



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۹/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۱۰/۳۰				
	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی دوره		خرید طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش		
				تعداد	مبلغ فروش	بهای تمام شده	تعداد					
داروسازی سینا	۲,۴۴۱,۳۸۲	۷۵,۱۲۹,۷۹۷,۸۱۴	۷۱,۹۸۷,۴۷۹,۷۲۳	۶,۳۷۰,۵۸۰	۱۹۶,۳۸۱,۳۶۴,۳۶۷	(۴,۵۴۷,۵۴۲)	۱۴۴,۹۵۳,۹۷۶,۸۵۶	۲,۴۴۱,۳۸۲	۳۰,۶۰۰	۱۳۱,۷۳۳,۰۹۵,۳۵۱	۱۳,۳۸۹,۰۲۰,۹۷۴	۸,۹۷
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۹۰۶,۰۲۷	۴۰,۴۳۵,۸۶۳,۶۸۳	۳۷,۴۳۸,۴۵۹,۶۶۰	۲۰,۹۳۱,۷۰۰	۹۳,۸۵۵,۸۴۹,۷۱۶	(۲,۳۲۸,۶۳۹)	۱۰۲,۱۱۰,۶۳۰,۱۹۲	۹۰۶,۰۲۷	۴۲,۴۲۲	۳۱,۱۶۵,۴۶۱,۲۰۱	۲۸,۴۲۴,۷۹۲,۲۰۳	۱,۹۶
ویانا	۱,۲۶۴,۵۲۲	۶۵,۶۴۱,۸۱۳,۴۶۶	۶۱,۸۱۳,۱۱۶,۳۹۹	۲,۴۷۵,۸۶۶	۱۳۵,۷۷۶,۳۲۹,۸۲۵	(۲,۵۶۶,۰۴۰)	۱۴۲,۹۳۲,۸۴۲,۸۹۱	۱,۲۶۴,۵۲۲	۲۰,۴۴۶	۲۹,۳۱۱,۵۸۳,۳۴۷	۲۸,۸۸۷,۸۳۴,۲۶۲	۱,۹۹
ح‌وینانا	.	.	.	۱,۴۶۹,۹۵۹	.	.	.	۱,۴۶۹,۹۵۹	۱۹,۴۴۶	۲۸,۹۹۹,۳۵۱,۱۵۲	۲۸,۵۶۳,۰۹۸,۳۴۹	۱,۹۷
بیمه سرمد	۴,۸۳۵,۰۱۰	۲۷,۰۹۰,۲۲۴,۷۹۷	۳۹,۰۱۳,۰۳۳,۲۹۳	۲۰,۶۹۹,۹۴۳	۱۷۹,۶۶۶,۰۳۹,۷۹۵	(۱۰,۲۰۴,۶۶۹)	۸۸,۴۹۴,۰۳۴,۱۶۸	۴,۸۳۵,۰۱۰	۷,۴۶۵	۱۳۱,۶۹۹,۳۸۳,۶۷۸	۱۱۴,۳۵۳,۵۹۵,۲۲۷	۷,۸۷
یاما	۶,۲۶۲,۳۹۰	۱۱۲,۱۶۹,۲۵۳,۵۸۴	۱۳۳,۶۶۲,۹۸۹,۲۶۵	۳,۳۳۸,۵۰۰	۷۲,۵۹۱,۵۲۶,۶۲۹	(۴,۰۷۱,۵۰۰)	۹۹,۴۷۹,۹۸۵,۵۸۲	۶,۲۶۲,۳۹۰	۱۹,۱۵۰	۱۰۹,۴۷۳,۵۵۴,۶۸۷	۱۰۲,۸۹۳,۷۹۹,۱۵۸	۷,۱۵
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲,۷۲۹,۴۷۹	۲۳,۸۴۶,۱۹۱,۴۳۰	۲۹,۴۱۵,۰۵۸,۵۶۷	۴,۸۸۰,۱۵۷	۵۶,۳۹۳,۸۹۵,۰۱۵	(۴,۷۴۷,۷۷۳)	۵۷,۹۷۷,۱۱۷,۵۸۶	۲,۷۲۹,۴۷۹	۱۳,۴۷۲	۲۲,۶۱۰,۵۶۶,۵۷۳	۲۸,۵۲۵,۷۱۶,۵۲۲	۲,۶۵
بیمه رازی	۲,۴۸۰,۷۳۹	۲۲,۹۷۷,۷۷۶,۸۳۹	۳۵,۴۶۰,۰۰۱,۲۹۶	۷,۳۵۷,۸۴۸	۸۲,۰۸۶,۲۲۳,۵۹۸	(۱,۱۵۸,۱۰۱)	۱۴,۳۷۴,۷۶۷,۶۰۳	۲,۴۸۰,۷۳۹	۸,۶۴۹	۹۹,۹۶۴,۴۵۸,۰۲۹	۷۵,۰۲۰,۴۶۴,۴۹۶	۵,۱۶
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۱۷,۸۴۲,۵۴۱	۷۰,۱۷۷,۰۶۳,۴۷۱	۶۶,۱۰۹,۸۶۰,۳۲۰	۳۶,۱۵۸,۱۱۱	۱۳۳,۹۳۹,۳۰۴,۳۶۳	(۲۹,۳۵۱,۵۶۳)	۱۱۲,۱۸۲,۲۸۲,۶۳۶	۱۷,۸۴۲,۵۴۱	۳,۳۱۰	۹۰,۷۶۱,۳۹۰,۴۰۶	۸۱,۵۲۶,۲۷۷,۳۴۲	۵,۶۱
صندوق س. دارا الگوریتم	۴,۹۵۳,۰۳۹	۴۹,۸۱۰,۳۲۳,۳۷۷	۴۹,۹۷۵,۰۳۹,۰۴۶	۷۶,۷۳۷,۸۸۱	۷۶,۵۶۳,۰۱۹,۲۷۷	(۳۱,۵۵۵,۴۷۳)	۳۱۶,۷۴۴,۴۳۳,۶۷۰	۴,۹۵۳,۰۳۹	۵۰,۱۳۵,۴۴۷	۵۰,۱۸۶۷,۰۸۱,۸۸۴	۴۹۹,۲۸۷,۶۸۲,۴۴۷	۳۴,۳۵
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۲,۳۰۰,۰۰۰	۲۵,۹۸۳,۶۴۰,۵۳۷	۲۵,۲۷۰,۹۹۶,۷۱۲	۸,۱۳۲,۳۵۹	۸۲,۵۲۹,۸۲۵,۳۹۷	(۲,۴۱۰,۵۴۹)	۲۴۰,۱۵,۴۲۲,۹۸۸	۲,۳۰۰,۰۰۰	۸,۷۰۰	۸۳,۵۶۰,۸۲۳,۵۰۴	۶۹,۷۷۳,۱۷۱,۹۳۵	۴,۸۰
جمع	۴۶,۰۱۵,۰۴۹	۵۳۳,۲۶۱,۹۴۸,۹۹۸	۵۵۰,۱۴۶,۰۳۴,۲۸۱	۱۶۹,۶۱۴,۳۷۴	۱,۸۰۰,۷۸۳,۲۷۷,۹۸۲	(۹۳,۰۳۱,۸۴۹)	۱,۱۰۳,۲۶۵,۴۹۴,۱۷۲	۴۶,۰۱۵,۰۴۹	-	۱,۲۷۰,۱۴۶,۷۴۸,۸۱۲	۱,۱۹۸,۶۴۵,۶۵۲,۸۱۵	۸۲,۴۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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

درصد به کل دارایی‌های صندوق	۱۳۹۹/۱۰/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۹/۳۰			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	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فراپورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد										
۱۰.۱	۱۴۶,۸۵۱,۵۱۲,۳۹۵	۱۳۸,۰۹۱,۲۵۰,۰۰۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۸,۰۰۰	۱۴,۹۸۹,۱۲۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵۳,۱۰۲,۱۲۵,۰۰۰	۱۵۳,۰۰۰	۰	۰	۰	۱۸	۱۸	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	۱۳۹۹/۰۶/۱۶	بله	بله	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ ۰۳۰۲
۱۰.۱	۱۴۶,۸۵۱,۵۱۲,۳۹۵	۱۳۸,۰۹۱,۲۵۰,۰۰۰	-	۱۳۸,۰۰۰	۱۴,۹۸۹,۱۲۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۵۳,۱۰۲,۱۲۵,۰۰۰	۱۵۳,۰۰۰	۰	۰	۰							جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

سپرده	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۱۰/۳۰	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۱۲/۱۶	ماه شمار ۱۰٪	۵۸,۰۷۰,۵۸۶,۲۱۷	۴۰,۷۷۸,۲۴۹,۷۵۶	۷۳,۷۹۳,۶۲۳,۶۱۲	۲۵,۰۵۵,۲۱۲,۳۶۱
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۴,۲۶۲,۴۶۰,۲۴۵	۸۱۲,۶۶۳	۴,۱۶۴,۰۸۰,۴۰۵	۹۹,۱۹۲,۵۰۳
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۵/۱۴	ماه شمار ۱۰٪	۲۱,۰۹۲,۱۱۵,۹۳۱	۸۲۱,۹۱۸	۲۰,۹۹۳,۷۳۶,۰۹۱	۹۹,۲۰۱,۷۵۸
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۱۰/۳۰	ماه شمار ۱۰٪	۲۵۱,۳۲۱,۶۴۲,۴۴۶	۳۱,۷۳۰,۱۶۴,۹۱۸	۲۴۷,۴۷۸,۶۸۵,۱۷۷	۳۵,۵۷۳,۱۲۲,۱۸۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۴/۳۱	ماه شمار ۱۰٪	۳۴,۶۳۴,۷۰۵,۲۴۷	۱,۲۴۴,۹۱۴	۳۴,۴۸۳,۲۴۰,۶۸۷	۱۵۲,۷۰۹,۴۷۴
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	ماه شمار ۱۰٪	۲۷,۳۸۹,۳۳۸,۸۶۸	۷۱,۸۹۵,۷۸۱,۵۳۴	۹۹,۱۸۴,۹۶۴,۷۲۰	۱۰۰,۱۵۵,۶۸۲
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۹۴,۰۷۷,۳۰۱,۵۲۱	۱۰,۲۷۳,۶۳۶,۷۲۹	۱۰۴,۲۵۱,۱۸۸,۲۵۰	۹۹,۷۵۰,۰۰۰
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۸/۲۶	ماه شمار ۱۰٪	۴۶,۶۸۶,۸۴۶,۰۵۲	۵,۳۵۰,۲۰۷,۱۸۸	۲۵,۲۶۲,۶۳۳,۶۲۲	۲۶,۷۷۴,۴۱۹,۶۱۸
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۰۲	ماه شمار ۱۰٪	۴۴,۹۶۸,۶۳۷,۰۲۲	.	۳۵,۵۰۱,۹۹۵,۶۲۵	۹,۴۶۶,۶۴۱,۳۹۷
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱۲	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۹/۰۹/۱۱	ماه شمار ۱۰٪	۲۱,۱۱۱,۰۵۲,۶۵۷	۲۱۴,۱۸۲,۴۱۵	۲۱,۰۱۱,۰۵۲,۶۵۷	۳۱۴,۱۸۲,۴۱۵
جمع					۶۰۳,۶۱۴,۶۸۶,۲۰۶	۱۶۰,۲۴۵,۱۰۲,۰۳۵	۶۶۶,۱۲۵,۲۰۰,۸۴۶	۹۷,۷۳۴,۵۸۷,۳۹۵

درصد به کل دارایی‌ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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
۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	-	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	-	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	۱۸	۱۴۰۳/۰۲/۱۶	-	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ ۰۳۰۲
۵,۹۹۰,۰۷۰	-	۵,۹۹۰,۰۷۰	۵,۵۷۵,۶۷۲	-	۵,۵۷۵,۶۷۲	۱۰	-	م۱۹	بانک سامان سی تیر
۱,۱۷۵,۶۵۴	-	۱,۱۷۵,۶۵۴	۸۱۲,۶۶۳	-	۸۱۲,۶۶۳	۱۰	-	م۱۴	بانک سامان سی تیر
۱,۱۴۷,۳۷۹	-	۱,۱۴۷,۳۷۹	۸۲۱,۹۱۸	-	۸۲۱,۹۱۸	۱۰	-	م۱۴	بانک سامان سی تیر
۳۳۸,۴۱۳,۶۹۳	-	۳۳۸,۴۱۳,۶۹۳	۲۸۵,۴۲۴,۳۶۷	-	۲۸۵,۴۲۴,۳۶۷	۱۰	-	م۲۹	بانک سامان سی تیر
۲,۲۳۳,۹۵۶	-	۲,۲۳۳,۹۵۶	۱,۲۴۴,۹۱۴	-	۱,۲۴۴,۹۱۴	۱۰	-	م۲۹	بانک سامان سی تیر
۹۶۴,۷۹۴	-	۹۶۴,۷۹۴	۸۱۹,۸۶۳	-	۸۱۹,۸۶۳	۱۰	-	م۲۸	بانک سامان سی تیر
۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	-	۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	-	۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	۱۰	-	م۱۵	بانک سامان سی تیر
۷۷۵,۸۴۱	-	۷۷۵,۸۴۱	۷۷۵,۸۴۱	-	۷۷۵,۸۴۱	۱۰	-	م۱۵	بانک سامان سی تیر
۲,۱۴۸,۶۵۷,۵۶۹	-	۲,۱۴۸,۶۵۷,۵۶۹	۱,۹۱۳,۷۹۸,۰۶۴	-	۱,۹۱۳,۷۹۸,۰۶۴				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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	(۱۶,۳۷۳,۴۴۵,۷۸۰)	۲۵۹.۹۳	(۱.۱۳)
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲-۲	۱,۲۵۸,۲۰۴,۱۰۰	(۱۹.۹۷)	۰.۰۹
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۶۸۹,۱۰۶,۱۸۱	(۱۰.۹۴)	۰.۰۵
سایر درآمدها	۴-۲	۸,۱۲۷,۰۰۳,۰۷۹	(۱۲۹.۰۲)	۰.۵۶
جمع		(۶,۲۹۹,۱۳۲,۴۲۰)	۱۰۰.۰۰	(۰.۴۳)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

درآمد سود سهام و سود صندوق سرمایه‌گذاری:

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			طی ماه			اطلاعات مجمع		نام سهام
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	
۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	-	۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴	-	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴	-	-	صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم-درآمد ثابت
۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	-	۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴	-	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴			

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازرگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار:

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری	تعداد	خالص ارزش فروش	ارزش دفتری
داروسازی سینا	۴,۵۴۷,۵۴۲	۱۴۴,۹۵۳,۹۷۶,۸۵۶	۱۳۹,۷۷۰,۸۰۲,۸۵۴	۱۰,۳۸۲,۷۴۳	۳۱۴,۱۴۱,۰۸۸,۱۳۷	۳۰۹,۰۷۳,۰۵۸,۲۱۹
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۲,۳۲۸,۶۳۹	۱۰۲,۲۳۰,۳۶۸,۰۹۳	۱۰۳,۱۲۶,۲۵۲,۱۹۸	۵,۸۵۴,۸۴۰	۲۵۶,۸۸۷,۷۶۵,۲۰۲	۲۶۸,۸۶۴,۷۵۰,۵۲۹
ویتانا	۲,۶۵۶,۰۴۰	۱۴۲,۹۳۲,۸۴۲,۸۹۱	۱۴۳,۱۰۹,۲۴۹,۱۲۴	۹,۲۴۰,۴۸۲	۴۷۳,۰۸۳,۵۴۸,۴۲۲	۴۹۶,۲۹۸,۴۹۱,۵۲۷
بیمه سرمد	۱۰,۲۰۴,۶۶۹	۸۸,۴۹۴,۰۳۴,۱۶۸	۸۵,۰۵۶,۸۸۰,۹۱۴	۲۸,۰۶۳,۶۱۰	۲۰۷,۹۰۵,۴۳۹,۶۶۱	۲۰۰,۶۹۸,۷۱۳,۰۴۸
باما	۴۰,۰۷۱,۵۰۰	۹۹,۴۷۹,۹۸۵,۵۸۲	۷۵,۲۸۷,۲۳۵,۵۲۶	۶,۰۵۱,۸۱۶	۳۸۸,۹۷۱,۱۶۷,۷۸۱	۳۴۲,۸۹۹,۸۵۱,۷۴۴
سرمایه گذاری صنایع ایران	۴,۷۴۷,۷۷۳	۵۷,۹۷۷,۱۱۷,۵۸۶	۴۷,۶۲۹,۵۱۹,۸۷۲	۱۱,۸۲۰,۷۸۹	۱۲۳,۲۷۰,۳۳۹,۹۹۰	۱۰۸,۹۱۹,۹۲۶,۰۳۵
بیمه رازی	۱,۱۵۸,۱۰۱	۱۴,۳۷۴,۷۶۷,۶۰۳	۱۵,۰۹۹,۵۴۲,۴۰۸	۴,۳۳۴,۰۱۹	۵۷,۲۸۴,۴۶۸,۹۰۴	۵۶,۵۸۵,۲۲۷,۹۰۹
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۹,۳۵۱,۵۶۳	۱۱۲,۱۸۲,۲۸۲,۶۳۶	۱۱۳,۳۵۴,۹۷۷,۴۲۸	۴۲,۰۳۸,۷۷۸	۱۶۳,۹۶۷,۱۷۲,۵۶۵	۱۶۳,۹۱۰,۲۳۴,۷۹۳
صندوق س. دارا الگوریتم	۳۱,۵۵۵,۴۷۳	۳۱۶,۷۴۴,۴۲۳,۶۷۰	۳۱۵,۵۰۶,۲۶۰,۷۱۴	۳۱۷,۱۰۰,۳۹۶	۳,۱۸۰,۳۶۹,۴۰۱,۶۵۱	۳,۱۷۹,۸۳۳,۴۶۴,۷۶۵
صندوق س ارزش آفرین بیدار	۲,۴۱۰,۵۴۹	۲۴,۰۱۵,۴۲۲,۹۸۸	۲۵,۹۵۲,۲۱۶,۴۴۵	۴۵,۰۰۰,۳۵۲	۴۸۹,۰۹۱,۰۲۵,۴۴۵	۴۸۴,۶۷۹,۹۳۲,۸۰۹
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	۱۵,۰۰۰	۱۴,۹۸۹,۱۲۵,۰۰۰	۱۵,۰۱۰,۸۷۵,۰۰۰	۱۵,۰۰۰	۱۴,۹۸۹,۱۲۵,۰۰۰	۱۵,۰۱۰,۸۷۵,۰۰۰
جمع	۹۳,۰۴۶,۸۴۹	۱,۱۱۸,۲۷۴,۳۵۷,۰۷۳	۱,۰۷۸,۹۰۳,۸۰۲,۴۸۳	۴۷۹,۹۱۰,۲۲۶	۵,۶۷۷,۲۱۳,۹۲۶,۲۵۳	۵,۶۳۴,۰۱۶,۲۰۷,۱۶۱

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 ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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
داروسازی سینا	۴,۲۶۴,۳۲۰	۱۳۰,۳۸۹,۰۲۰,۹۷۴	۱۲۸,۵۹۸,۰۴۱,۲۳۷	۱,۷۹۰,۹۷۹,۷۳۷	۴,۲۶۴,۳۲۰	۱۳۰,۳۸۹,۰۲۰,۹۷۴	(۱,۳۴۲,۴۶۷,۴۵۵)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۶۷۰,۵۵۸	۲۸,۴۲۴,۷۹۲,۲۰۳	۲۸,۱۶۸,۰۵۷,۱۷۹	۲۵۶,۷۳۵,۰۲۴	۶۷۰,۵۵۸	۲۸,۴۲۴,۷۹۲,۲۰۳	(۲,۷۴۰,۶۶۸,۹۹۹)
وینانا	۱,۴۱۳,۹۵۹	۲۸,۸۸۷,۸۳۴,۲۶۱	۲۵,۴۸۰,۷۴۵,۹۴۹	۳,۴۰۷,۰۸۸,۳۱۲	۱,۴۱۳,۹۵۹	۲۸,۸۸۷,۸۳۴,۲۶۱	(۴۲۳,۷۹۴,۹۱۲)
ح.وینانا	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۸,۵۶۳,۰۹۸,۲۴۹	۲۸,۹۹۹,۳۵۱,۱۵۳	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)	۱,۴۶۹,۹۵۹	۲۸,۵۶۳,۰۹۸,۲۴۹	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)
بیمه سرمد	۱۵,۳۳۰,۲۸۴	۱۱۴,۳۵۳,۵۹۵,۲۲۷	۱۳۳,۶۲۲,۱۹۲,۱۷۴	(۱۹,۲۶۸,۵۹۶,۹۴۷)	۱۵,۳۳۰,۲۸۴	۱۱۴,۳۵۳,۵۹۵,۲۲۷	(۱۷,۳۴۵,۷۸۸,۴۵۲)
باما	۵,۴۲۹,۳۹۰	۱۰۳,۸۹۳,۷۹۹,۱۵۸	۱۳۰,۹۶۷,۳۹۰,۳۶۸	(۲۷,۰۷۳,۴۹۱,۲۱۰)	۵,۴۲۹,۳۹۰	۱۰۳,۸۹۳,۷۹۹,۱۵۸	(۵,۵۷۹,۷۵۵,۵۲۹)
سرمایه گذاری صنایع ایران	۲,۸۶۱,۸۶۳	۳۸,۵۲۵,۷۱۶,۵۲۲	۳۸,۱۷۹,۴۳۳,۷۱۰	۳۴۶,۲۸۲,۸۱۲	۲,۸۶۱,۸۶۳	۳۸,۵۲۵,۷۱۶,۵۲۲	۵,۹۱۵,۱۴۹,۹۴۹
بیمه رازی	۸,۶۸۰,۴۸۶	۷۵,۰۲۰,۴۶۴,۴۹۶	۱۰۲,۴۴۶,۶۸۲,۴۸۶	(۲۷,۴۲۶,۲۱۷,۹۹۰)	۸,۶۸۰,۴۸۶	۷۵,۰۲۰,۴۶۴,۴۹۶	(۲۴,۹۴۳,۹۹۳,۵۳۳)
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۴,۶۴۹,۰۸۹	۸۱,۵۲۶,۴۷۷,۳۴۲	۸۶,۶۹۴,۱۸۷,۲۵۵	(۵,۱۶۷,۷۰۹,۹۱۳)	۲۴,۶۴۹,۰۸۹	۸۱,۵۲۶,۴۷۷,۳۴۲	(۹,۲۳۴,۹۱۳,۰۶۴)
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۵۰,۱۳۵,۴۴۷	۴۹۹,۲۸۷,۶۸۲,۴۴۷	۵۰۲,۰۳۱,۷۹۷,۶۰۹	(۲,۷۴۴,۱۱۵,۱۶۲)	۵۰,۱۳۵,۴۴۷	۴۹۹,۲۸۷,۶۸۲,۴۴۷	(۲,۵۷۹,۳۹۹,۴۳۰)
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	۸,۰۲۱,۸۱۰	۶۹,۷۷۳,۱۷۱,۹۳۵	۸۱,۸۴۸,۶۰۵,۶۶۴	(۱۲,۰۷۵,۴۳۳,۷۲۹)	۸,۰۲۱,۸۱۰	۶۹,۷۷۳,۱۷۱,۹۳۵	(۱۲,۷۸۶,۹۳۷,۴۵۶)
مراجعه عام دولت-ش-خ ۰۳۰۲	۱۳۸,۰۰۰	۱۳۷,۸۹۹,۹۵۰,۰۰۰	۱۳۸,۰۹۱,۲۵۰,۰۰۰	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)	۱۳۸,۰۰۰	۱۳۷,۸۹۹,۹۵۰,۰۰۰	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)
جمع	۱۲۳,۰۶۵,۱۶۵	۱,۳۳۶,۵۴۵,۶۰۲,۸۱۵	۱,۴۲۵,۱۲۷,۶۳۴,۷۸۴	(۸۸,۵۸۲,۰۲۱,۹۷۰)	۱۲۳,۰۶۵,۱۶۵	۱,۳۳۶,۵۴۵,۶۰۲,۸۱۵	(۷۱,۶۹۰,۱۲۱,۷۸۵)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi – NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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
۱,۰۶۶,۸۶۸,۰۳۲	(۲۱,۷۵۰,۰۰۰)	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	۱,۰۶۶,۸۶۸,۰۳۲	(۲۱,۷۵۰,۰۰۰)	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ.۳۰۲
۱,۲۵۸,۲۰۴,۱۰۰	(۱۰,۰۴۷,۲۸۸)	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)	۱,۴۵۹,۵۵۱,۳۸۸	۱,۰۶۶,۸۶۸,۰۳۲	(۲۱,۷۵۰,۰۰۰)	(۱۹۱,۳۰۰,۰۰۰)	۱,۲۷۹,۹۱۸,۰۳۲	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۱-۲- 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	-	۱,۷۹۰,۹۷۹,۷۳۷	۵,۱۸۳,۱۷۴,۰۰۲	۶,۹۷۴,۱۵۳,۷۳۹	-	(۱,۳۴۲,۴۶۷,۴۵۵)	۵,۰۶۸,۰۲۹,۹۱۸	۳,۷۲۵,۵۶۲,۴۶۳
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	-	۲۵۶,۷۳۵,۰۲۴	(۸۹۵,۸۸۴,۱۰۵)	(۶۳۹,۱۴۹,۰۸۱)	-	(۲,۷۴۰,۶۶۸,۹۹۹)	(۱۱,۹۷۶,۹۸۵,۳۲۷)	(۱۴,۷۱۷,۶۵۴,۳۲۶)
ویتانا	-	۳,۴۰۷,۰۸۸,۳۱۲	(۱۷۶,۴۰۶,۲۳۳)	۳,۲۳۰,۶۸۲,۰۷۹	-	(۴۲۳,۷۹۴,۹۱۲)	(۲۳,۲۱۴,۹۴۳,۱۰۵)	(۲۳,۶۳۸,۷۳۸,۰۱۷)
ح.ویتانا	-	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)	-	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)	-	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)	-	(۴۳۶,۲۵۲,۹۰۴)
بیمه سرمد	-	(۱۹,۲۶۸,۵۹۶,۹۴۷)	۳,۴۳۷,۱۵۳,۲۵۴	(۱۵,۸۳۱,۴۴۳,۶۹۳)	-	(۱۷,۳۴۵,۷۸۸,۴۵۲)	۷,۲۰۶,۷۲۶,۶۱۳	(۱۰,۱۳۹,۰۶۱,۸۳۹)
باما	-	(۲۷,۰۷۳,۴۹۱,۲۱۰)	۲۴,۱۹۲,۷۶۰,۰۵۶	(۳,۸۸۰,۷۳۱,۱۵۴)	-	(۵,۵۷۹,۷۵۵,۵۲۹)	۴۶,۰۷۱,۳۱۶,۰۳۷	۴۰,۴۹۱,۵۶۰,۵۰۸
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	-	۳۴۶,۲۸۲,۸۱۲	۱۰,۳۴۷,۵۹۷,۷۱۴	۱۰,۶۹۳,۸۸۰,۵۲۶	-	۵,۹۱۵,۱۴۹,۹۴۹	۱۴,۳۵۰,۴۱۳,۹۵۵	۲۰,۲۶۵,۵۶۳,۹۰۴
بیمه رازی	-	(۲۷,۴۲۶,۲۱۷,۹۹۰)	(۷۲۴,۷۷۴,۸۰۵)	(۲۸,۱۵۰,۹۹۲,۷۹۵)	-	(۲۴,۹۴۳,۹۹۳,۵۳۳)	۶۹۹,۲۴۰,۹۹۵	(۲۴,۲۴۴,۷۵۲,۵۳۸)
س. پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	-	(۵,۱۶۷,۷۰۹,۹۱۳)	(۱,۱۷۲,۶۹۴,۷۹۳)	(۶,۳۴۰,۴۰۴,۷۰۵)	-	(۹,۲۳۴,۹۱۳,۰۶۴)	۵۶,۹۳۷,۷۷۲	(۹,۱۷۷,۹۷۵,۲۹۲)
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴	(۲,۷۴۴,۱۱۵,۱۶۲)	۱,۳۳۸,۱۷۲,۹۵۶	(۷۳۳,۲۶۸,۱۲۲)	۱۱,۹۱۷,۶۰۹,۶۲۵	(۲,۵۷۹,۳۹۹,۴۳۰)	۵۳۵,۹۳۶,۸۸۶	۹,۸۷۴,۱۴۷,۰۸۱
صندوق س ارزش آفرین بیدار-سهام	-	(۱۲,۰۷۵,۴۳۳,۷۲۹)	(۱,۹۳۶,۷۹۳,۴۵۷)	(۱۴,۰۱۲,۲۲۷,۱۸۶)	-	(۱۲,۷۸۶,۹۳۷,۴۵۶)	۴,۴۱۱,۰۹۲,۶۳۶	(۸,۳۷۵,۸۴۴,۸۲۰)
جمع	۷۷۲,۶۷۴,۰۸۴	(۸۸,۳۹۰,۷۳۱,۹۷۰)	۳۹,۴۹۲,۳۰۴,۵۹۰	(۴۸,۱۲۵,۷۵۳,۲۹۶)	۷۶۴,۰۱	(۷۱,۴۹۸,۸۲۱,۷۸۵)	۴۳,۲۰۷,۷۶۶,۲۸۰	(۱۶,۳۷۳,۴۴۵,۷۸۰)

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 ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۳-۲-درآمد 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
۰.۸۷	۵,۹۹۰,۰۷۰	۰.۸۸	۵,۵۷۵,۶۷۲	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱	بانک سامان سی تیر
۰.۱۷	۱,۱۷۵,۶۵۴	۰.۱۳	۸۱۲,۶۶۳	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۲	بانک سامان سی تیر
۰.۱۷	۱,۱۴۷,۳۷۹	۰.۱۳	۸۲۱,۹۱۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۳	بانک سامان سی تیر
۴۹.۱۱	۳۳۸,۴۱۳,۶۹۳	۴۵.۰۳	۲۸۵,۴۲۴,۳۶۷	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۴	بانک سامان سی تیر
۰.۳۲	۲,۲۳۳,۹۵۶	۰.۲۰	۱,۲۴۴,۹۱۴	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۵	بانک سامان سی تیر
۰.۱۴	۹۶۴,۷۹۴	۰.۱۳	۸۱۹,۸۶۳	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۷	بانک سامان سی تیر
۴۹.۱۱	۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	۵۳.۳۹	۳۳۸,۴۰۴,۷۹۴	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۸	بانک سامان سی تیر
۰.۱۱	۷۷۵,۸۴۱	۰.۱۲	۷۷۵,۸۴۱	۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹	بانک سامان سی تیر
۱۰۰.۰۰	۶۸۹,۱۰۶,۱۸۱	۱۰۰.۰۰	۶۳۳,۸۸۰,۰۳۲		جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم (Multi - NAV)

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۹/۱۰/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۷,۶۷۵,۲۳۸,۴۸۴	۱۲۸,۴۲۷,۵۳۹	کارمزد بازارگردانی صندوق های سرمایه گذاری
۴۵۱,۷۶۴,۵۹۵	۱۸,۰۳۳,۱۰۹	سایر درآمدها
۸,۱۲۷,۰۰۳,۰۷۹	۱۴۶,۴۶۰,۶۴۸	جمع