

# صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

## گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم برای سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور 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 دارائی‌ها: .....
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:

## 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 می باشد.

## 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 سبذگردان 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، مؤسسه 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.

## 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 ۲۵،۰۰۰ (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 ۲،۴۷۵،۰۰۰ 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 سیدگردان الگوریتم	ممتاز و عادی	۳۰۸،۶۶۵	۲۶/۶۷
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز و عادی	۱۱۳،۸۱۸	۹/۸۴
۳	شرکت تامین سرمایه سپهر	ممتاز و عادی	۵،۸۶۳	۰/۵۱
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز و عادی	۱،۴۶۵	۰/۱۳
۵	شرکت کارگزاری اقتصاد بیدار	عادی	۳۲،۱۹۳	۲/۷۸
۶	شرکت آرمان اندیشان رستاک	عادی	۴۶،۸۳۸	۴/۰۵
۷	شرکت بیمه رازی	عادی	۱۳۲،۶۸۷	۱۱/۴۷
۸	شرکت بیمه سرمد	عادی	۱۵،۰۰۰	۱/۳۰
۹	موسسه توسعه همیاری سپهر	عادی	۴۴،۰۹۶	۳/۸۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری
۱۰	شرکت سرمایه‌گذاری گروه مالی سپهر صادرات	عادی	۴۵.۱۵۹	۳/۹۰
۱۱	شرکت باما	عادی	۲۵۱.۱۸۵	۲۱/۷۱
۱۲	شرکت فرزانه تجارت پارمیس	عادی	۷۲.۳۳۸	۶/۲۵
۱۳	شرکت گروه خدمات بازار سرمایه الگوریتم	عادی	۲۹.۳۷۱	۲/۵۴
۱۴	شرکت لابراتوار های سینا دارو	عادی	۵۰.۰۹۶	۰/۴۴
۱۵	آقای فرهنگ شیرزاد	عادی	۵۳.۴۸۵	۴/۶۲
	<b>جمع</b>		<b>۱.۱۵۷.۲۵۹</b>	<b>۱۰۰</b>

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.koosha.fund](http://www.koosha.fund) درج گردیده است.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



**صورت خالص دارایی‌ها:**

۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۰۶/۳۱	دارایی‌ها :
ریال	ریال	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱۸۲.۴۶۱.۶۷۴.۸۶۵	۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱	سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی
۱۲.۲۶۲.۵۴۴.۸۷۲	۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با در آمد ثابت یا علی الحساب
۷.۲۷۳.۲۰۶.۴۰۴	۲۰۲.۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴	صندوق های سرمایه گذاری
۱۱۹.۴۴۳.۱۲۵.۲۶۸	۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳	حسابهای دریافتی
۱۱.۷۵۸.۳۷۴.۴۴۸	۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳	سایر دارایی ها
۸۳.۷۶۴.۳۳۸	۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲	جمع دارایی‌ها
<b>۳۳۳.۲۸۲.۶۹۰.۱۹۵</b>	<b>۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴</b>	<b>بدهی‌ها :</b>
(۵۱.۱۴۱.۸۲۹.۰۹۶)	(۴۳۱.۶۵۹.۹۳۱.۱۱۸)	جاری کارگزاران
(۱.۶۶۸.۸۹۲.۲۵۱)	(۱۰.۰۷۸.۲۰۵.۸۳۵)	بدهی به ارکان صندوق
(۷۰۰.۷۳۴.۶۳۸)	(۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵)	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
<b>(۵۳.۵۱۱.۴۵۵.۹۸۵)</b>	<b>(۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸)</b>	جمع بدهی‌ها
۲۷۹.۷۷۱.۲۳۴.۲۱۰	۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	<b>خالص دارایی‌ها</b>
<b>۲.۷۱۴.۱۱۸</b>	<b>۱.۱۴۷.۹۶۵</b>	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



**سود(زیان) حاصل از فروش سهام و حق تقدم 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	۵۳.۲۲۳.۷۱۴	۹۱۳.۰۰۶.۴۶۳.۰۷۰	۹۴۵.۹۵۴.۷۹۹.۲۸۴	(۱.۸۲۹.۳۲۱.۲۸۹)	(۳۴.۷۷۷.۷۵۷.۵۰۳)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۳۹.۲۷۴.۰۸۳	۳۸۹.۹۳۷.۷۶۴.۸۴۱	۴۰۵.۴۸۰.۴۲۲.۰۰۳	(۲۹۶.۳۴۶.۶۳۸)	(۱۵.۸۳۹.۰۰۳.۸۰۰)
بیمه سرمد	۶۶.۵۲۸.۲۶۷	۴۲۷.۵۸۹.۹۷۷.۶۹۹	۴۷۵.۶۹۸.۱۴۸.۰۰۷	(۳۰۳.۳۱۲.۴۳۵)	(۴۸.۴۱۱.۴۸۲.۷۴۳)
بیمه رازی	۳۴.۶۰۱.۶۰۷	۲۵۱.۳۰۲.۵۸۵.۹۱۳	۲۶۹.۰۸۸.۶۸۱.۲۲۳	(۱۹۰.۹۸۷.۶۲۰)	(۱۷.۹۷۷.۰۸۲.۹۳۰)
پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	۲۱۸.۱۴۴.۹۴۵.۲۴۲	۲۵۹.۳۰۸.۹۹۱.۲۷۰	(۵۰.۸۲۶۹.۱۹۳)	(۴۱.۶۷۲.۳۱۵.۲۲۱)
داروسازی سینا	۳۳.۱۳۲.۲۳۹	۸۳۹.۲۰۳.۴۶۳.۷۰۰	۸۹۹.۸۷۵.۶۲۴.۶۸۲	(۶۵۲.۴۵۶.۳۳۳)	(۶۱.۳۲۴.۷۱۷.۳۱۵)
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۷.۰۷۰.۶۲۳	۳۱۲.۹۷۳.۵۹۲.۹۹۲	۳۲۴.۵۱۸.۱۶۶.۳۲۶	(۴۱۹.۷۸۲.۳۲۷)	(۱۱.۹۶۴.۳۵۵.۶۶۱)
ویتانا	۱۲.۳۱۲.۱۷۷	۵۲۵.۷۱۴.۷۵۲.۴۷۱	۵۶۳.۰۲۹.۹۷۲.۶۸۸	(۵۸۸.۱۹۰.۵۳۵)	(۳۷.۹۰۳.۴۱۰.۷۵۲)
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	۴۰۵.۶۱۷.۳۶۰	(۳۶۰.۱.۱۲۰)	۰
<b>جمع</b>	<b>۳۱۵.۸۳۴.۹۸۲</b>	<b>۳.۸۹۸.۷۰۷.۸۱۰.۴۱۲</b>	<b>۴.۱۷۲.۳۵۹.۷۷۳.۹۹۵</b>	<b>(۴.۹۷۲.۰۰۹.۲۰۷)</b>	<b>(۲۷۸.۶۲۳.۹۷۲.۷۹۰)</b>

**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	۹۰.۶۲۰.۵۷۵	۹۲۶.۳۳۹.۲۹۸.۶۱۰	۹۲۷.۳۸۸.۴۷۰.۹۹۸	(۱۶۰.۷۷۰.۴۹۹)	(۱.۲۰۹.۹۴۲.۸۸۷)
دارا الگوریتم	۶۹۱.۸۲۸.۹۲۴	۶.۹۳۸.۸۳۲.۵۲۴.۲۲۹	۶.۹۳۴.۴۳۵.۴۱۲.۴۴۰	(۱۰۴.۲۰۰.۴۹۰)	۴.۲۹۲.۹۱۱.۲۹۹
<b>جمع</b>	<b>۷۸۲.۴۴۹.۴۹۹</b>	<b>۷.۸۶۵.۱۷۱.۸۲۲.۸۳۹</b>	<b>۷.۸۶۱.۸۲۳.۸۸۳.۴۳۸</b>	<b>(۲۶۴.۹۷۰.۹۸۹)</b>	<b>۳.۰۸۲.۹۶۸.۴۱۲</b>

**سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام 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	۱۲.۶۷۷.۹۲۸	۲۶۱.۶۷۲.۴۳۳.۹۲۰	۲۹۶.۴۶۰.۵۷۷.۸۸۴	(۱۹۸.۸۷۱.۰۵۰)	(۳۴.۹۸۷.۰۱۵.۰۱۴)
بیمه سرمد	۱۵.۸۶۷.۰۸۴	۷۵.۸۹۲.۲۶۲.۷۷۲	۹۷.۸۴۴.۰۲۵.۸۴۴	(۵۷.۶۷۸.۱۲۰)	(۲۲.۰۰۹.۴۴۱.۱۹۲)
باما	۱۳.۳۴۱.۵۰۶	۱۴۳.۵۵۴.۶۰۴.۵۶۰	۱۶۴.۱۷۱.۹۱۳.۹۵۲	(۱۰۹.۱۰۱.۴۹۹)	(۲۰.۷۲۶.۴۱۰.۸۹۲)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۵.۷۹۲.۵۳۷	۴۱۰.۱۱۱.۱۶۱.۹۶۰	۴۵.۴۹۱.۷۵۰.۱۶۶	(۳۱.۱۶۸.۴۸۳)	(۴.۵۱۱.۷۵۶.۶۹۰)
بیمه رازی	۲۷.۵۷۹.۵۰۶	۴۹.۲۸۴.۵۷۷.۲۲۲	۳۹.۴۲۵.۳۸۳.۳۳۷	(۳۷.۴۵۶.۲۷۹)	۹.۸۲۱.۷۳۷.۶۰۶
<b>جمع</b>	<b>۷۵.۲۵۸.۵۶۱</b>	<b>۵۷۱.۴۱۵.۰۴۰.۴۳۴</b>	<b>۶۴۳.۳۹۳.۶۵۱.۱۸۳</b>	<b>(۴۳۴.۲۷۵.۴۳۱)</b>	<b>(۷۲.۴۱۲.۸۸۶.۱۸۲)</b>

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



**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	۸۲.۸۱۴.۴۱۸	۸۳۳.۰۳۰.۲۳۰.۶۶۱	۸۳۳.۶۹۷.۵۴۲.۷۲۴	(۱۸.۷۴۳.۱۸۰)	(۶۸۶.۰۵۵.۲۴۲)
ارزش آفرین بیدار	۱۱.۷۶۱.۷۸۴	۱۱۶.۷۹۴.۵۱۵.۱۲۰	۱۱۹.۸۷۲.۸۲۴.۶۹۴	(۲۷.۷۳۸.۶۹۸)	(۳.۱۰۶.۰۴۸.۲۷۳)
جمع	۹۴.۵۷۶.۲۰۲	۹۴۹.۸۲۴.۷۴۵.۷۸۱	۹۵۳.۵۷۰.۳۶۷.۴۱۸	(۴۶.۴۸۱.۸۷۸)	(۳.۷۹۲.۱۰۳.۵۱۶)

**خرید و فروش طی سال:**

مبلغ فروش (ریال)	مبلغ خرید (ریال)	تعداد فروش	تعداد خرید	طی سال	
				سهام	سهام
۸۳۸.۵۵۰.۹۰۷.۳۶۷	۱.۱۴۳.۵۱۷.۴۳۰.۳۲۸	۳۳.۱۳۲.۲۳۹	۴۴.۱۹۶.۹۰۶	داروسازی سینا	
۳۱۲.۵۵۳.۸۱۰.۶۶۵	۲۶۸.۴۱۳.۱۲۵.۰۳۱	۷.۰۷۰.۶۲۳	۵.۸۷۳.۶۴۲	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	
۵۴۵.۳۷۲.۰۶۶.۲۲۳	۵۱۸.۷۱۵.۶۳۱.۸۸۰	۱۳.۷۸۲.۱۳۶	۱۰.۹۴۴.۱۴۰	ویتانا	
۴۲۷.۲۸۶.۶۶۵.۲۶۴	۵۷۳.۵۸۹.۶۵۴.۸۵۷	۶۶.۵۲۸.۲۶۷	۸۲.۳۹۵.۳۵۱	بیمه سرمد	
۹۱۱.۱۷۷.۰۴۱.۷۸۱	۱.۱۱۰.۱۲۶.۷۱۳.۲۳۶	۵۳.۲۲۳.۷۱۴	۶۱.۱۰۵.۴۶۹	باما	
۳۸۹.۶۴۱.۴۱۸.۲۰۳	۴۵۰.۹۷۲.۱۷۲.۱۶۹	۳۹.۲۷۴.۰۸۳	۴۵.۰۶۶.۶۲۰	سرمایه گذاری صنایع ایران	
۲۵۱.۱۱۱.۵۹۸.۲۹۳	۳۰۸.۵۱۴.۰۶۴.۵۶۰	۳۴.۶۰۱.۶۰۷	۳۹.۳۳۹.۲۱۰	بیمه رازی	
۲۱۷.۶۳۶.۶۷۶.۰۴۹	۲۵۹.۳۰۸.۹۹۱.۲۷۰	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	
۶۹۳۸.۷۲۸.۲۲۳.۷۳۹	۷.۷۱۵.۱۲۱.۳۰۳.۶۳۳	۶۹۱.۸۲۸.۹۲۴	۷۶۹.۴۱۲.۱۵۱	صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	
۹۲۶.۱۷۸.۵۲۸.۱۱۱	۹۸۰.۸۹۲.۱۶۶.۵۴۳	۹۰.۶۲۰.۵۷۵	۹۶.۳۸۲.۳۵۹	صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	
۴۰۵.۶۱۷.۳۶۰	۴۰۷.۲۰۰.۶۱۶	۳۴.۴۴۶	۳۴.۴۴۶	سیمان مازندران	

**مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار**

درصد از حجم معاملات بازار	حجم معاملات بازار	حجم معاملات در صندوق	طی سال	
			سهام	سهام
۳۳/۷۴	۲۲۹.۲۲۳.۹۶۵	۷۷.۳۲۹.۱۴۵	داروسازی سینا	
۷/۴۸	۱۷۳.۰۹۲.۴۴۶	۱۲.۹۴۴.۲۶۵	توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	
۲/۶۰	۹۵۰.۳۲۲.۹۹۲	۲۴.۷۲۶.۲۷۶	ویتانا	
۲۱/۹۱	۶۷۹.۵۷۲.۰۸۹	۱۴۸.۹۲۳.۶۱۸	بیمه سرمد	
۱/۶۱	۷.۱۱۸.۲۴۳.۸۸۶	۱۱۴.۳۲۹.۱۸۳	باما	
۱۲/۹۷	۶۵۰.۲۴۸.۷۰۳	۸۴.۳۴۰.۷۰۳	سرمایه گذاری صنایع ایران	
۳/۱۱	۲.۳۷۸.۰۵۵.۷۳۵	۷۳.۹۴۰.۸۱۷	بیمه رازی	
۷/۵۵	۱.۸۰۵.۱۸۱.۱۰۴	۱۳۶.۳۷۵.۷۳۴	س پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	
۹۳/۷۹	۱.۵۵۷.۹۳۴.۵۹۰	۱.۴۶۱.۲۴۱.۰۷۵	صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	
۸/۰۳	۲.۳۳۰.۰۸۸.۸۹۶	۱۸۷.۰۰۲.۹۳۴	صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
گزارش عملکرد  
سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰

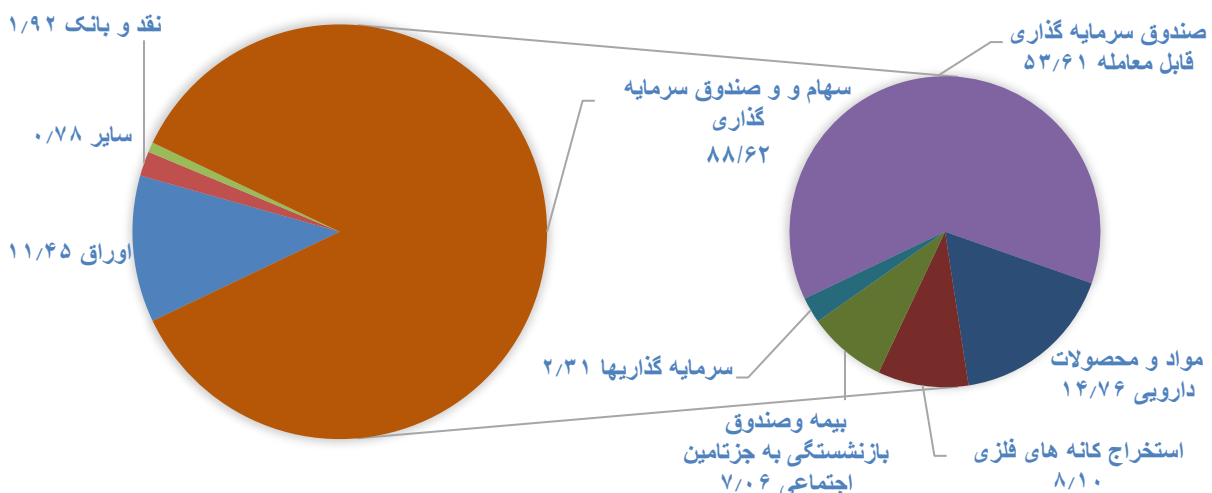
**ترکیب داراییهای صندوق:**

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		۱۴۰۰/۰۶/۳۱
	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	
سهام	۱۳۳.۵۶۴	۴۲/۱۷	۶۱۶.۷۷۵	۳۴/۱۷	۵۸۹.۶۶۰	۲۲/۰۸	۲۲/۲۳
اوراق	۳۴.۰۲۳	۱۰/۷۴	۱۷۵.۷۲۲	۹/۷۳	۲۱۱.۷۸۱	۱۱/۵۲	۱۱/۴۵
وجه نقد	۳۱.۴۵۳	۹/۹۳	۱۰۲.۵۹۶	۵/۶۸	۷۴.۹۷۲	۴/۰۸	۱/۹۲
سایر دارایی ها	۴.۶۷۱	۱/۴۷	۱۲.۷۷۲	۰/۷۱	۱۴.۸۸۱	۰/۸۱	۰/۷۹
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۱۳۲.۲۰۰	۴۱/۷۷	۵۹۶.۸۸۸	۳۳/۰۷	۵۸۹.۶۶۰	۲۲/۰۸	۲۲/۲۳
صندوق سرمایه‌گذاری	۶۶۰.۲۹۶	۲۰۸/۴۷	۸۹۷.۲۵۳	۴۹/۷۱	۹۴۶.۷۱۲	۵۱/۵۱	۵۳/۶۱

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد\*

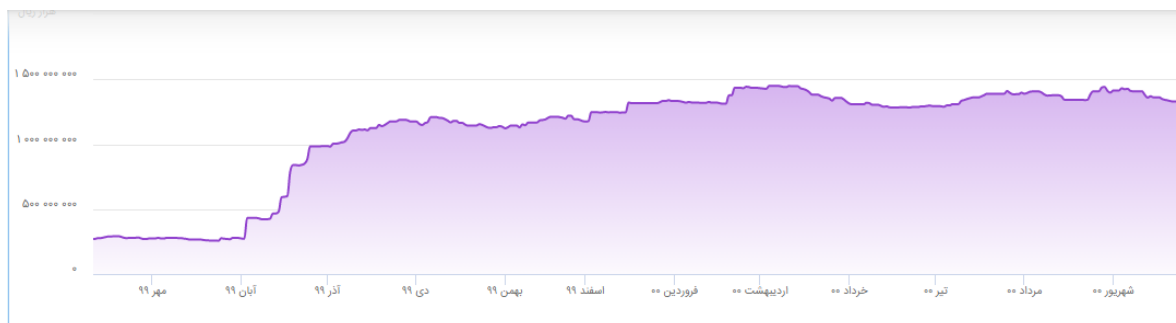
**نمودار ترکیب دارایی:**

**خالص دارایی ها**





## نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



## خلاصه عملکرد:

### صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

شرح سال مالی منتهی به ۳۱/۰۶/۱۴۰۰ سال مالی منتهی به ۳۱/۰۶/۱۳۹۹

خالص ارزش دارایی‌ها	۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	۲۷۹.۷۷۱.۲۳۴.۲۱۰
قیمت صدور هر واحد	۱.۱۴۸.۹۹۷	۲.۷۲۶.۸۷۳
قیمت ابطال هر واحد	۱.۱۴۷.۹۶۵	۲.۷۱۴.۱۱۸
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری	۱.۱۵۷.۲۵۹	۱۰۳.۰۸۰

## استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق:

به منظور مدیریت صحیح و مناسب صندوق و با توجه به فضای رقابتی بازار سرمایه، از ظرفیت و توانمندی‌های تیم مدیریتی و کارشناسی نهایت بهره‌ی لازم برده شده و با توجه به فرصت‌ها و تهدیدات پیش رو، جهت‌گیری‌های اصلی صندوق در جهت نقدشوندگی هر چه بیشتر سهام تحت مدیریت و کاهش نوسان سهام مورد بازارگردانی می‌باشد و در نهایت کسب بازدهی بهینه سرمایه‌گذاران صورت می‌گیرد.

## برنامه‌های و فعالیت‌های آتی:

اهم برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی صندوق بشرح زیر می‌باشد:

۱. افزایش دارایی‌ها (شرکت‌های تحت مدیریت) موضوع بازاریابی
۲. تلاش در جهت جذب سرمایه‌های بیشتر و افزایش تعداد واحدهای صادره
۳. حفظ ارزش آورده دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری و کسب بازدهی حداکثری از دارایی‌های موضوع بازارگردانی