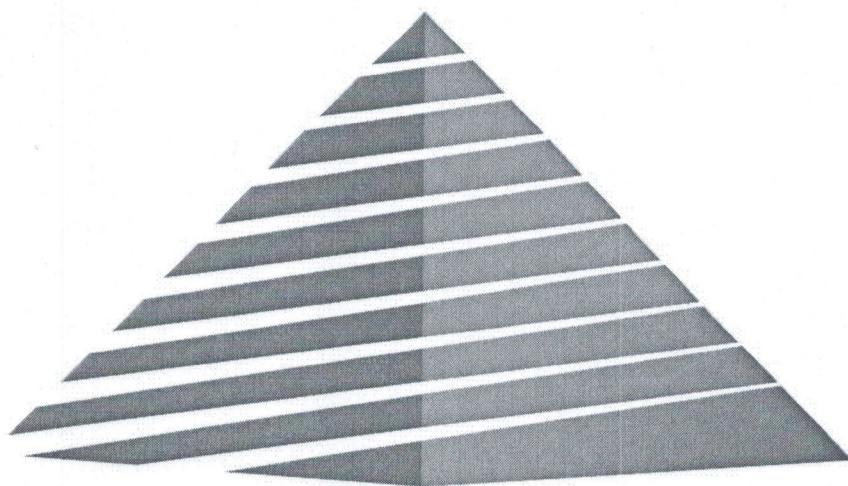




صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰

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:
۳		اطلاع رسانی :
۴		صورت خالص دارائی ها:
۵		سود (زیان) حاصل از فروش سهام:
۵		سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام:
۶		خرید و فروش سهام:
۸		ترکیب داراییهای صندوق :
۹		خلاصه عملکرد صندوق:

امضاء

نام و نام خانوادگی

سید عماد عطری

شرکت سبدگردان الگوریتم

مدیر 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 صرفه جویی‌های 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 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، 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، قلعهک، کوچه شریف، پلاک ۵.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰

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 سب‌گردان 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
	جمع		۴۲۹.۸۱۱	۳۷.۱۴

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 درج گردیده است.

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

صورت خالص دارایی‌ها:

دارایی‌ها :

۱۳۹۹/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۰۶/۳۱
ریال	ریال
۱۸۲.۴۶۱.۶۷۴.۸۶۵	۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱
۱۲.۲۶۲.۵۴۴.۸۷۲	۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱
۷.۲۷۳.۲۰۶.۴۰۴	۲۰.۲۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴
۱۱۹.۴۴۳.۱۲۵.۲۶۸	۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳
۱۱.۷۵۸.۳۷۴.۴۴۸	۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳
۸۳.۷۶۴.۳۳۸	۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲
۳۳۳.۲۸۲.۶۹۰.۱۹۵	۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴

سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم

سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی

سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

صندوق های سرمایه گذاری

حسابهای دریافتی

سایر دارایی ها

جمع دارایی‌ها

بدهی‌ها :

(۵۱.۱۴۱.۸۲۹.۰۹۶)	(۴۳۱.۶۵۹.۹۲۱.۱۱۸)
(۱.۶۶۸.۸۹۲.۲۵۱)	(۱۰۰.۷۸۲.۵۸۳.۵)
(۷۰۰.۷۳۴.۶۳۸)	(۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵)
(۵۳.۵۱۱.۴۵۵.۹۸۵)	(۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸)
۲۷۹.۷۷۱.۲۳۴.۲۱۰	۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶
۲.۷۱۴.۱۱۸	۱.۱۴۷.۹۶۵

جاری کارگزاران

بدهی به ارکان صندوق

سایر حسابهای پرداختی و ذخایر

جمع بدهی‌ها

خالص دارایی‌ها

خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری

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	۹۱۳.۰۰۶.۳۶۳.۰۷۰	۹۴۶.۴۰۱.۰۱۷.۶۰۷	(۱.۸۲۹.۳۲۱.۲۸۹)	(۳۵.۲۲۳.۹۷۵.۸۲۶)
سرمایه گذاری 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	(۵۰۸.۲۶۹.۱۹۳)	(۴۱.۶۷۲.۳۱۵.۲۲۱)
داروسازی سینا	۳۳.۱۳۲.۲۳۹	۸۳۹.۲۰۳.۳۶۳.۷۰۰	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	۴۰.۹۲۱۸.۴۸۰	۴۰.۵۶۱۷.۳۶۰	(۳.۶۰۱.۱۲۰)	۰
جمع	۳۱۵.۸۳۴.۹۸۲	۳.۸۹۸.۷۰۷.۸۱۰.۴۱۲	۴.۱۷۲.۸۰۵.۹۹۲.۳۱۸	(۴.۹۷۲.۰۰۹.۳۰۷)	(۲۷۹.۰۷۰.۱۹۱.۱۱۳)

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
جمع	۷۸۲.۴۴۹.۴۹۹	۷.۸۶۵.۱۷۱.۸۲۲.۸۳۹	۷.۸۶۱.۸۲۳.۸۸۳.۴۳۸	(۲۶۴.۹۷۰.۹۸۹)	۳.۰۸۲.۹۶۸.۴۱۲

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)
سرمایه گذاری 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
جمع	۷۵.۲۵۸.۵۶۱	۵۷۱.۴۱۵.۰۴۰.۴۳۴	۶۴۳.۳۹۳.۶۵۱.۱۸۳	(۴۳۴.۲۷۵.۴۳۱)	(۷۲.۴۱۲.۸۸۶.۱۸۲)

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:

طی سال سهام	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)	طی سال سهام
داروسازی سینا	۴۴.۱۹۶.۹۰۶	۳۳.۱۳۲.۲۳۹	۱.۱۴۳.۵۱۷.۴۳۰.۳۲۸	۸۳۸.۵۵۰.۹۰۷.۳۶۷	
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۵.۸۷۳.۶۴۲	۷۰.۷۰۶۲۳	۲۶۸.۴۱۳.۱۲۵.۰۳۱	۳۱۲.۵۵۳.۸۱۰.۶۶۵	
ویتانا	۱۰.۹۴۴.۱۴۰	۱۳.۷۸۲.۱۳۶	۵۱۸.۷۱۵.۶۳۱.۸۸۰	۵۴۵.۳۷۲.۰۶۶.۲۲۳	
بیمه سرمد	۸۲.۳۹۵.۳۵۱	۶۶.۵۲۸.۲۶۷	۵۷۳.۵۸۹.۶۵۴.۸۵۷	۴۲۷.۲۸۶.۶۶۵.۲۶۴	
باما	۶۱.۱۰۵.۴۶۹	۵۳.۲۲۳.۷۱۴	۱.۱۱۰.۱۲۶.۷۱۳.۲۳۶	۹۱۱.۱۷۷.۰۴۱.۷۸۱	
سرمایه گذاری صنایع ایران	۴۵.۰۶۶.۶۲۰	۳۹.۲۷۴.۰۸۳	۴۵۰.۹۷۲.۱۷۲.۱۶۹	۳۸۹.۶۴۱.۴۱۸.۲۰۳	
بیمه رازی	۳۹.۳۳۹.۲۱۰	۳۴.۶۰۱.۶۰۷	۳۰۸.۵۱۴.۰۶۴.۵۶۰	۲۵۱.۱۱۱.۵۹۸.۲۹۳	
پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	۶۸.۱۸۷.۸۶۷	۲۵۹.۳۰۸.۹۹۱.۲۷۰	۲۱۷.۶۳۶.۶۷۶.۰۴۹	
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۷۶۹.۴۱۲.۱۵۱	۶۹۱.۸۲۸.۹۲۴	۷.۷۱۵.۱۲۱.۳۰۳.۶۳۳	۶.۹۳۸.۷۲۸.۳۲۳.۷۳۹	
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۹۶.۳۸۲.۳۵۹	۹۰.۶۲۰.۵۷۵	۹۸۰.۸۹۲.۱۶۶.۵۴۳	۹۲۶.۱۷۸.۵۲۸.۱۱۱	

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۹/۳۰)

طی دوره سهام	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار	طی دوره سهام
داروسازی سینا	۱۲.۴۹۸.۴۲۳	۴۵.۰۰۴.۴۴۰	۲۷/۷۷	
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی	۶.۷۶۱.۴۴۸	۴۸.۴۸۹.۸۳۶	۱۳/۹۴	
ویتانا	۱۳.۳۹۴.۹۸۰	۲۰۶.۹۰۲.۷۱۳	۶/۴۷	
بیمه سرمد	۴۰.۵۵۲.۸۹۲	۲۰۵.۹۴۲.۳۵۹	۱۹/۶۹	
باما	۴.۷۶۳.۲۷۱	۴۰.۵۷۶.۵۴۳	۱/۱۷	
سرمایه گذاری صنایع ایران	۱۶.۸۷۵.۵۱۱	۱۷۰.۴۰۹.۴۲۵	۹/۹۰	
بیمه رازی	۸.۸۳۲.۵۷۵	۲۶۸.۷۲۷.۵۱۵	۳/۲۸	
س پتروشیمی ساختمان خلیج فارس	۴۳.۲۱۶.۹۷۱	۴۳۴.۰۲۰.۰۰۲	۹/۹۶	
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۵۷۰.۸۱۱.۶۹۴	۷۴۸.۳۶۹.۹۵۹	۷۶/۲۷	
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۸۱.۴۷۹.۶۰۶	۱۰.۹۶۰.۱۲.۴۳۳	۷/۴۳	

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

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰)

طی دوره سهام	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
داروسازی سینا	۳۱.۲۱۸.۴۹۵	۹۶.۹۳۶.۸۹۱	۳۲/۲۰
توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی*	۶.۱۸۲.۸۱۷	۶۸.۵۵۹.۶۱۱	۹/۰۱
ویتانا*	۱۰.۲۷۸.۹۷۰	۱۹۱.۶۹۹.۰۰۵	۵/۳۶
بیمه سرمد	۷۳.۲۷۳.۴۸۸	۲۹۶.۰۲۳.۶۷۱	۲۴/۷۵
باما	۲۰.۵۲۵.۴۶۱	۲.۷۷۳.۴۴۳.۴۶۴	۰/۷۴
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۶.۹۱۱.۷۹۹	۲۸۰.۲۹۸.۴۹۱	۹/۶۰
بیمه رازی	۲۸.۹۸۷.۰۲۴	۳۹۷.۸۴۵.۰۸۵	۷/۲۸
س پتروشیمی ساختمان خلیج فارس*	۷۰.۶۰۱.۸۶۷	۵۴۸.۸۷۶.۵۳۰	۱۲/۸۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳۹۵.۳۹۰.۲۳۴	۵۰۷.۲۰۲.۳۲۳	۷۷/۹۵
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۴۲.۹۹۵.۶۱۴	۷۰.۴۳۳۵.۰۷۱	۶/۱۰

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱)

طی دوره سهام	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
داروسازی سینا	۱۳.۹۴۵.۴۹۵	۳۲.۰۰۲.۷۲۱	۴۳.۵۷
بیمه سرمد	۵۰۰۹.۰۸۴	۳۴.۸۴۹.۵۶۶	۱۴/۳۷
باما	۳۲.۷۴۷.۰۸۲	۱۰۸۱.۸۲۹.۷۸۸	۳/۰۲
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۱.۱۶۹.۳۲۸	۳۱.۶۰۴.۵۴۸	۳۵/۳۴
بیمه رازی	۱۷.۰۷۲.۱۳۵	۳۳۰.۳۷۲.۴۷۷	۵/۱۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳۳۹.۶۸۷.۷۸۲	۱۶۳.۸۶۶.۰۴۴	۲۰۷/۲۹
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۲۹.۷۹۸.۷۱۰	۱۹۷.۹۳۵.۶۹۷	۱۵/۰۵

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱)

طی دوره سهام	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
داروسازی سینا	۱۹.۶۶۶.۷۳۲	۵۵.۲۷۹.۹۱۳	۳۵.۵۷
بیمه سرمد	۳۰۰۸۸.۱۵۴	۱۴۲.۷۵۶.۴۹۳	۲۱/۰۷
باما	۵۶.۲۹۳.۳۶۹	۲.۸۵۷.۲۰۳.۰۹۱	۱/۹۷
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۹.۳۸۴.۰۶۵	۱۶۷.۹۳۶.۲۳۹	۱۷/۴۹
بیمه رازی	۱۹.۰۴۹.۰۸۳	۱.۳۸۱.۱۱۰.۶۵۸	۱/۳۷
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۵۵.۳۵۱.۳۶۵	۱۳۸.۴۹۶.۲۶۴	۱۱۲/۱۷
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۲.۷۲۹.۰۰۴	۳۳۱.۸۰۵.۶۹۵	۹/۸۶

* لازم به ذکر است سهام شرکت‌های ویتانا، توسعه فناوری اطلاعات خوارزمی و سرمایه‌گذاری پتروشیمی ساختمان خلیج فارس طبق مصوبات مجامع مورخ ۱۳۹۹/۱۱/۱۲، ۱۳۹۹/۱۱/۲۰ و ۱۳۹۹/۱۲/۲۵ صندوق از اوراق بهادار موضوع بازارگردانی حذف شده‌اند.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



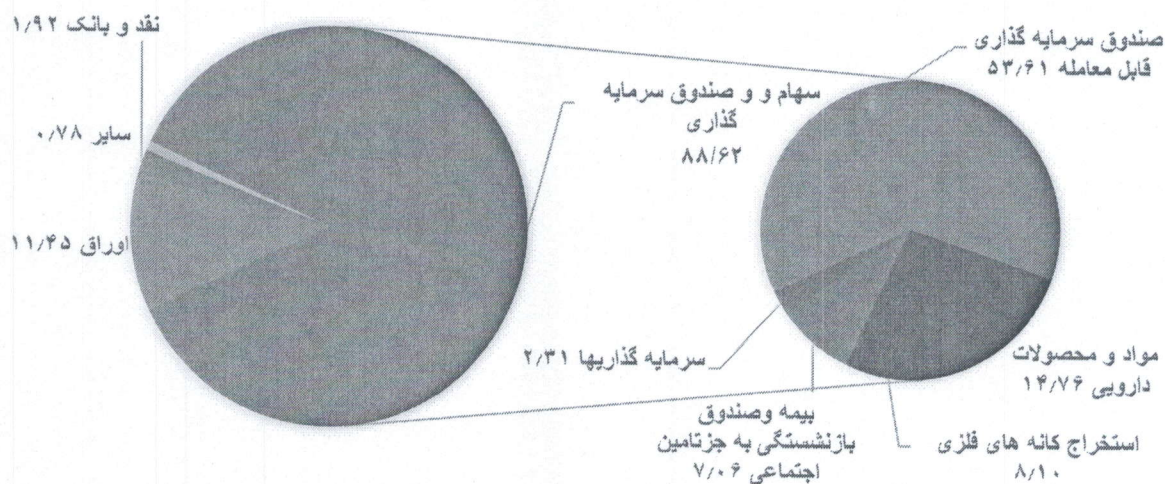
ترکیب داراییهای صندوق:

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)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)
سهام	۱۳۳.۵۶۴	۴۲/۱۷	۶۱۶.۷۷۵	۳۴/۱۷	۵۸۹.۶۶۰	۳۲/۰۸	۵۷۰.۹۸۰	۳۲/۲۳
اوراق	۳۴.۰۲۳	۱۰/۷۴	۱۷۵.۷۲۲	۹/۷۳	۲۱۱.۷۸۱	۱۱/۵۲	۲۰۲.۸۲۱	۱۱/۴۵
وجه نقد	۳۱.۴۵۳	۹/۹۳	۱۰۲.۵۹۶	۵/۶۸	۷۴.۹۷۲	۴/۰۸	۳۳.۹۷۲	۱/۹۲
سایر دارایی‌ها	۴.۶۷۱	۱/۴۷	۱۲.۷۷۲	۰/۷۱	۱۴.۸۸۱	۰/۸۱	۱۳.۹۳۳	۰/۷۹
میزان ۵ سهم با بیشترین وزن در پورتفوی سهام صندوق	۱۳۲.۳۰۰	۴۱/۷۷	۵۹۶.۸۸۸	۳۳/۰۷	۵۸۹.۶۶۰	۳۲/۰۸	۵۷۰.۹۸۰	۳۲/۲۳
صندوق سرمایه‌گذاری	۶۶۰.۲۹۶	۲۰۸/۴۷	۸۹۷.۲۵۳	۴۹/۷۱	۹۴۶.۷۱۲	۵۱/۵۱	۹۴۹.۷۷۸	۵۳/۶۱

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *

نمودار ترکیب دارایی:

خالص دارایی‌ها



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۰



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

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

شرح

خالص ارزش دارایی‌ها	۱.۳۳۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	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 توانمندی های تیم مدیریتی و کارشناسی نهایت بهره ی لازم برده شده و با توجه به فرصت ها و تهدیدات پیش رو، جهت‌گیری های اصلی صندوق در جهت نقدشوندگی هر چه بیشتر سهام تحت مدیریت و کاهش نوسان سهام مورد بازارگردانی می باشد و در نهایت کسب بازدهی بهینه سرمایه گذاران صورت می‌گیرد.

برنامه های و فعالیت های آتی:

اهم برنامه ها و فعالیت های آتی صندوق بشرح زیر می باشد:

۱. افزایش دارایی ها (شرکت های تحت مدیریت) موضوع بازارپایی
۲. تلاش در جهت جذب سرمایه های بیشتر و افزایش تعداد واحدهای صادره
۳. حفظ ارزش آورده دارندگان واحدهای سرمایه گذاری و کسب بازدهی حداکثری از دارایی های موضوع بازارگردانی