



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری ها

۱-۱-سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۱۰/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۱۱/۳۰			درصد به کل دارایی‌های صندوق	
	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	۴,۲۶۴,۳۲۰	۱۳۱,۷۳۳,۰۹۵,۳۵۱	۱۳۰,۳۸۹,۰۲۰,۹۷۴	۴,۳۲۵,۷۳۸	۱۱۸,۱۱۳,۵۹۵,۷۸۹	(۵,۱۵۸,۸۲۱)	۱۴۳,۲۷۵,۲۳۰,۳۷۵	۳,۴۴۱,۲۳۷	۲۹,۳۶۰	۹۸,۹۱۴,۴۰۰,۵۸۴	۱۰۰,۶۶۴,۵۵۵,۰۷۰	۶.۵۳
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۶۷۰,۵۵۸	۳۱,۱۶۵,۴۶۱,۳۰۱	۳۸,۴۲۴,۷۹۲,۳۰۳	۵۴۵,۲۲۵	۲۴,۵۹۹,۸۵۱,۰۱۰	(۱,۳۱۵,۷۸۳)	۵۵,۷۹۷,۸۲۴,۶۲۳	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰
ویتانا	۱,۴۱۳,۹۵۹	۲۹,۳۱۱,۵۸۳,۳۴۷	۲۸,۸۸۷,۸۳۴,۲۶۲	۱,۶۵۷,۷۳۶	۳۷,۵۰۸,۳۵۴,۳۵۰	(۳,۰۱۹,۳۶۹)	۴۳,۰۷۰,۰۸۹,۴۹۸	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۸,۵۱۴	۲۳,۵۳۵,۰۱۹,۱۷۲	۱۹,۳۱۱,۳۱۵,۳۴۵	۱.۲۵
ح.ویتانا	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۸,۹۹۹,۳۵۱,۱۵۲	۲۸,۵۶۳,۰۹۸,۳۴۹	۰	۰	(۱,۴۶۹,۹۵۹)	۲۰,۲۴۵,۵۰۴,۲۸۷	۰	۰	۰	۰	۰.۰۰
بیمه سرمد	۱۵,۳۳۰,۲۸۴	۱۳۱,۶۹۹,۳۸۳,۶۷۸	۱۱۴,۳۵۳,۵۹۵,۲۲۷	۱۱,۰۶۲,۵۴۸	۷۳,۱۰۳,۶۸۶,۰۷۲	(۱۱,۷۷۳,۴۹۰)	۷۷,۵۲۷,۴۷۷,۵۰۰	۱۴,۶۱۹,۳۴۲	۶,۹۳۱	۱۱۲,۹۳۷,۵۰۵,۸۳۰	۱۰۱,۳۴۹,۶۵۱,۱۴۱	۶.۵۷
پایا	۵,۴۲۹,۳۹۰	۱۰۹,۴۷۳,۵۵۴,۶۸۷	۱۰۳,۸۹۳,۷۹۹,۱۵۸	۳,۵۴۸,۷۷۹	۵۸,۰۶۵,۹۱۶,۱۴۵	(۲,۷۷۲,۶۳۵)	۴۴,۹۹۸,۳۱۲,۲۳۷	۶,۲۰۵,۵۳۴	۱۵,۱۹۰	۱۱۳,۷۵۷,۳۰۰,۳۵۲	۹۴,۱۹۰,۴۲۲,۲۹۳	۶.۱۱
سرمایه گذاری صنایع ایران	۲,۸۶۱,۸۶۳	۳۳,۶۱۰,۵۶۶,۵۷۳	۳۸,۵۲۵,۷۱۶,۵۲۲	۵,۵۵۱,۳۷۵	۶۶,۷۸۰,۸۱۲,۱۹۱	(۶۳۴,۷۲۹)	۷,۲۳۱,۰۱۱,۳۲۱	۷,۷۸۸,۴۰۹	۱۰,۷۹۰	۹۲,۰۰۲,۱۹۹,۶۸۱	۸۳,۹۷۳,۰۶۵,۰۴۱	۵.۴۵
بیمه رازی	۸,۶۸۰,۴۸۶	۹۹,۹۶۴,۴۵۸,۰۲۹	۷۵,۰۲۰,۴۶۴,۴۹۶	۳,۲۶۸,۸۵۳	۲۶,۹۴۴,۴۰۵,۳۲۲	(۶,۸۸۶,۹۷۵)	۶۰,۰۲۵,۲۰۵,۴۱۸	۵,۰۶۲,۳۶۴	۹,۳۲۸	۵۳,۱۲۸,۵۱۵,۴۰۸	۴۷,۱۸۵,۸۴۲,۸۷۶	۳.۰۶
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۴,۶۴۹,۰۸۹	۹۰,۷۶۱,۳۹۰,۴۰۶	۸۱,۵۲۶,۴۷۷,۳۴۲	۱,۵۰۰,۰۰۰	۴,۶۳۷,۳۶۶,۰۷۱	(۳,۵۹۲,۱۹۳)	۱۱,۴۴۶,۸۴۴,۵۳۳	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۳,۰۶۶	۸۲,۲۲۹,۳۷۴,۱۳۹	۶۹,۱۰۶,۸۸۱,۹۵۹	۴.۴۸
صندوق س. دارا الگوریتم	۵۰,۱۳۵,۴۴۷	۵۰۱,۸۶۷,۰۸۱,۸۸۴	۴۹۹,۲۸۷,۶۸۳,۴۴۷	۱۱۹,۷۹۳,۲۷۶	۱,۱۹۷,۴۱۷,۶۱۳,۵۲۲	(۱۰۳,۹۹۱,۸۸۱)	۱,۰۳۹,۵۷۱,۳۵۰,۹۸۳	۶۵,۹۳۶,۸۴۲	۱۰,۱۴۰	۶۶۰,۳۴۴,۶۱۳,۹۷۸	۶۶۸,۵۸۴,۵۳۴,۳۸۹	۴۳.۳۶
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۸,۰۲۱,۸۱۰	۸۲,۵۶۰,۸۲۳,۵۰۴	۶۹,۷۷۳,۱۷۱,۹۳۵	۱۰,۳۰۰,۰۰۰	۱۰۲,۳۷۶,۴۷۸,۳۹۱	(۸,۱۲۱,۸۱۰)	۸۲,۰۶۸,۶۳۷,۰۸۱	۱۰,۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۰۵۰	۱۰۲,۳۱۷,۹۲۱,۴۴۷	۱۰۱,۴۸۰,۸۹۲,۵۶۳	۶.۵۸
جمع	۱۲۲,۹۲۷,۱۶۵	۱,۲۷۰,۱۴۶,۷۴۸,۸۱۲	۱,۱۹۸,۶۴۵,۶۵۲,۸۱۵	۱۶۱,۴۵۳,۴۳۰	۱,۷۰۹,۴۴۷,۰۷۸,۲۹۳	(۱۴۷,۶۲۷,۶۴۵)	۱,۵۸۵,۲۵۷,۲۸۷,۷۵۶	۱۳۶,۷۵۲,۹۵۰	-	۱,۳۳۹,۰۶۶,۸۴۹,۴۹۱	۱,۲۸۵,۷۴۷,۱۶۰,۵۷۷	۸۳.۲۹

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۱-۳- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت																		تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۱۰/۳۰				۱۳۹۹/۱۱/۳۰			
نام اوراق	دارای مجوز از سازمان	بورسی یا فرابورسی	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	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																
مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۳۰۴	بله	بله	۱۳۹۹/۰۶/۱۶	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	۱۸	۱۸	۱۳۸,۰۰۰	۱۳۸,۰۹۱,۲۵۰,۰۰۰	۱۴۶,۸۵۱,۵۱۲,۳۹۵	۰	۰	۱۸,۵۰۰	۱۸,۴۸۶,۵۸۷,۵۰۰	۱۱۹,۵۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۹,۵۷۹,۰۱۷,۲۱۰	۱۲۹,۰۳۲,۹۱۶,۵۹۷	۸.۳۷											
جمع							۱۳۸,۰۰۰	۱۳۸,۰۹۱,۲۵۰,۰۰۰	۱۴۶,۸۵۱,۵۱۲,۳۹۵	۰	۰	۱۸,۵۰۰	۱۸,۴۸۶,۵۸۷,۵۰۰	۱۱۹,۵۰۰	-	۱۱۹,۵۷۹,۰۱۷,۲۱۰	۱۲۹,۰۳۲,۹۱۶,۵۹۷	۸.۳۷											

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	مشخصات حساب بانکی				۱۳۹۹/۱۰/۳۰	تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۱۱/۳۰	درصد به کل دارایی‌ها
	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٪	۲۵,۰۵۵,۲۱۲,۳۶۱	۳۷,۰۰۶,۱۴۲,۲۸۴	۵۴,۹۴۱,۷۳۷,۱۲۳	۷,۱۱۹,۶۱۷,۵۲۲	۰.۴۶
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۹۹,۱۹۲,۵۰۳	۳۱,۸۷۱,۱۹۷,۱۷۷	۶,۷۲۹,۵۵۷	۳۱,۹۶۳,۶۶۰,۱۲۳	۲.۰۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۹۹,۲۰۱,۷۵۸	۲۶,۴۲۱,۸۴۳,۸۰۴	۴,۰۶۲,۸۸۹	۲۶,۵۱۶,۹۸۲,۶۷۳	۱.۷۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ماه شمار ۱۰٪	۳۵,۵۷۳,۱۲۲,۱۸۷	۷۲۴,۵۸۷,۹۲۸,۰۸۲	۷۵۹,۱۰۲,۶۷۲,۱۸۷	۱,۰۵۸,۳۷۸,۰۸۲	۰.۰۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۴/۳۱	ماه شمار ۱۰٪	۱۵۲,۷۰۹,۴۷۴	۳۵,۷۰۵,۹۰۹,۷۳۱	۳۵,۵۵۷,۷۹۷,۲۸۷	۳۰۰,۸۲۱,۹۱۸	۰.۰۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	ماه شمار ۱۰٪	۱۰۰,۱۵۵,۶۸۲	۵۸,۲۹۸,۸۱۹,۲۱۱	۵۸,۲۴۹,۰۱۰,۳۹۴	۱۴۹,۹۶۴,۴۹۹	۰.۰۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۹۹,۷۵۰,۰۰۰	۱۳,۳۴۲,۴۶۶,۷۰۹	۷,۳۶۶,۳۵۴,۳۳۸	۶,۰۷۵,۸۶۲,۳۷۱	۰.۳۹
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۲۶	ماه شمار ۱۰٪	۲۶,۷۷۴,۴۱۹,۶۱۸	۲۲۰,۰۶۳,۷۲۳	۲۶,۸۹۴,۹۸۳,۳۴۱	۹۹,۵۰۰,۰۰۰	۰.۰۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۰۳	ماه شمار ۱۰٪	۹,۴۶۶,۶۴۱,۳۹۷	۴۹,۸۱۷,۷۴۴,۶۹۲	۱۰,۸۶۶,۲۶۳,۲۲۷	۴۸,۴۱۸,۱۲۲,۸۶۲	۳.۱۴
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۳۱۴,۱۸۲,۴۱۵	۸۲۱,۵۶۶	۲۱۵,۵۶۰,۵۸۵	۹۹,۴۴۳,۳۹۶	۰.۰۱
جمع					۹۷,۷۳۴,۵۸۷,۳۹۵	۹۷۷,۲۷۲,۹۳۶,۹۷۹	۹۵۳,۲۰۵,۱۷۰,۹۲۸	۱۲۱,۸۰۲,۳۵۳,۴۴۶	۷.۹۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	خالص درآمد
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۰	-	۰	۲۲,۹۶۷,۹۰۶	-	۲۲,۹۶۷,۹۰۶
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۹	۰	-	۰	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰
مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۳۰۲	-	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	۱۸	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	-	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	۳,۱۷۵,۵۲۸,۲۷۷	-	۳,۱۷۵,۵۲۸,۲۷۷
بانک سامان سی تیر	۱۹م	-	۱۰	۳,۲۸۶,۸۶۰	-	۳,۲۸۶,۸۶۰	۹,۲۷۶,۹۳۰	-	۹,۲۷۶,۹۳۰
بانک سامان سی تیر	۱۴م	-	۱۰	۸۱۵,۲۸۱	-	۸۱۵,۲۸۱	۱,۹۹۰,۹۳۵	-	۱,۹۹۰,۹۳۵
بانک سامان سی تیر	۱۴م	-	۱۰	۸۱۵,۳۵۷	-	۸۱۵,۳۵۷	۱,۹۶۲,۷۳۶	-	۱,۹۶۲,۷۳۶
بانک سامان سی تیر	۱۲م	-	۱۰	۸,۶۲۸,۰۸۲	-	۸,۶۲۸,۰۸۲	۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵	-	۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵
بانک سامان سی تیر	۱۲م	-	۱۰	۸۲۱,۹۱۸	-	۸۲۱,۹۱۸	۳,۰۵۵,۸۷۴	-	۳,۰۵۵,۸۷۴
بانک سامان سی تیر	۱۲م	-	۱۰	۸۱۹,۲۱۱	-	۸۱۹,۲۱۱	۱,۷۸۴,۰۰۵	-	۱,۷۸۴,۰۰۵
بانک سامان سی تیر	۱۵م	-	۱۰	۸۱۹,۸۶۳	-	۸۱۹,۸۶۳	۳۳۹,۲۲۴,۶۵۷	-	۳۳۹,۲۲۴,۶۵۷
بانک سامان سی تیر	۱۵م	-	۱۰	۲۲۰,۰۶۳,۷۲۳	-	۲۲۰,۰۶۳,۷۲۳	۲۲۰,۸۳۹,۵۶۴	-	۲۲۰,۸۳۹,۵۶۴
بانک سامان سی تیر	۱۲م	-	۱۰	۴۱,۵۴۹,۵۰۲	-	۴۱,۵۴۹,۵۰۲	۴۱,۵۴۹,۵۰۲	-	۴۱,۵۴۹,۵۰۲
بانک سامان سی تیر	۱۱۰م	-	۱۰	۸۲۱,۵۶۶	-	۸۲۱,۵۶۶	۸۲۱,۵۶۶	-	۸۲۱,۵۶۶
جمع				۲,۱۷۴,۰۵۱,۶۰۸	-	۲,۱۷۴,۰۵۱,۶۰۸	۴,۳۲۲,۷۰۹,۱۷۷	-	۴,۳۲۲,۷۰۹,۱۷۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	(۵۰,۲۴۲,۵۰۶,۸۲۳)	۱۳۶.۵۹	(۳.۲۶)
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۳,۱۵۳,۸۱۴,۳۴۵	(۸.۵۷)	۰.۲۰
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۹۶۷,۵۴۷,۵۴۴	(۲.۶۳)	۰.۰۶
سایر درآمدها	۴-۲	۹,۳۳۷,۸۷۲,۶۶۹	(۲۵.۳۹)	۰.۶۱
جمع		(۳۶,۷۸۳,۲۷۲,۲۶۵)	۱۰۰	(۲.۳۹)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	هزینه تنزیل
سرمایه گذاری صنایع ایران	۱۳۹۹/۱۱/۲۸	۷,۷۸۸,۴۰۹	۵۰۰	۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۵۳۳,۹۵۷,۱۱۸
صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم-درآمد ثابت	-	-	-	-	-
				۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۵۳۳,۹۵۷,۱۱۸
				۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۵۳۳,۹۵۷,۱۱۸
				۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۵۳۳,۹۵۷,۱۱۸
				۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۵۳۳,۹۵۷,۱۱۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	۵,۱۵۸,۸۲۱	۱۴۳,۳۷۵,۳۳۰,۳۷۵	۱۵۰,۹۳۰,۲۵۷,۹۱۰	(۷,۶۵۵,۰۲۷,۶۳۵)	۱۵,۵۴۱,۵۶۴	۴۵۷,۴۱۶,۳۱۸,۴۱۲	۴۶۰,۰۰۳,۳۱۶,۱۲۹	(۲,۵۸۶,۹۹۷,۷۱۷)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱,۲۱۵,۷۸۳	۵۵,۶۶۶,۰۴۵,۴۶۳	۵۳,۰۲۴,۶۴۳,۲۱۳	۲,۶۴۱,۴۰۲,۲۵۰	۷,۰۷۰,۶۲۳	۳۱۲,۵۵۳,۸۱۰,۶۶۵	۳۲۴,۶۳۰,۰۶۲,۷۴۰	(۱۲,۰۷۶,۲۵۲,۰۷۵)
ویتانا	۲,۰۱۹,۳۶۹	۴۳,۰۶۰,۷۴۳,۰۰۰	۴۳,۲۸۴,۹۵۹,۹۴۱	(۲۲۴,۲۱۶,۹۴۱)	۱۱,۲۵۹,۸۵۱	۵۱۶,۱۴۴,۲۹۱,۴۲۲	۵۳۹,۵۸۳,۴۵۱,۴۶۸	(۲۳,۴۳۹,۱۶۰,۰۴۶)
ح.ویتانا	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۰,۲۴۵,۵۰۴,۲۸۷	۲۸,۵۶۳,۰۹۸,۲۴۸	(۸,۳۱۷,۵۹۳,۹۶۱)	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۰,۲۴۵,۵۰۴,۲۸۷	۲۸,۹۹۹,۳۵۱,۱۵۲	(۸,۷۵۳,۸۴۶,۸۶۵)
بیمه سرمد	۱۱,۷۷۳,۴۹۰	۷۷,۵۲۷,۴۷۷,۵۰۰	۹۱,۸۶۵,۵۶۳,۹۲۰	(۱۴,۳۳۸,۰۸۶,۴۲۰)	۳۹,۸۳۷,۱۰۰	۲۸۵,۴۳۲,۹۱۷,۱۶۱	۲۹۲,۵۶۴,۲۷۶,۹۶۸	(۷,۱۳۱,۳۵۹,۸۰۷)
باما	۲,۷۷۲,۶۳۵	۴۴,۹۹۸,۳۱۲,۳۳۷	۵۳,۷۸۲,۱۷۰,۵۸۰	(۸,۷۸۳,۸۵۸,۳۴۳)	۸,۸۲۴,۴۵۱	۴۳۳,۹۶۹,۴۸۰,۰۱۸	۳۹۶,۶۸۲,۰۲۲,۳۲۴	۳۷,۲۸۷,۴۵۷,۶۹۴
سرمایه گذاری صنایع ایران	۶۲۴,۷۲۹	۷,۲۳۱,۰۱۱,۳۲۱	۷,۳۸۹,۱۷۹,۰۸۳	(۱۵۸,۱۶۷,۷۶۲)	۱۲,۴۴۵,۵۱۸	۱۳۰,۵۰۱,۳۵۱,۳۱۱	۱۱۶,۳۰۹,۱۰۵,۱۱۸	۱۴,۱۹۲,۲۴۶,۱۹۳
بیمه رازی	۶,۸۸۶,۹۷۵	۶۰,۰۲۵,۲۰۵,۴۱۸	۷۳,۷۸۰,۳۴۷,۸۴۳	(۱۳,۷۵۵,۱۴۲,۴۲۵)	۱۱,۲۲۰,۹۹۴	۱۱۷,۳۰۹,۶۷۴,۳۲۲	۱۳۰,۳۶۵,۵۷۵,۷۵۲	(۱۳,۰۵۵,۹۰۱,۴۳۰)
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۳,۵۹۲,۱۹۳	۱۱,۴۴۶,۸۴۴,۵۳۳	۱۳,۱۶۹,۳۸۲,۳۳۸	(۱,۷۲۲,۵۳۷,۸۰۵)	۴۵,۶۳۰,۹۷۱	۱۷۵,۴۱۴,۰۱۷,۰۹۸	۱۷۷,۰۷۹,۶۱۷,۱۳۱	(۱,۶۶۵,۶۰۰,۰۳۳)
صندوق س. دارا الگوریتم	۱۰۳,۹۹۱,۸۸۱	۱۰,۰۳۹,۵۷۱,۲۵۰,۹۸۳	۱۰,۰۳۹,۰۴۰,۰۸۲,۱۵۷	۵۳۱,۱۶۸,۸۲۶	۴۲۱,۰۹۲,۲۷۷	۴,۲۱۹,۹۴۰,۶۵۲,۶۳۴	۴,۲۱۸,۸۷۳,۵۴۶,۹۲۲	۱,۰۶۷,۱۰۵,۷۱۲
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۸,۱۲۱,۸۱۰	۸۲,۰۶۸,۶۳۷,۰۸۱	۸۲,۵۱۸,۸۱۳,۵۰۴	(۴۵۰,۱۷۶,۴۲۳)	۵۳,۱۲۲,۱۶۲	۵۷۱,۱۵۹,۶۶۲,۵۲۶	۵۶۷,۱۹۸,۷۴۶,۳۱۳	۳,۹۶۰,۹۱۶,۲۱۳
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
مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۳۰۲	۱۸,۵۰۰	۱۸,۴۸۶,۵۸۷,۵۰۰	۱۸,۵۱۴,۶۹۶,۴۲۳	(۲۸,۱۰۸,۹۲۳)	۳۳,۵۰۰	۳۳,۴۷۵,۷۱۲,۵۰۰	۳۳,۵۲۵,۵۷۱,۴۲۳	(۴۹,۸۵۸,۹۲۳)
جمع	۱۴۷,۶۴۶,۱۴۵	۱,۶۰۳,۶۰۲,۸۴۹,۵۹۸	۱,۶۵۵,۸۶۳,۱۹۵,۱۶۰	(۵۲,۲۶۰,۳۴۵,۵۶۲)	۶۲۷,۵۵۶,۳۷۱	۷,۲۸۰,۸۱۶,۷۷۵,۸۵۱	۷,۲۹۳,۰۵۶,۳۲۴,۲۲۳	(۱۲,۲۳۹,۵۴۸,۳۷۲)

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/اورقه 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 ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۶۵,۹۳۶,۸۴۲	۶۶۸,۵۸۴,۵۳۴,۳۸۹	۶۵۷,۶۶۵,۲۱۳,۵۴۲	۱۰,۹۱۹,۳۲۰,۸۴۷	۶۵,۹۳۶,۸۴۲	۶۶۸,۵۸۴,۵۳۴,۳۸۹	۶۶۰,۲۴۴,۶۱۲,۹۷۲	۸,۳۳۹,۹۲۱,۴۱۷
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۶۹,۱۰۶,۸۸۱,۹۵۹	۷۲,۹۹۴,۴۶۱,۰۷۴	(۳,۸۸۷,۵۷۹,۱۱۵)	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۶۹,۱۰۶,۸۸۱,۹۵۹	۸۲,۲۲۹,۳۷۴,۱۳۹	(۱۳,۱۲۲,۴۹۲,۱۸۰)
بیمه سرمد	۱۴,۶۱۹,۳۴۲	۱۰۱,۲۴۹,۶۵۱,۱۴۰	۹۵,۵۹۱,۷۱۷,۳۷۸	۵,۶۵۷,۹۳۳,۷۶۲	۱۴,۶۱۹,۳۴۲	۱۰۱,۲۴۹,۶۵۱,۱۴۲	۱۱۲,۹۳۷,۵۰۵,۸۳۰	(۱۱,۶۸۷,۸۵۴,۶۸۸)
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۱۰,۱۰۰,۰۰۰	۱۰۱,۴۸۰,۸۹۲,۵۶۲	۸۹,۵۳۰,۸۳۶,۷۲۲	۱۱,۹۵۰,۰۵۵,۸۴۰	۱۰,۱۰۰,۰۰۰	۱۰۱,۴۸۰,۸۹۲,۵۶۳	۱۰۲,۳۱۷,۷۷۴,۱۷۸	(۸۳۶,۸۸۱,۶۱۵)
سرمایه گذاری صنایع ایران	۷,۷۸۸,۴۰۹	۸۳,۹۷۳,۰۶۵,۰۴۰	۹۷,۹۱۷,۳۴۹,۶۳۰	(۱۳,۹۴۴,۲۸۴,۵۹۰)	۷,۷۸۸,۴۰۹	۸۳,۹۷۳,۰۶۵,۰۴۱	۹۲,۰۰۲,۱۹۹,۶۸۱	(۸,۰۲۹,۱۳۴,۶۴۰)
باما	۶,۲۰۵,۵۳۴	۹۴,۱۹۰,۴۲۲,۲۹۳	۱۰۸,۱۷۷,۵۴۴,۷۲۲	(۱۳,۹۸۷,۱۲۲,۴۲۹)	۶,۲۰۵,۵۳۴	۹۴,۱۹۰,۴۲۲,۲۹۴	۱۱۳,۷۵۷,۳۰۰,۲۵۲	(۱۹,۵۶۶,۸۷۷,۹۵۸)
بیمه رازی	۵,۰۶۲,۳۶۴	۴۷,۱۸۵,۸۴۲,۸۷۶	۲۸,۱۸۴,۵۲۱,۸۷۵	۱۹,۰۰۱,۳۲۱,۰۰۱	۵,۰۶۲,۳۶۴	۴۷,۱۸۵,۸۴۲,۸۷۶	۵۳,۱۲۸,۵۱۵,۴۰۸	(۵,۹۴۲,۶۷۲,۵۳۲)
داروسازی سینا	۳,۴۳۱,۲۳۷	۱۰۰,۶۶۴,۵۵۵,۰۷۰	۹۷,۵۷۱,۳۵۸,۸۵۳	۳,۰۹۳,۱۹۶,۲۱۷	۳,۴۳۱,۲۳۷	۱۰۰,۶۶۴,۵۵۵,۰۷۱	۹۸,۹۱۳,۸۲۶,۳۰۷	۱,۷۵۰,۷۲۸,۷۶۴
ویتانا	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۹,۳۱۱,۳۱۵,۲۴۴	۲۳,۱۱۱,۲۲۸,۵۷۰	(۳,۷۹۹,۹۱۳,۳۲۶)	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۹,۳۱۱,۳۱۵,۲۴۵	۲۳,۵۳۵,۰۲۳,۴۸۲	(۴,۲۲۳,۷۰۸,۲۳۷)
مراجعه عام دولت-ش.خ.۰۲۰۲	۱۱۹,۵۰۰	۱۱۹,۴۱۳,۳۶۲,۵۰۰	۱۱۹,۳۸۵,۲۵۳,۵۷۷	۲۸,۱۰۸,۹۲۳	۱۱۹,۵۰۰	۱۱۹,۴۱۳,۳۶۲,۵۰۰	۱۱۹,۵۷۶,۵۵۳,۵۷۷	(۱۶۳,۱۹۱,۰۷۷)
جمع	۱۳۶,۸۷۲,۴۵۰	۱,۴۰۵,۱۶۰,۵۲۳,۰۷۳	۱,۳۹۰,۱۲۹,۴۸۵,۹۴۳	۱۵,۰۳۱,۰۳۷,۱۳۰	۱۳۶,۸۷۲,۴۵۰	۱,۴۰۵,۱۶۰,۵۲۳,۰۸۰	۱,۴۵۸,۶۴۲,۶۸۵,۸۲۶	(۵۳,۴۸۲,۱۶۲,۷۴۶)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۱-۲- 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	
۲.۲۷	(۸۳۶,۲۶۸,۹۵۴)	(۲,۵۸۶,۹۹۷,۷۱۷)	۱,۷۵۰,۷۲۸,۷۶۳	-	۱۲.۴۰	(۴,۵۶۱,۸۳۱,۴۱۸)	(۷,۶۵۵,۰۲۷,۶۳۵)	۳,۰۹۳,۱۹۶,۲۱۷	-	داروسازی سینا
۳۲.۸۳	(۱۲,۰۷۶,۲۵۲,۰۷۵)	(۱۲,۰۷۶,۲۵۲,۰۷۵)	-	-	(۷.۱۸)	۲,۶۴۱,۴۰۲,۲۵۰	۲,۶۴۱,۴۰۲,۲۵۰	-	-	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی
۷۵.۲۱	(۲۷,۶۶۲,۸۶۸,۲۸۳)	(۲۳,۴۳۹,۱۶۰,۰۴۶)	(۴,۲۲۳,۷۰۸,۲۳۷)	-	۱۰.۹۴	(۴,۰۲۴,۱۳۰,۲۶۶)	(۲۲۴,۲۱۶,۹۴۱)	(۳,۷۹۹,۹۱۳,۳۲۵)	-	وینتانا
۲۳.۸۰	(۸,۷۵۳,۸۴۶,۸۶۵)	(۸,۷۵۳,۸۴۶,۸۶۵)	-	-	۲۲.۶۱	(۸,۳۱۷,۵۹۳,۹۶۱)	(۸,۳۱۷,۵۹۳,۹۶۱)	-	-	ج‌وینتانا
۵۱.۱۶	(۱۸,۸۱۹,۲۱۴,۴۹۶)	(۷,۱۳۱,۳۵۹,۸۰۷)	(۱۱,۶۸۷,۸۵۴,۶۸۹)	-	۲۳.۶۰	(۸,۶۸۰,۱۵۲,۶۵۸)	(۱۴,۳۳۸,۰۸۶,۴۲۰)	۵,۶۵۷,۹۳۳,۷۶۲	-	بیمه سرمد
(۴۸.۱۸)	۱۷,۷۲۰,۵۷۹,۷۳۶	۳۷,۲۸۷,۴۵۷,۶۹۴	(۱۹,۵۶۶,۱۷۷,۹۵۸)	-	۶۱.۹۱	(۲۲,۷۷۰,۹۸۰,۷۷۱)	(۸,۷۸۳,۸۵۸,۳۴۳)	(۱۳,۹۸۷,۱۲۲,۴۲۸)	-	پاما
(۲۵.۸۹)	۹,۵۲۳,۳۵۸,۹۳۵	۱۴,۱۹۲,۲۴۶,۱۹۳	(۸,۰۲۹,۱۳۴,۶۴۰)	۳,۳۶۰,۲۴۷,۳۸۲	۲۹.۲۰	(۱۰,۷۴۲,۲۰۴,۹۶۹)	(۱۵۸,۱۶۷,۷۶۲)	(۱۳,۹۴۴,۲۸۴,۵۸۹)	۳,۳۶۰,۲۴۷,۳۸۲	سرمایه‌گذاری صنایع ایران
۵۱.۶۵	(۱۸,۹۹۸,۵۷۳,۹۶۱)	(۱۳,۰۵۵,۹۰۱,۴۳۰)	(۵,۹۴۲,۶۷۲,۵۳۱)	-	(۱۴.۲۶)	۵,۲۴۶,۱۷۸,۵۷۶	(۱۳,۷۵۵,۱۴۲,۴۲۵)	۱۹,۰۰۱,۳۲۱,۰۰۱	-	بیمه رازی
۴۰.۲۰	(۱۴,۷۸۸,۰۹۲,۲۱۲)	(۱,۶۶۵,۶۰۰,۰۳۳)	(۱۳,۱۲۲,۴۹۲,۱۷۹)	-	۱۵.۲۵	(۵,۶۱۰,۱۱۶,۹۱۹)	(۱,۷۲۲,۵۳۷,۸۰۵)	(۳,۸۸۷,۵۷۹,۱۱۴)	-	س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس
(۵۷.۹۷)	۲۱,۳۲۴,۶۳۶,۷۵۴	۱,۰۶۷,۱۰۵,۷۱۲	۸,۳۳۹,۹۲۱,۴۱۷	۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	(۳۱.۱۳)	۱۱,۴۵۰,۴۸۹,۶۷۳	۵۳۱,۱۶۸,۸۲۶	۱۰,۹۱۹,۳۲۰,۸۴۷	-	صندوق س. دارا الگوریتم-د
(۸.۴۹)	۳,۱۲۴,۰۳۴,۵۹۸	۳,۹۶۰,۹۱۶,۲۱۳	(۸۳۶,۸۸۱,۶۱۵)	-	(۳۱.۲۶)	۱۱,۴۹۹,۸۷۹,۴۱۷	(۴۵۰,۱۷۶,۴۲۳)	۱۱,۹۵۰,۰۵۵,۸۴۰	-	صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام
۱۳۷	(۵۰,۲۴۲,۵۰۶,۸۲۳)	(۱۲,۲۰۱,۳۹۲,۱۶۱)	(۵۳,۳۱۸,۹۷۱,۶۶۹)	۱۵,۲۷۷,۸۵۷,۰۰۷	۹۲.۰۸	(۳۲,۸۶۹,۰۶۱,۰۴۶)	(۵۲,۲۳۲,۲۳۶,۶۳۹)	۱۵,۰۰۲,۹۲۸,۲۱۱	۳,۳۶۰,۲۴۷,۳۸۲	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 ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	
۹,۱۶۱,۹۳۴	(۱۳,۸۰۵,۹۷۲)	-	۲۲,۹۶۷,۹۰۶	-	-	-	-	منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۸۲,۱۷۴,۱۳۴	۲۵,۵۰۸,۶۸۴	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	-	-	-	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۲,۹۶۲,۴۷۸,۲۷۷	(۴۹,۸۵۸,۹۲۳)	(۱۶۳,۱۹۱,۰۷۷)	۳,۱۷۵,۵۲۸,۲۷۷	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	(۲۸,۱۰۸,۹۲۳)	۲۸,۱۰۸,۹۲۳	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۳۰۲
۲,۱۵۳,۸۱۴,۳۴۵	(۳۸,۱۵۶,۲۱۱)	(۱۶۳,۱۹۱,۰۷۷)	۳,۳۵۵,۱۶۱,۶۳۳	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	(۲۸,۱۰۸,۹۲۳)	۲۸,۱۰۸,۹۲۳	۱,۸۹۵,۶۱۰,۲۴۵	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

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	۳,۲۸۶,۸۶۰	۱.۱۸	۹,۲۷۶,۹۳۰	۰.۹۶
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	۸۱۵,۲۸۱	۰.۲۹	۱,۹۹۰,۹۳۵	۰.۲۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	۸۱۵,۳۵۷	۰.۲۹	۱,۹۶۲,۷۳۶	۰.۲۰
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	۸,۶۲۸,۰۸۲	۳.۱۰	۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵	۳۵.۸۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	۸۲۱,۹۱۸	۰.۳۰	۳,۰۵۵,۸۷۴	۰.۳۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	۸۱۹,۲۱۱	۰.۲۹	۱,۷۸۴,۰۰۵	۰.۱۸
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	۸۱۹,۸۶۳	۰.۲۹	۳۳۹,۲۲۴,۶۵۷	۳۵.۰۶
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	۲۲۰,۰۶۳,۷۲۳	۷۹.۰۳	۲۲۰,۸۳۹,۵۶۴	۲۲.۸۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۱	۴۱,۵۴۹,۵۰۲	۱۴.۹۲	۴۱,۵۴۹,۵۰۲	۴.۲۹
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۲	۸۲۱,۵۶۶	۰.۳۰	۸۲۱,۵۶۶	۰.۰۸
جمع		۲۷۸,۴۴۱,۳۶۳	۱۰۰	۹۶۷,۵۴۷,۵۴۴	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۱۱/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۸,۹۰۷,۸۱۸,۴۸۹	۱,۲۳۲,۵۸۰,۰۰۵	کارمزد بازارگردانی صندوق های سرمایه گذاری
۴۳۰,۰۵۴,۱۸۰	۱۸,۷۷۳,۱۸۱	سایر درآمدها
۹,۳۳۷,۸۷۲,۶۶۹	۱,۲۵۱,۳۵۳,۱۸۶	جمع