



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

درصد به کل دارایی‌های صندوق	۱۳۹۹/۱۲/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۱۱/۳۰			نام شرکت
	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				
۱۹.۲۰	۳۳۹,۰۱۸,۱۹۷,۸۷۴	۳۶۶,۸۰۰,۱۱۴,۱۶۰	۲۵,۲۹۰	۱۳,۴۱۵,۴۲۳	۱۰,۵۱۲,۸۴۹,۷۱۲	(۴۱۵,۸۱۴)	۲۷۹,۲۵۴,۷۶۴,۱۶۰	۱۰,۴۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۶۶۴,۵۵۵,۰۷۰	۹۸,۹۱۴,۴۰۰,۵۸۴	۳,۴۳۱,۲۲۷	داروسازی سینا
۱۰.۸	۱۹۰,۶۵۱,۱۵۱,۷۷۹	۲۳,۵۳۵,۰۱۹,۱۷۲	۱۸,۲۷۸	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۹,۳۱۱,۳۱۵,۲۴۵	۲۳,۵۳۵,۰۱۹,۱۷۲	۱,۰۵۲,۳۲۶	وینانا
۹.۲۰	۱۶۲,۴۰۸,۴۷۱,۳۶۶	۱۸۳,۸۸۸,۸۱۶,۱۸۲	۶,۳۰۲	۲۵,۷۹۰,۵۴۲	۲۸,۳۷۱,۵۶۲,۹۳۵	(۴,۱۸۰,۸۱۹)	۱۰۲,۱۱۶,۱۰۱,۱۱۲	۱۵,۳۵۲,۰۱۹	۱۰۱,۲۴۹,۶۵۱,۱۴۱	۱۱۲,۹۳۷,۵۰۵,۸۳۰	۱۴,۶۱۹,۳۳۲	بیمه سرمد
۷.۰۶	۱۲۴,۶۶۲,۴۴۸,۷۷۹	۱۵۲,۵۲۷,۹۰۶,۹۴۱	۱۳,۴۲۰	۹,۲۹۶,۴۴۳	۲۵,۷۶۸,۲۵۸,۶۴۳	(۱,۹۰۱,۵۶۹)	۷۰,۱۹۷,۲۷۶,۱۱۵	۴,۹۹۲,۴۷۸	۹۴,۱۹۰,۴۲۲,۲۹۳	۱۱۳,۷۵۷,۳۰۰,۲۵۲	۶,۲۰۵,۵۳۴	باما
۲.۸۰	۴۹,۴۰۰,۴۱۱,۲۵۲	۴۶,۵۵۶,۹۷۷,۲۵۳	۱۲,۲۶۰	۴,۰۲۲,۴۶۲	۸۳,۳۱۹,۰۰۶,۰۸۶	(۷,۴۳۱,۹۰۶)	۴۰,۶۱۷,۶۹۶,۱۵۲	۳,۶۷۵,۹۵۹	۸۳,۹۷۳,۰۶۵,۰۴۱	۹۲,۰۰۲,۱۹۹,۶۸۱	۷,۷۸۸,۴۰۹	سرمایه‌گذاری صنایع ایران
۳.۰۰	۵۲,۹۶۳,۲۶۹,۱۶۴	۵۷,۳۱۱,۳۳۳,۲۳۶	۸,۶۴۳	۶,۱۳۲,۵۴۱	۳۹,۵۵۳,۵۵۶,۲۴۱	(۴,۶۳۲,۵۳۵)	۴۸,۳۷۱,۰۹۲,۷۶۶	۵,۶۹۲,۷۱۲	۴۷,۱۸۵,۸۴۲,۸۷۶	۵۳,۱۲۸,۵۱۵,۴۰۸	۵,۰۶۲,۳۶۴	بیمه رازی
۳.۸۵	۶۷,۹۱۲,۲۷۵,۰۶۳	۸۲,۲۲۹,۳۷۴,۱۲۹	۳,۰۱۳	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۶۹,۱۰۶,۸۸۱,۹۵۹	۸۲,۲۲۹,۳۷۴,۱۲۹	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس
۳۹.۲۹	۶۹۳,۶۶۶,۵۷۴,۱۱۸	۶۹۴,۰۱۲,۱۰۳,۰۵۱	۱۰,۰۱۱	۶۹,۳۹۱,۹۹۷	۳۰۰,۲۸۵,۶۶۰,۸۱۸	(۲۹,۹۷۸,۲۸۴)	۳۳۳,۹۶۹,۸۲۶,۹۶۸	۳۳,۳۳۳,۴۳۹	۶۶۸,۵۸۴,۵۳۴,۳۸۹	۶۶۰,۲۴۴,۶۱۲,۹۷۸	۶۵,۹۳۶,۸۴۲	صندوق س. دارا الگوریتم
۳.۲۳	۵۷,۱۰۰,۴۳۵,۴۲۵	۵۶,۴۶۴,۱۰۶,۱۳۳	۱۰,۰۲۰	۵,۷۰۰,۰۰۰	۸۸,۹۰۳,۳۳۳,۴۸۸	(۹,۲۶۵,۴۴۸)	۴۶,۱۸۰,۸۱۵,۱۸۸	۴,۸۶۵,۴۴۸	۱۰۱,۴۸۰,۸۹۲,۵۶۳	۱۰۲,۳۱۷,۹۲۱,۴۴۷	۱۰,۱۰۰,۰۰۰	صندوق س ارزش آفرین بیدار
۸۸.۷۱	۱,۵۶۶,۱۹۸,۲۳۴,۸۲۰	۱,۶۶۲,۳۳۵,۷۵۰,۳۶۷	-	۱۵۷,۲۶۸,۶۳۰	۵۷۶,۷۱۴,۲۸۲,۹۲۳	(۵۷,۷۹۶,۳۷۵)	۹۲۰,۷۰۷,۵۷۲,۴۶۱	۷۸,۳۱۲,۰۵۵	۱,۲۸۵,۷۴۷,۱۶۰,۵۷۷	۱,۳۳۹,۰۶۶,۸۴۹,۴۹۱	۱۳۶,۷۵۲,۹۵۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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

درصد به کل دارایی‌های صندوق	۱۳۹۹/۱۲/۳۰		تغییرات طی دوره						۱۳۹۹/۱۱/۳۰		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت							
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	تاریخ انتشار	تاریخ سررسید	نرخ سود	نرخ موثر	بورسی یا فراپورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد										
۳.۷۴	۶۵,۹۴۷,۶۴۵,۹۱۷	۶۴,۵۴۲,۶۴۹,۴۵۶	۱,۰۱۶,۸۷۲	۶۴,۵۰۰	۵۴,۹۶۰,۱۲۵,۰۰۰	۵۵,۰۰۰	۰	۰	۱۲۹,۰۳۲,۹۱۶,۵۹۷	۱۱۹,۵۷۹,۰۱۷,۲۱۰	۱۱۹,۵۰۰	۱۳۹۹/۰۶/۱۶	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	۱۸	۱۸	بله	بله	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۰۳۰۲
۳.۷۴	۶۵,۹۴۷,۶۴۵,۹۱۷	۶۴,۵۴۲,۶۴۹,۴۵۶	-	۶۴,۵۰۰	۵۴,۹۶۰,۱۲۵,۰۰۰	۵۵,۰۰۰	۰	۰	۱۲۹,۰۳۲,۹۱۶,۵۹۷	۱۱۹,۵۷۹,۰۱۷,۲۱۰	۱۱۹,۵۰۰							جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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 ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	۰	-	۰	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	-	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۴,۳۷۶,۰۳۰,۸۵۳	-	۴,۳۷۶,۰۳۰,۸۵۳	۱,۲۰۰,۵۰۲,۵۷۶	-	۱,۲۰۰,۵۰۲,۵۷۶	۱۸	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	-	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ ۰۳۰۲
۱۰,۰۹۸,۸۴۸	-	۱۰,۰۹۸,۸۴۸	۸۲۱,۹۱۸	-	۸۲۱,۹۱۸	۱۰	-	۱۹م	بانک سامان سی تیر
۲,۸۰۶,۲۱۶	-	۲,۸۰۶,۲۱۶	۸۱۵,۲۸۱	-	۸۱۵,۲۸۱	۱۰	-	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۱,۹۶۸,۹۰۰	-	۱,۹۶۸,۹۰۰	۶,۱۶۴	-	۶,۱۶۴	۱۰	-	۱۴م	بانک سامان سی تیر
۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵	-	۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵	۰	-	۰	۱۰	-	۲۹م	بانک سامان سی تیر
۳,۰۵۵,۸۷۴	-	۳,۰۵۵,۸۷۴	۰	-	۰	۱۰	-	۲۹م	بانک سامان سی تیر
۱,۷۸۴,۰۰۵	-	۱,۷۸۴,۰۰۵	۰	-	۰	۱۰	-	۲۸م	بانک سامان سی تیر
۳۴۰,۰۴۴,۵۲۰	-	۳۴۰,۰۴۴,۵۲۰	۸۱۹,۸۶۳	-	۸۱۹,۸۶۳	۱۰	-	۵م	بانک سامان سی تیر
۲۲۱,۶۵۷,۳۷۲	-	۲۲۱,۶۵۷,۳۷۲	۸۱۷,۸۰۸	-	۸۱۷,۸۰۸	۱۰	-	۵م	بانک سامان سی تیر
۴۲,۷۸۱,۳۶۱	-	۴۲,۷۸۱,۳۶۱	۱,۲۳۱,۸۵۹	-	۱,۲۳۱,۸۵۹	۱۰	-	۲م	بانک سامان سی تیر
۱,۳۸۸,۹۹۹	-	۱,۳۸۸,۹۹۹	۵۶۷,۴۳۳	-	۵۶۷,۴۳۳	۱۰	-	۱۰م	بانک سامان سی تیر
۵,۵۲۸,۲۹۲,۰۷۹	-	۵,۵۲۸,۲۹۲,۰۷۹	۱,۲۰۵,۵۸۲,۹۰۲	-	۱,۲۰۵,۵۸۲,۹۰۲				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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	(۹۲,۵۵۵,۷۸۰,۷۸۵)	۱۲۰.۵۱	(۵.۲۴)
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۵,۴۴۱,۷۷۱,۹۴۴	(۷.۰۹)	۰.۳۱
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۹۷۲,۶۲۷,۸۷۰	(۱.۲۷)	۰.۰۶
سایر درآمدها	۴-۲	۹,۳۳۹,۱۵۱,۶۴۶	(۱۲.۱۶)	۰.۵۳
جمع		(۷۶,۸۰۲,۲۲۹,۳۲۵)	۱۰۰	(۴.۳۵)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

درآمد سود سهام و سود صندوق سرمایه‌گذاری:

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه		اطلاعات مجمع					
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	نام سهام
۳,۴۲۰,۹۰۱,۶۶۷	۴۷۳,۳۰۲,۸۳۳	۳,۸۹۴,۲۰۴,۵۰۰	۰	۰	۰	۵۰۰	۷,۷۸۸,۴۰۹	۱۳۹۹/۱۱/۲۸	سرمایه گذاری صنایع ایران
۳۳,۰۸۵,۸۹۶,۶۷۵	-	۳۳,۰۸۵,۸۹۶,۶۷۵	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰	۰	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰	-	-	-	صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم-درآمد ثابت
۳۶,۵۰۶,۷۹۸,۳۴۲	۴۷۳,۳۰۲,۸۳۳	۳۶,۹۸۰,۱۰۱,۱۷۵	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰	-	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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
داروسازی سینا	۴۱۵,۸۱۴	۱۰,۵۱۲,۸۴۹,۷۱۲	۱۱,۳۶۹,۰۳۳,۳۱۹	(۸۵۶,۱۸۳,۶۰۷)	۱۵,۹۵۷,۳۷۸	۴۶۷,۹۲۹,۱۶۸,۱۲۴	۴۷۱,۳۷۲,۳۴۹,۴۴۸
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	-	-	-	-	۷,۰۷۰,۶۲۳	۳۱۲,۵۵۳,۸۱۰,۶۶۵	۳۲۴,۶۳۰,۰۶۲,۷۴۰
ویتانا	-	-	-	-	۱۱,۲۵۹,۸۵۱	۵۱۶,۱۴۴,۲۹۱,۴۲۲	۵۳۹,۵۸۳,۴۵۱,۴۶۸
ح.ویتانا	-	-	-	-	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۰,۲۴۵,۵۰۴,۳۸۷	۲۸,۹۹۹,۳۵۱,۱۵۲
بیمه سرمد	۴,۱۸۰,۸۱۹	۲۸,۳۷۱,۵۶۳,۹۳۵	۳۱,۱۶۴,۷۹۰,۷۶۰	(۲,۷۹۳,۲۲۶,۸۲۵)	۴۴,۰۱۷,۹۱۹	۳۱۳,۸۰۴,۴۸۱,۰۹۶	۳۳۳,۷۲۹,۰۶۷,۷۲۸
باما	۱,۹۰۱,۵۶۹	۲۵,۷۶۸,۲۵۸,۶۴۳	۳۱,۴۱۶,۶۶۹,۴۲۶	(۵,۶۴۸,۴۱۰,۷۸۳)	۱۰,۷۲۶,۰۲۰	۴۵۹,۷۳۷,۷۳۸,۶۶۱	۴۲۸,۰۹۸,۶۹۱,۷۵۰
سرمایه گذاری صنایع ایران	۷,۴۳۱,۹۰۶	۸۳,۳۱۹,۰۶۰,۰۸۶	۸۶,۰۶۲,۹۱۸,۵۸۰	(۲,۷۴۳,۸۵۸,۴۹۴)	۱۹,۸۷۷,۴۲۴	۲۱۳,۸۲۰,۴۱۱,۳۹۷	۲۰۲,۳۷۲,۰۲۳,۶۹۸
بیمه رازی	۴,۶۲۲,۵۳۵	۳۹,۵۵۳,۵۵۶,۲۴۱	۴۴,۱۸۸,۲۷۴,۹۳۸	(۴,۶۳۴,۷۱۸,۶۹۷)	۱۵,۸۴۳,۵۲۹	۱۵۶,۸۶۳,۲۳۰,۵۶۳	۱۷۴,۵۵۳,۸۵۰,۶۹۰
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	-	-	-	-	۴۵,۶۳۰,۹۷۱	۱۷۵,۴۱۴,۰۱۷,۰۹۸	۱۷۷,۰۷۹,۶۱۷,۱۳۱
صندوق س. دارا الگوریتم	۲۹,۹۷۸,۲۸۴	۳۰۰,۲۸۵,۶۶۰,۸۱۸	۳۰۰,۲۰۲,۳۳۶,۸۹۵	۸۳,۳۳۳,۹۲۳	۴۵۱,۰۷۰,۵۶۱	۴,۵۲۰,۲۲۶,۳۱۳,۴۵۲	۴,۵۱۹,۰۷۵,۸۸۳,۸۱۷
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۹,۲۶۵,۴۴۸	۸۸,۹۰۳,۳۳۳,۴۸۸	۹۲,۰۳۴,۵۳۲,۴۹۰	(۳,۱۳۱,۱۹۹,۰۰۲)	۶۲,۳۸۷,۶۱۰	۶۶۰,۰۶۲,۹۹۶,۰۱۴	۶۵۹,۲۳۳,۲۷۸,۸۰۳
منفعت صبا ارونند لوتوس ۱۴۰۰۱۲۲۲	-	-	-	-	۱,۰۰۰	۹۹۱,۳۴۷,۷۶۲	۱,۰۰۵,۱۵۳,۷۳۴
منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲	-	-	-	-	۶,۴۰۱	۶,۲۶۲,۰۳۵,۷۳۳	۶,۲۳۶,۵۲۷,۰۴۹
مراجعه عام دولت ۵-ش-خ ۳۰۲	۵۵,۰۰۰	۵۴,۹۶۰,۱۲۵,۰۰۰	۵۵,۰۳۵,۲۳۳,۸۶۵	(۷۵,۱۰۸,۸۶۵)	۸۸,۵۰۰	۸۸,۴۳۵,۸۳۷,۵۰۰	۸۸,۵۶۰,۸۰۵,۲۸۸
جمع	۵۷,۸۵۱,۳۷۵	۶۳۱,۶۷۴,۴۰۷,۹۲۳	۶۵۱,۴۷۳,۷۹۰,۲۷۲	(۱۹,۷۹۹,۳۸۲,۲۵۰)	۶۸۵,۴۰۷,۷۴۶	۷,۹۱۲,۴۹۱,۱۸۳,۷۷۴	۷,۹۴۴,۵۳۰,۱۱۴,۴۹۶

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم اوراق 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 ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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
داروسازی سینا	۱۳,۴۱۵,۴۲۳	۳۳۹,۰۱۸,۱۹۷,۸۷۴	۳۶۸,۵۵۰,۲۸۵,۹۱۱	(۲۹,۵۳۲,۰۸۸,۰۳۷)	۱۳,۴۱۵,۴۲۳	۳۳۹,۰۱۸,۱۹۷,۸۷۴	۳۶۶,۷۹۹,۵۵۷,۱۴۸	(۲۷,۷۸۱,۳۵۹,۲۷۴)
ویتانا	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۹,۰۶۵,۱۵۱,۷۷۹	۱۹,۳۱۱,۳۱۵,۲۴۴	(۲۴۶,۱۶۳,۴۶۵)	۱,۰۵۲,۳۲۶	۱۹,۰۶۵,۱۵۱,۷۷۹	۲۳,۵۳۵,۰۲۳,۴۸۲	(۴,۴۶۹,۸۷۱,۷۰۳)
بیمه سرمد	۲۵,۷۹۰,۵۴۲	۱۶۲,۴۰۸,۴۷۱,۳۶۷	۱۷۲,۲۰۰,۹۶۱,۴۹۲	(۹,۷۹۲,۴۹۰,۱۲۵)	۲۵,۷۹۰,۵۴۲	۱۶۲,۴۰۸,۴۷۱,۳۶۷	۱۸۳,۸۸۸,۸۱۶,۱۸۲	(۲۱,۴۸۰,۳۴۴,۸۱۵)
باما	۹,۲۹۶,۴۴۳	۱۲۴,۶۶۳,۴۴۸,۷۷۹	۱۳۲,۹۷۱,۰۲۸,۹۸۲	(۸,۳۰۷,۵۸۰,۲۰۳)	۹,۲۹۶,۴۴۳	۱۲۴,۶۶۳,۴۴۸,۷۷۹	۱۵۲,۵۳۷,۹۰۶,۹۴۱	(۲۷,۸۷۴,۴۵۸,۱۶۲)
سرمایه گذاری صنایع ایران	۴,۰۳۲,۴۶۲	۴۹,۴۰۰,۴۱۱,۲۵۲	۳۸,۵۲۷,۸۴۲,۶۱۲	۱۰,۸۷۲,۵۶۸,۶۴۰	۴,۰۳۲,۴۶۲	۴۹,۴۰۰,۴۱۱,۲۵۲	۴۶,۵۵۶,۹۷۷,۲۵۳	۲,۸۴۳,۴۳۳,۹۹۹
بیمه رازی	۶,۱۳۲,۵۴۱	۵۲,۹۶۳,۲۶۹,۱۶۴	۵۱,۳۶۸,۶۶۰,۷۰۴	۱,۵۹۴,۶۰۸,۴۶۰	۶,۱۳۲,۵۴۱	۵۲,۹۶۳,۲۶۹,۱۶۴	۵۷,۳۱۱,۳۳۳,۳۳۶	(۴,۳۴۸,۰۶۴,۰۷۲)
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۶۷,۹۱۲,۲۷۵,۰۶۳	۶۹,۱۰۶,۸۸۱,۹۵۹	(۱,۱۹۴,۶۰۶,۸۹۶)	۲۲,۵۵۶,۸۹۶	۶۷,۹۱۲,۲۷۵,۰۶۳	۶۷,۹۱۲,۲۷۵,۰۶۳	(۱۴,۳۱۷,۰۹۹,۰۷۶)
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۶۹,۲۹۱,۹۹۷	۶۹۳,۶۶۶,۵۷۴,۱۱۸	۷۰۲,۳۵۲,۰۲۴,۴۶۲	(۸,۶۸۵,۴۵۰,۳۴۴)	۶۹,۲۹۱,۹۹۷	۶۹۳,۶۶۶,۵۷۴,۱۱۸	۶۹۴,۰۱۲,۱۰۳,۰۴۵	(۳۴۵,۵۲۸,۹۲۷)
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۵,۷۰۰,۰۰۰	۵۷,۱۰۰,۴۳۵,۴۲۵	۵۵,۶۲۷,۱۷۵,۲۶۰	۱,۴۷۳,۲۶۰,۱۶۵	۵,۷۰۰,۰۰۰	۵۷,۱۰۰,۴۳۵,۴۲۵	۵۶,۴۶۴,۰۵۶,۸۷۶	۶۳۶,۳۷۸,۵۴۹
مراجعه عام دولت-ش.خ-۰۳۰۲	۶۴,۵۰۰	۶۵,۵۴۰,۶۹۲,۵۲۳	۶۴,۳۷۸,۱۲۸,۶۳۵	۱,۱۶۲,۵۶۳,۸۸۸	۶۴,۵۰۰	۶۵,۵۴۰,۶۹۲,۵۲۳	۶۴,۵۴۱,۳۱۹,۷۱۲	۹۹۹,۳۷۲,۸۱۱
جمع	۱۵۷,۳۳۳,۱۳۰	۱,۶۳۱,۷۳۸,۹۲۷,۳۴۴	۱,۶۷۴,۳۹۴,۳۰۵,۲۶۱	(۴۲,۶۵۵,۳۷۷,۹۱۷)	۱۵۷,۳۳۳,۱۳۰	۱,۶۳۱,۷۳۸,۹۲۷,۳۴۴	۱,۷۲۷,۸۷۶,۴۶۸,۰۱۴	(۹۶,۱۳۷,۵۴۰,۶۷۰)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۲-۱- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری 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
داروسازی سینا	-	(۲۹,۵۳۲,۰۸۸,۰۳۷)	(۸۵۶,۱۸۳,۶۰۷)	(۳۰,۳۸۸,۲۷۱,۶۴۴)	-	۳۹,۵۷	(۳,۴۴۳,۱۸۱,۳۲۴)	(۳۱,۲۲۴,۵۴۰,۵۹۸)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	-	-	-	-	-	-	(۱۲,۰۷۶,۲۵۲,۰۷۵)	(۱۲,۰۷۶,۲۵۲,۰۷۵)
ویتانا	-	(۲۴۶,۱۶۳,۴۶۵)	-	(۲۴۶,۱۶۳,۴۶۵)	-	۰,۳۲	(۲۷,۹۰۹,۰۳۱,۷۴۹)	(۲۷,۹۰۹,۰۳۱,۷۴۹)
ح.ویتانا	-	-	-	-	-	-	(۸,۷۵۳,۸۴۶,۸۶۵)	(۸,۷۵۳,۸۴۶,۸۶۵)
بیمه سرمد	-	(۹,۷۹۲,۴۹۰,۱۲۵)	(۲,۷۹۳,۲۲۶,۸۲۵)	(۱۲,۵۸۵,۷۱۶,۹۵۰)	-	۱۶,۳۹	(۳۱,۴۰۴,۹۳۱,۴۴۷)	(۳۱,۴۰۴,۹۳۱,۴۴۷)
باما	-	(۸,۳۰۷,۵۸۰,۲۰۳)	(۵,۶۴۸,۴۱۰,۷۸۳)	(۱۳,۹۵۵,۹۹۰,۹۸۶)	-	۱۸,۱۷	۳,۷۶۴,۵۸۸,۷۴۹	(۴,۹۰۰)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	-	۱۰,۸۷۲,۵۶۸,۶۴۰	(۲,۷۴۳,۸۵۸,۴۹۴)	۸,۱۲۸,۷۱۰,۱۴۶	(۱۰,۵۸)	۳,۴۲۰,۹۰۱,۶۶۷	۱۷,۷۱۲,۷۲۳,۳۶۵	(۲۳,۰۶)
بیمه رازی	-	۱,۵۹۴,۶۰۸,۴۶۰	(۴,۶۳۴,۷۱۸,۶۹۷)	(۳,۰۴۰,۱۱۰,۳۳۷)	-	۳,۹۶	(۲۲,۰۳۸,۶۸۴,۱۹۹)	(۲۲,۰۳۸,۶۸۴,۱۹۹)
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	-	(۱,۱۹۴,۶۰۶,۸۹۶)	-	(۱,۱۹۴,۶۰۶,۸۹۶)	-	۱,۵۶	(۱۵,۹۸۲,۶۹۹,۱۰۹)	(۱۵,۹۸۲,۶۹۹,۱۰۹)
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰	(۸,۶۸۵,۴۵۰,۳۴۴)	۸۳,۳۲۳,۹۲۳	۱۲,۵۶۶,۱۶۰,۶۲۹	(۱۶,۳۶)	۳۳,۰۸۵,۸۹۶,۶۷۵	۳۳,۸۹۰,۷۹۷,۳۸۳	(۴۴,۱۳)
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	-	۱,۴۷۳,۲۶۰,۱۶۵	(۳,۱۳۱,۱۹۹,۰۰۲)	(۱,۶۵۷,۹۳۸,۸۳۷)	-	۲,۱۶	۱,۴۶۶,۰۹۵,۷۶۰	(۱,۹۱)
جمع	۲۱,۱۶۸,۲۸۷,۰۵۰	(۴۳,۸۱۷,۹۴۱,۸۰۵)	(۱۹,۷۲۴,۲۷۳,۴۸۵)	(۴۲,۳۷۳,۹۲۸,۲۴۰)	۵۵,۱۷	۳۶,۵۰۶,۷۹۸,۳۴۲	(۹۲,۵۵۵,۷۸۰,۷۸۵)	۱۲۱

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 ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

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 ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۱۸۲,۱۷۴,۱۳۴	۲۵,۵۰۸,۶۸۴	-	۱۵۶,۶۶۵,۴۵۰	-	-	-	-	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰/۱۲/۲۲
۵,۲۵۰,۴۳۵,۸۷۶	(۱۲۴,۹۶۷,۷۸۸)	۹۹۹,۳۷۲,۸۱۱	۴,۳۷۶,۰۳۰,۸۵۳	۲,۲۸۷,۹۵۷,۵۹۹	(۷۵,۱۰۸,۸۶۵)	۱,۱۶۲,۵۶۳,۸۸۸	۱,۲۰۰,۵۰۲,۵۷۶	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۰۳۰۲
۵,۴۴۱,۷۷۱,۹۴۴	(۱۱۳,۲۶۵,۰۷۶)	۹۹۹,۳۷۲,۸۱۱	۴,۵۵۵,۶۶۴,۲۰۹	۲,۲۸۷,۹۵۷,۵۹۹	(۷۵,۱۰۸,۸۶۵)	۱,۱۶۲,۵۶۳,۸۸۸	۱,۲۰۰,۵۰۲,۵۷۶	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۲-۳- در آمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی:

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی	شماره حساب	نام سپرده
۱.۰۴	۱۰,۰۹۸,۸۴۸	۱۶.۱۸	۸۲۱,۹۱۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۰.۲۹	۲,۸۰۶,۲۱۶	۱۶.۰۵	۸۱۵,۲۸۱	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۰.۲۰	۱,۹۶۸,۹۰۰	۰.۱۲	۶,۱۶۴	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۳۵.۶۸	۳۴۷,۰۴۱,۷۷۵	۰.۰۰	۰	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۰.۳۱	۳,۰۵۵,۸۷۴	۰.۰۰	۰	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	بانک سامان سی تیر
۰.۱۸	۱,۷۸۴,۰۰۵	۰.۰۰	۰	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	بانک سامان سی تیر
۳۴.۹۶	۳۴۰,۰۴۴,۵۲۰	۱۶.۱۴	۸۱۹,۸۶۳	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	بانک سامان سی تیر
۲۲.۷۹	۲۲۱,۶۵۷,۳۷۲	۱۶.۱۰	۸۱۷,۸۰۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	بانک سامان سی تیر
۴.۴۰	۴۲,۷۸۱,۳۶۱	۲۴.۲۵	۱,۲۳۱,۸۵۹	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۱	بانک سامان سی تیر
۰.۱۴	۱,۳۸۸,۹۹۹	۱۱.۱۷	۵۶۷,۴۳۳	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۲	بانک سامان سی تیر
۱۰۰	۹۷۲,۶۲۷,۸۷۰	۱۰۰	۵,۰۸۰,۳۲۶		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۱۲/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۸,۹۰۷,۸۱۸,۴۸۹	.	کارمزد بازارگردانی صندوق های سرمایه گذاری
۴۳۱,۳۳۳,۱۵۷	۱,۲۷۸,۹۷۷	سایر درآمدها
۹,۳۳۹,۱۵۱,۶۴۶	۱,۲۷۸,۹۷۷	جمع