

**صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم**

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم برای دوره مالی میانی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰ که در اجرای بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق براساس سوابق و مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده، به شرح زیر تقدیم می‌گردد:

۲	تاریخچه فعالیت صندوق :
۲	موضوع فعالیت صندوق :
۲	هدف از تشکیل صندوق :
۲	ارکان صندوق :
۳	دوره فعالیت صندوق :
۳	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق:
۳	دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز:
۴	اطلاع رسانی :
۵	صورت خالص دارائی ها:
۶	سود (زیان) حاصل از فروش سهام:
۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام:
۷	خرید و فروش سهام:
۸	ترکیب داراییهای صندوق :
۹	خلاصه عملکرد صندوق:

امضاء

نام و نام خانوادگی
آرش آقائیزاده خیابوی

شرکت سبذگردان الگوریتم
مدیر صندوق

شرکت سبذگردان الگوریتم
ALGORITHM CAPITAL
(سهامی خاص)



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰

تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آینده‌نگر توسعه سینا در تاریخ ۱۳۹۴/۱۲/۰۸ تحت شماره ۱۱۴۰۷ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۴/۱۱/۲۶ طی شماره ۳۷۹۰۱ در اداره ثبت شرکتها و شناسه ملی ۱۴۰۰۵۶۲۰۵۳۸ به ثبت رسیده است. به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۳۹۸/۱۰/۱۵ نام به صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم تغییر یافت. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه‌جویی‌های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۳۹۷/۰۹/۱۸ مدت فعالیت صندوق به مدت سه سال (تا تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۲۵) تمدید گردید. همچنین مطابق مصوبات مجمع مورخ ۱۳۹۸/۰۶/۱۷ و تأییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار طی نامه شماره ۱۲۲/۵۴۰۵۳ مورخ ۱۳۹۸/۰۶/۲۵، سال مالی صندوق از پایان آذر ماه به پایان شهریور ماه تغییر کرده است.

مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، طبقه ۴، واحد ۴۱۰ می‌باشد.

موضوع فعالیت صندوق:

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در ماده ۲-۲ امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است.

هدف از تشکیل صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق امیدنامه و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد.

ارکان صندوق:

مدیر: مدیر صندوق، شرکت سیدگردان الگوریتم است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۰۳ با شماره ثبت ۵۲۲۰۰۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: شهر تهران، محله دانشگاه تهران، خیابان فلسطین، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، مجتمع تجاری اداری بزرگمهر، طبقه چهارم، واحد ۴۱۰.

متولی: متولی صندوق، موسسه حسابرسی آزمودگان که در تاریخ ۱۳۶۹/۱۱/۲۸ به شماره ثبت ۴۶۸۴ در اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: خیابان کریم‌خان زند، خیابان دکتر عضدی (آبان جنوبی) شماره ۵۲، طبقه دوم.

حسابرس: حسابرس صندوق، مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت آزموده کاران است که در تاریخ ۱۳۷۹/۰۳/۱۷ به شماره ثبت ۶۷۶۹ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، شریعتی، قلهک، کوچه شریف، پلاک ۵.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانب کوشا الگوریتم

دوره فعالیت صندوق :

دوره فعالیت صندوق از تاریخ قید شده در مجوز فعالیت که توسط سازمان به نام صندوق صادر می‌شود؛ شروع شده و از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت‌ها به مدت سه سال شمسی ادامه می‌یابد که مطابق تاییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار مدت زمان فعالیت صندوق تا ۱۴۰۰/۱۱/۲۵ تمدید گردید. این مدت مطابق ماده ۴۹ اساسنامه قابل تمدید است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای مهرماه هر سال تا انتهای شهریورماه سال بعد است.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق :

ارزش مبنای هر واحد سرمایه‌گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی‌های سرمایه‌گذاری قید شود. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می‌شود:

الف) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که تعداد آنها ۲۵۰۰۰ (دست کم ۷۰٪ حداقل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق) واحد سرمایه‌گذاری است، در زمان تأسیس کلاً توسط مؤسسان صندوق خریداری می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می‌باشد.

ب) واحدهای سرمایه‌گذاری عادی که تعداد آنها ۲۰۴۷۵۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری است، که در زمان تأسیس یا پس از تشکیل صندوق صادر می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می‌باشد. حداکثر واحدهای سرمایه‌گذاری عادی نزد سرمایه‌گذاران در امیدنامه قید شده است.

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی:

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی به شرح جدول زیر می‌باشد.

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری
۱	شرکت سبذگردان الگوریتم	ممتاز و عادی	۳۰۲۶۰۸	۲۴/۹۳
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز و عادی	۱۱۰۵۵۷	۹/۱۱
۳	شرکت تامین سرمایه سپهر	ممتاز	۴۰۰۰	۰/۳۳
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز	۱۰۰۰	۰/۰۸
۵	شرکت صنایع غذایی شهیدین گام	عادی	۳۰۳۶۳	۰/۲۸
۶	شرکت کارگزاری اقتصاد بیدار	عادی	۳۲۰۱۹۳	۲/۶۵
۷	شرکت آرمان اندیشان رستاک	عادی	۴۶۸۳۸	۳/۸۶
۸	شرکت بیمه رازی	عادی	۱۳۲۶۸۷	۱۰/۹۳
۹	شرکت بیمه سرمد	عادی	۱۵۰۰۰	۱/۲۴
۱۰	موسسه توسعه همیاری سپهر	عادی	۴۴۰۹۶	۳/۶۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانب کوشا الگوریتم

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری
۱۱	شرکت سرمایه‌گذاری صنعت پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	عادی	۴۲.۳۰۸	۳/۴۹
۱۲	شرکت سرمایه‌گذاری گروه مالی سپهر صادرات	عادی	۳۸.۰۹۰	۳/۱۴
۱۳	شرکت باما	عادی	۲۵۱.۱۸۵	۲۰/۶۹
۱۴	شرکت عمران سرمایه آپریک خزر	عادی	۳۲.۱۰۲	۲/۶۴
۱۵	شرکت فرزانه تجارت پارمیس	عادی	۷۲.۳۳۸	۵/۹۶
۱۶	شرکت گروه خدمات بازار سرمایه الگوریتم	عادی	۲۶.۸۹۹	۲/۲۲
۱۷	شرکت لابراتوارهای سینا دارو	عادی	۵.۰۹۶	۰/۴۲
۱۸	آقای فرهنگ شیرزاد	عادی	۵۳.۴۸۵	۴/۴۱
	جمع		۱.۲۱۳.۸۴۵	۱۰۰

اطلاع رسانی:

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم مطابق با ماده ۴۴ اساس نامه در تارنمای صندوق به آدرس www.kooshafund.ir درج گردیده است.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتیم
گزارش عملکرد
برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰

صورت خالص دارایی‌ها:

۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۰۳/۳۱
ریال	ریال
۱۸۲.۴۶۱.۶۷۴.۸۶۵	۶۸۶.۷۳۳.۸۶۲.۰۴۹
۱۲.۲۶۲.۵۴۴.۸۷۲	۱۲۰.۷۴۲.۸۲۷.۶۲۳
۷.۲۷۳.۲۰۶.۴۰۴	۶۶.۸۷۸.۰۱۰.۲۵۵
۱۱۹.۴۴۳.۱۲۵.۲۶۸	۸۱۱.۸۵۱.۸۷۳.۷۴۶
۱۱.۷۵۸.۳۷۴.۴۴۸	۴.۳۲۲.۷۲۱.۸۱۳
۸۳.۷۶۴.۳۳۸	۵۳۳.۸۸۷.۳۵۶
۳۳۳.۲۸۲.۶۹۰.۱۹۵	۱.۶۹۱.۰۶۳.۱۸۲.۸۴۲

دارایی‌ها :

سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
صندوق‌های سرمایه‌گذاری
حسابهای دریافتی
سایر دارایی‌ها
جمع دارایی‌ها

بدهی‌ها :

جاری کارگزاران
بدهی به ارکان صندوق
بدهی به سرمایه‌گذاران
سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
جمع بدهی‌ها

(۵۱.۱۴۱.۸۲۹.۰۹۶)	(۳۸۹.۳۰۱.۷۷۵.۷۲۰)
(۱.۶۶۸.۸۹۲.۲۵۱)	(۱۵.۰۹۶.۲۴۶.۲۱۹)
.	(۷۵۸.۸۴۴.۵۴۵)
(۷۰۰.۷۳۴.۶۳۸)	(۱.۸۲۰.۲۴۶.۲۹۹)
(۵۳.۵۱۱.۴۵۵.۹۸۵)	(۴۰۶.۹۷۷.۱۱۲.۷۸۳)
۲۷۹.۷۷۱.۲۳۴.۲۱۰	۱.۲۸۴.۰۸۶.۰۷۰.۰۵۹
۲.۷۱۴.۱۱۸	۱.۰۵۷.۸۶۷

خالص دارایی‌ها

خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانب کوشا الگوریتم

سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس به شرح زیر است:

شرح	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد و مالیات (ریال)	سود (زیان) فروش
باما	۲۶.۱۳۱.۴۰۱	۵۹۹.۳۷۹.۳۴۳.۷۶۰	۶۲۹.۹۶۴.۱۰۶.۹۸۱	(۱.۵۹۰.۹۶۷.۱۳۱)	(۳۲.۱۷۵.۷۳۰.۳۵۲)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۳.۸۱۳.۹۲۶	۲۶۴.۶۲۳.۳۹۰.۴۲۵	۲۴۹.۲۵۵.۹۸۴.۹۶۴	(۲۰۱.۱۱۰.۱۸۷)	۱۵.۱۶۵.۲۹۵.۲۷۴
بیمه سرمد	۴۵.۴۴۴.۹۶۱	۳۲۳.۲۱۰.۶۹۳.۷۰۶	۳۳۳.۸۳۶.۱۰۲.۳۴۶	(۲۲۳.۹۸۶.۷۷۳)	(۱۰.۸۴۹.۳۹۵.۴۱۳)
بیمه رازی	۲۵.۸۰۹.۷۰۶	۲۳۷.۱۸۹.۴۳۹.۶۵۵	۲۵۷.۳۹۵.۱۹۷.۱۸۷	(۱۸۰.۲۶۲.۰۸۱)	(۲۰.۳۸۶.۰۱۹.۶۱۳)
پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۴۵.۶۳۰.۹۷۱	۱۷۵.۵۴۷.۴۲۹.۳۶۰	۱۷۷.۰۷۹.۶۱۷.۱۳۱	(۱۳۳.۴۱۲.۲۶۲)	(۱.۶۶۵.۶۰۰.۰۳۳)
داروسازی سینا	۲۱.۸۷۸.۴۰۵	۵۹۷.۹۵۶.۵۰۸.۵۳۰	۶۲۷.۳۳۴.۲۷۰.۰۷۵	(۴۶۹.۱۱۱.۶۱۰)	(۲۹.۸۴۶.۸۷۳.۱۵۵)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۷.۰۷۰.۶۲۳	۳۱۲.۹۷۳.۵۹۲.۹۹۲	۳۲۴.۵۱۸.۱۶۶.۳۲۶	(۴۱۹.۷۸۲.۳۲۷)	(۱۱.۹۶۴.۳۵۵.۶۶۱)
ویتانا	۱۱.۲۵۹.۸۵۱	۵۱۶.۶۵۲.۷۳۶.۳۰۱	۵۳۹.۴۹۴.۹۴۹.۲۰۶	(۵۰۸.۴۴۴.۸۷۹)	(۲۳.۳۵۰.۶۵۷.۷۸۴)
حق تقدم ویتانا	۱.۴۶۹.۹۵۹	۲۰.۴۲۵.۲۴۶.۰۰۴	۲۸.۹۹۹.۳۵۱.۱۵۲	(۱۷۹.۷۴۱.۷۱۷)	(۸.۷۵۳.۸۴۶.۸۶۵)
سیمان مازندران	۳۴.۴۴۶	۴۰۹.۲۱۸.۴۸۰	۴۰۸.۴۰۸.۹۴۱	۳۶۰.۱.۱۳۰	(۲.۷۹۱.۵۸۱)
جمع	۲۰۸.۵۴۴.۲۴۹	۳.۰۴۸.۳۶۶.۵۹۹.۲۱۳	۳.۱۶۸.۲۸۶.۱۵۴.۳۰۹	(۳.۹۱۰.۴۲۰.۰۸۷)	(۱۲۳.۸۲۹.۹۷۵.۱۸۳)

سود (زیان) حاصل از فروش واحد های صندوق سرمایه‌گذاری:

شرح	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش
ارزش آفرین بیدار	۷۵.۷۷۲.۷۳۴	۷۷۷.۸۴۹.۸۰۱.۰۶۰	۷۸۵.۳۴۵.۹۵۹.۴۸۱	(۱۲۵.۵۰۵.۹۳۶)	(۷.۶۲۱.۶۶۴.۳۵۷)
دارا الگوریتم	۶۱۸.۹۵۲.۳۰۲	۶.۲۰۷.۲۲۴.۵۸۷.۳۵۰	۶.۲۰۱.۸۸۴.۹۳۳.۴۰۵	(۹۴.۵۳۰.۰۲۶)	۵.۲۴۵.۱۲۳.۹۱۹
جمع	۶۹۴.۷۲۵.۰۳۶	۶.۹۸۵.۰۷۴.۳۸۸.۴۱۰	۶.۹۸۷.۲۳۰.۸۹۲.۸۸۶	(۲۲۰.۰۳۵.۹۶۳)	(۲.۳۷۶.۵۴۰.۴۲۸)

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام و حق تقدم شرکت‌های پذیرفته شده در بورس و فرابورس:

شرح	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد و مالیات (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
داروسازی سینا	۱۵.۵۱۸.۸۶۴	۲۸۶.۱۶۷.۸۵۲.۱۶۰	۳۸۹.۸۶۵.۲۸۵.۲۴۷	(۲۱۷.۴۸۷.۵۶۸)	(۱۰۳.۹۱۴.۹۲۰.۶۵۵)
ویتانا	۱۰.۵۲.۳۲۶	۱۰.۳۹۰.۶۶۶.۹۲۲	۲۳.۵۳۵.۰۲۳.۴۸۲	(۹۱.۴۳۷.۸۶۹)	(۱۳.۲۳۵.۷۹۴.۴۲۹)
بیمه سرمد	۲۷.۹۴۵.۵۴۲	۱۳۸.۵۵۳.۹۹۷.۲۳۱	۱۹۶.۱۳۰.۳۴۵.۰۱۴	(۱۰۵.۳۰۱.۰۳۸)	(۵۷.۶۸۱.۶۴۸.۸۱۷)
باما	۱۱.۲۳۲.۷۶۳	۹۳.۹۰۵.۸۹۸.۶۸۰	۱۳۵.۳۸۶.۹۹۱.۴۵۷	(۷۱.۳۶۸.۴۸۳)	(۴۱.۵۵۲.۴۶۱.۲۶۰)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۷.۳۲۸.۷۸۶	۸۰.۷۲۶.۵۷۷.۷۹۰	۹۰.۹۲۹.۸۵۸.۹۳۱	(۶۱.۳۵۲.۱۹۹)	(۱۰.۲۶۴.۶۳۳.۳۴۰)
بیمه رازی	۲۶.۱۱۴.۲۲۵	۳۲.۱۷۲.۷۲۵.۲۰۰	۳۴.۳۹۱.۳۴۸.۵۴۴	(۲۴.۴۵۱.۲۷۱)	(۲.۲۴۳.۰۷۴.۶۱۵)
پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۲۲.۵۵۶.۸۹۶	۴۵.۷۹۰.۴۹۸.۸۸۰	۸۲.۲۲۹.۳۷۴.۱۳۹	(۴۰۲.۹۵۶.۳۹۰)	(۳۶.۸۴۱.۸۳۱.۶۴۹)
جمع	۱۱۱.۷۴۹.۴۰۲	۶۸۷.۷۰۸.۲۱۶.۸۶۳	۹۵۲.۴۶۸.۲۳۶.۸۱۴	(۹۷۴.۳۵۴.۸۱۸)	(۲۶۵.۷۳۴.۳۶۶.۷۶۵)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری واحد های صندوق سرمایه گذاری:

شرح	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
دارا الگوریتم	۷۳.۲۱۶.۲۹۷	۷۳۹.۲۶۴.۹۵۰.۸۰۹	۷۳۳.۴۵۹.۱۴۷.۲۳۴	(۱۶۶۳۳.۴۶۱)	۵.۷۸۹.۱۷۰.۱۱۴
ارزش آفرین بیدار	۸.۷۲۸.۴۶۲	۷۲.۶۲۰.۸۰۳.۸۴۰	۸۰.۰۵۸.۰۱۱.۰۸۴	(۱۷.۲۴۷.۴۴۱)	(۷.۴۵۴.۴۵۴.۶۸۵)
جمع	۸۱.۹۴۴.۷۵۹	۸۱۱.۸۸۵.۷۵۴.۶۴۹	۸۱۳.۵۱۷.۱۵۸.۳۱۸	(۳۳.۸۸۰.۹۰۲)	(۱.۶۶۵.۲۸۴.۵۷۱)

خرید و فروش طی دوره:

طی دوره سهام	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
داروسازی سینا	۳۵.۷۸۴.۰۰۸	۲۱.۸۷۸.۴۰۵	۹۶۴.۳۸۰.۷۸۳.۰۸۴	۵۹۷.۴۸۷.۳۹۶.۹۲۰
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۵.۸۷۳.۶۴۲	۷.۰۷۰.۶۲۳	۲۶۸.۴۱۳.۱۲۵.۰۳۱	۳۱۲.۵۵۳.۸۱۰.۶۶۵
ویتانا	۱۰.۹۴۴.۱۴۰	۱۲.۷۲۹.۸۱۰	۵۱۸.۷۱۵.۶۳۱.۸۸۰	۵۳۶.۳۸۹.۷۹۵.۷۰۹
بیمه سرمد	۷۳.۳۹۰.۵۰۳	۴۵.۴۴۴.۹۶۱	۵۳۰.۰۱۳.۹۲۸.۳۶۶	۳۲۲.۹۸۸.۷۰۶.۹۳۳
باما	۳۱.۹۰۴.۴۱۳	۲۶.۱۳۱.۴۰۱	۷۶۵.۳۵۱.۰۹۸.۴۳۸	۵۹۷.۷۸۸.۳۷۶.۶۲۹
سرمایه گذاری صنایع ایران	۳۱.۱۴۲.۷۱۲	۲۳.۸۱۳.۹۲۶	۳۴۰.۱۸۵.۸۴۳.۸۹۴	۲۶۴.۴۲۱.۲۸۰.۳۳۸
بیمه رازی	۲۹.۰۸۲.۰۲۸	۲۵.۸۰۹.۷۰۶	۲۹۱.۷۸۶.۵۴۵.۷۳۱	۲۳۷.۰۰۹.۱۷۷.۵۷۴
پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	۴۵.۶۳۰.۹۷۱	۲۵۹.۳۰۸.۹۹۱.۲۷۰	۱۷۵.۴۱۴.۰۱۷.۰۹۸
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۶۸۶.۹۳۷.۴۰۸	۶۱۸.۹۵۲.۳۰۲	۶.۸۸۲.۳۳۲.۴۲۹.۱۱۱	۶.۲۰۷.۱۳۰.۰۵۷.۳۲۴
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۷۸.۵۰۱.۱۹۶	۷۵.۷۷۲.۷۳۴	۷۹۹.۰۳۴.۸۴۱.۴۱۶	۷۷۷.۷۲۴.۲۹۵.۱۲۴
سیمان مازندران	۳۴.۴۴۶	۳۴.۴۴۶	۴۰۷.۲۰۰.۶۱۶	۴۰۵.۶۱۷.۳۶۰

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار

طی دوره سهام	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
داروسازی سینا	۵۷.۶۶۲.۴۱۳	۱۷۳.۹۴۴.۰۵۲	۳۳/۱۵
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۱۲.۹۴۴.۲۶۵	۱۲۰.۸۵۵.۸۳۶	۱۰/۷۱
ویتانا	۲۳.۶۷۳.۹۵۰	۴۶۷.۲۶۷.۷۲۵	۵/۰۷
بیمه سرمد	۱۱۸.۸۳۵.۴۶۴	۵۳۶.۸۱۵.۵۹۶	۲۲/۱۴
باما	۵۸.۰۳۵.۸۱۴	۴.۲۶۱.۰۴۰.۷۹۵	۱/۳۶
سرمایه گذاری صنایع ایران	۵۴.۹۵۶.۶۳۸	۴۸۲.۳۱۲.۴۶۴	۱۱/۳۹
بیمه رازی	۵۴.۸۹۱.۷۳۴	۹۹۶.۹۴۵.۰۷۷	۵/۵۱
س پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۱۱۳.۸۱۸.۸۳۸	۹۸۶.۵۲۹.۷۹۶	۱۱/۵۴
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱.۳۰۵.۸۸۹.۷۱۰	۱.۴۱۹.۴۳۸.۳۲۶	۹۲/۰۰
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۱۵۴.۲۷۳.۹۳۰	۱.۹۹۸.۲۸۳.۲۰۱	۷/۷۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰

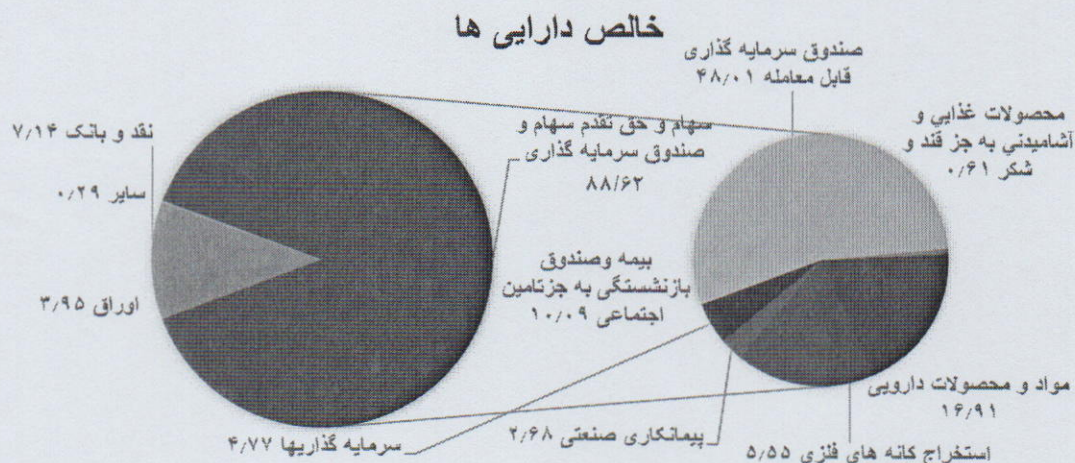


ترکیب داراییهای صندوق:

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تاسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		امروز	
	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی (درصد)
سهام	۱۱۰.۲۶۴	۴۴/۹۶	۸۳۳.۱۷۴	۴۸/۸۱	۷۸۸.۲۷۱	۴۶/۴۵	۶۸۶.۷۳۳	۴۰/۶۱
اوراق	۲۷.۳۱۸	۱۱/۱۴	۹۶.۴۷۷	۵/۶۵	۶۶.۴۰۶	۳/۹۱	۶۶.۸۷۸	۳/۹۵
وجه نقد	۲۷.۹۹۹	۱۱/۴۲	۱۰۲.۴۵۶	۶	۱۰۵.۹۴۶	۶/۲۴	۱۲۰.۷۴۲	۷/۱۴
سایر دارایی‌ها	۴.۲۸۹	۱/۷۵	۹.۱۱۷	۰/۵۳	۴.۸۶۵	۰/۲۹	۴.۸۵۶	۰/۲۹
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۱۰۹.۹۱۹	۴۴/۸۱	۷۸۵.۰۵۰	۴۵/۹۹	۷۴۳.۳۱۹	۴۳/۸	۶۴۴.۲۸۶	۳۸/۱
صندوق سرمایه‌گذاری	۵۷۴.۳۶۹	۲۳۴/۱۷	۶۶۵.۶۲۵	۳۹	۷۳۱.۴۳۶	۴۳/۱	۸۱۱.۸۵۱	۴۸/۰۱

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد*

نمودار ترکیب دارایی:



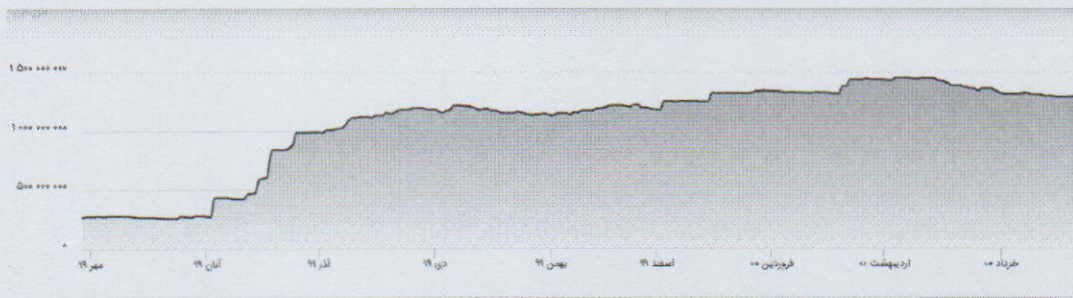
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۰



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

شرح	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۶/۳۱
خالص ارزش دارایی‌ها	۱,۲۸۴,۰۸۶,۰۷۰,۰۵۹	۲۷۹,۷۷۱,۲۳۴,۳۱۰
قیمت صدور هر واحد	۱,۰۵۹,۳۵۲	۲,۷۲۶,۸۷۳
قیمت ابطال هر واحد	۱,۰۵۷,۸۶۷	۲,۷۱۴,۱۱۸
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری	۱,۲۱۳,۸۴۵	۱۰۳,۰۸۰