶۵	۱۱۲,۱۶۹,۲۵۳,۵۸۴	۲۱,۴۹۳,۷۳۵,۶۸۱
سرمایه گذاری صنایع ایران	۲,۷۲۹,۴۷۹	۲۹,۴۱۵,۰۵۸,۵۶۷	۲۴,۹۳۳,۵۳۵,۳۸۶	۴,۴۸۱,۵۲۳,۱۸۱	۲,۷۲۹,۴۷۹	۲۹,۴۱۵,۰۵۸,۵۶۷	۲۳,۸۴۶,۱۹۱,۴۳۰	۵,۵۶۸,۸۶۷,۱۳۷
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۱۷,۸۴۲,۵۴۱	۶۶,۱۰۹,۸۶۰,۳۲۰	۷۰,۱۷۷,۰۶۳,۴۷۱	(۴,۰۶۷,۲۰۳,۱۵۱)	۱۷,۸۴۲,۵۴۱	۶۶,۱۰۹,۸۶۰,۳۲۰	۷۰,۱۷۷,۰۶۳,۴۷۱	(۴,۰۶۷,۲۰۳,۱۵۱)
بیمه رازی	۲,۴۸۰,۷۳۹	۳۵,۴۶۰,۰۰۱,۲۹۶	۳۲,۹۷۷,۷۷۶,۸۳۹	۲,۴۸۲,۲۲۴,۴۵۷	۲,۴۸۰,۷۳۹	۳۵,۴۶۰,۰۰۱,۲۹۶	۳۲,۹۷۷,۷۷۶,۸۳۹	۲,۴۸۲,۲۲۴,۴۵۷
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۴,۹۵۳,۰۳۹	۴۹,۹۷۵,۰۳۹,۰۴۶	۵۱,۸۲۹,۳۶۸,۸۷۹	(۱,۸۵۴,۳۲۹,۸۳۳)	۴,۹۵۳,۰۳۹	۴۹,۹۷۵,۰۳۹,۰۴۶	۴۹,۸۱۰,۳۲۳,۳۱۴	۱۶۴,۷۱۵,۷۳۲
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۲,۳۰۰,۰۰۰	۲۵,۲۷۰,۹۹۶,۷۱۲	۲۸,۳۵۵,۴۳۲,۳۸۶	(۳,۰۸۴,۴۳۵,۶۷۴)	۲,۳۰۰,۰۰۰	۲۵,۲۷۰,۹۹۶,۷۱۲	۲۵,۹۸۲,۵۰۰,۴۳۹	(۷۱۱,۵۰۳,۷۲۷)
جمع	۴۶,۰۱۵,۰۴۹	۵۵۰,۱۴۶,۰۳۴,۲۸۱	۵۲۵,۶۶۲,۴۱۵,۸۳۵	۲۴,۴۸۳,۶۱۸,۴۴۶	۴۶,۰۱۵,۰۴۹	۵۵۰,۱۴۶,۰۳۴,۲۸۱	۵۳۳,۲۵۴,۱۲۴,۰۹۶	۱۶,۸۹۱,۹۱۰,۱۸۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه					طی ماه					نام شرکت
درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ	درصد از کل درآمدها	
-	۴,۸۸۰,۱۴۶,۱۰۴	۲,۷۰۹,۲۸۴,۰۶۷	۷,۵۸۹,۴۳۰,۱۷۱	۰.۱۹	-	۳,۶۳۶,۶۴۷,۸۱۴	۳,۱۰۸,۶۵۳,۳۶۴	۳,۱۰۸,۶۵۳,۳۶۴	۰.۰۸	داروسازی سینا
-	۵۲۷,۹۹۴,۴۵۰	(۳,۶۳۶,۶۴۷,۸۱۴)	(۳,۱۰۸,۶۵۳,۳۶۴)	(۰.۰۸)	-	(۳,۶۳۶,۶۴۷,۸۱۴)	(۳,۱۰۸,۶۵۳,۳۶۴)	(۳,۱۰۸,۶۵۳,۳۶۴)	(۰.۰۸)	وینتانا
-	۱,۹۵۹,۶۹۶,۳۷۳	(۵,۹۱۱,۷۰۹,۱۹۰)	(۳,۹۵۲,۰۱۲,۸۱۷)	(۰.۱۰)	-	(۳,۹۵۲,۰۱۲,۸۱۷)	(۳,۹۵۲,۰۱۲,۸۱۷)	(۳,۹۵۲,۰۱۲,۸۱۷)	(۰.۱۰)	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
-	۲,۲۷۸,۵۲۶,۷۳۰	۴,۲۰۶,۰۸۰,۶۶۸	۶,۴۸۴,۶۰۷,۳۹۸	۰.۱۶	-	۴,۲۰۶,۰۸۰,۶۶۸	۴,۲۰۶,۰۸۰,۶۶۸	۴,۲۰۶,۰۸۰,۶۶۸	۰.۱۶	بیمه سرمد
-	۱۶,۸۷۹,۴۷۵,۸۰۹	۴,۴۸۵,۶۲۱,۳۰۳	۲۱,۳۶۵,۰۹۷,۱۱۲	۰.۵۳	-	۴,۴۸۵,۶۲۱,۳۰۳	۴,۴۸۵,۶۲۱,۳۰۳	۴,۴۸۵,۶۲۱,۳۰۳	۰.۵۳	باما
-	۴,۴۸۱,۵۲۳,۱۸۱	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱	۸,۴۸۴,۳۳۹,۴۲۲	۰.۲۱	-	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱	۴,۰۰۲,۸۱۶,۲۴۱	۰.۲۱	سرمایه‌گذاری صنایع ایران
-	(۴,۰۶۷,۲۰۳,۱۵۱)	۱,۲۲۹,۶۳۲,۵۶۴	(۲,۸۳۷,۵۷۰,۵۸۷)	(۰.۰۷)	-	۱,۲۲۹,۶۳۲,۵۶۴	(۲,۸۳۷,۵۷۰,۵۸۷)	(۲,۸۳۷,۵۷۰,۵۸۷)	(۰.۰۷)	س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس
-	۲,۴۸۲,۲۲۴,۴۵۷	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰	۳,۹۰۶,۲۴۰,۲۵۷	۰.۱۰	-	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰	۱,۴۲۴,۰۱۵,۸۰۰	۰.۱۰	بیمه رازی
۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	(۱,۸۵۴,۳۲۹,۸۳۳)	(۲,۶۶۴,۳۷۱,۲۵۷)	۴,۱۹۵,۹۶۶,۷۹۰	۰.۱۰	۱۱,۱۴۴,۹۳۵,۵۴۱	۱۶۴,۷۱۵,۷۳۲	(۷۰۲,۲۳۶,۰۷۰)	۱۰,۶۰۷,۴۱۵,۲۰۳	۰.۳۷	صندوق س. دارا الگوریتم-د
-	(۳,۰۸۴,۴۳۵,۶۷۴)	۹,۴۴۱,۶۲۴,۳۳۸	۶,۳۵۷,۱۸۸,۶۶۴	۰.۱۶	-	۹,۴۴۱,۶۲۴,۳۳۸	۶,۳۵۷,۱۸۸,۶۶۴	۶,۳۵۷,۱۸۸,۶۶۴	۰.۱۶	صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام
۸,۷۱۴,۶۶۷,۸۸۰	۲۴,۴۸۳,۶۱۸,۴۴۶	۱۵,۳۸۶,۳۴۶,۷۲۰	۴۸,۴۸۴,۶۳۳,۰۴۶	۱.۲۱	۱۱,۱۴۴,۹۳۵,۵۴۱	۱۶,۸۹۱,۹۱۰,۱۸۵	۳,۷۱۵,۴۶۱,۷۹۰	۳۱,۷۵۲,۳۰۷,۵۱۶	۰.۷۹	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 ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	-	-	-	۲۲,۹۶۷,۹۰۶	-	(۱۳,۸۰۵,۹۷۲)	۹,۱۶۱,۹۳۴
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	-	-	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	۲۵,۵۰۸,۶۸۴	۱۸۲,۱۷۴,۱۳۴
جمع	۰	-	-	-	۱۷۹,۶۳۳,۳۵۶	-	۱۱,۷۰۲,۷۱۲	۱۹۱,۳۳۶,۰۶۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

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	۱۶۵,۰۸۲	۰.۰۰	۴۱۴,۳۹۸	۰.۰۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۱۵۲,۵۸۴	۰.۰۰	۳۶۲,۹۹۱	۰.۰۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۱۵۲,۵۸۴	۰.۰۰	۳۲۵,۴۶۱	۰.۰۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۵۱,۰۷۳,۹۱۴	۰.۹۷	۵۲,۹۸۹,۳۲۶	۰.۹۶
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	۸۲۱,۹۱۸	۰.۰۲	۹۸۹,۰۴۲	۰.۰۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	۱۴۴,۹۳۱	۰.۰۰	۱۴۴,۹۳۱	۰.۰۰
جمع		۵۲,۵۱۱,۰۱۳	۱.۰۰	۵۵,۲۲۶,۱۴۹	۱.۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۰۹/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۷,۵۴۶,۸۱۰,۹۴۵	۳۵۳,۱۱۲,۵۷۶	کارمزد بازارگردانی صندوق های سرمایه گذاری
۴۳۳,۷۳۱,۴۸۶	۱۷,۳۳۵,۹۵۲	سایر درآمدها
۷,۹۸۰,۵۴۲,۴۳۱	۳۷۰,۴۴۸,۵۲۸	جمع