

**صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم**

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم برای دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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 دارائی‌ها:
۴	سود (زیان) حاصل از فروش سهام:
۵	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام:
۶	خرید و فروش سهام:
۷	ترکیب دارائیهای صندوق:
۸	خلاصه عملکرد صندوق:
۹	استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق:
۹	برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی:

امضاء

نام و نام خانوادگی

شرکت سیدگردان الگوریتم

حامد حامدی نیا

مدیر صندوق





صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی کوشا الگوریتم 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 با نام بازارگردانی آینده‌نگر توسعه سینا به ثبت رسیده است. به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۳۹۸/۱۰/۱۵ نام صندوق 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 تأمین منافع سرمایه‌گذاران است. مطابق مصوبات مجمع مورخ ۱۳۹۸/۰۶/۱۷ و موافقت 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 یافت. همچنین به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۴۰۰/۱۱/۰۹ مدت فعالیت صندوق به مدت سه سال تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۵ تمدید گردید. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، 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 پذیرهنویسی 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 پذیرهنویسی 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: 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 تهران، خیابان کریم‌خان زند، خیابان دکتر عضدی (آبان جنوبی) شماره ۵۲، طبقه دوم.

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

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند 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. لیکن مطابق تأییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار دوره زمان فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۵ تمدید شده است. 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 واحد سرمایه‌گذاری است، در زمان تأسیس کلاً توسط مؤسسان صندوق خریداری شده است. 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 :

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز
۱	شرکت سبذگردان الگوریتم	ممتاز	۱۳.۰۰۰	۵۲
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز	۷.۰۰۰	۲۸
۳	شرکت تأمین سرمایه سپهر	ممتاز	۴.۰۰۰	۱۶
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز	۱.۰۰۰	۴
	جمع		۲۵.۰۰۰	۱۰۰

اطلاع‌رسانی:

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



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا گوریتیم
گزارش عملکرد
دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

صورت خالص دارایی‌ها:

۱۴۰۰/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	دارایی‌ها:
ریال	ریال	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱	۴۰۷.۳۲۵.۸۴۳.۳۰۰	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱	۱.۴۵۶.۳۷۲.۱۱۲	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با در آمد ثابت یا
۲۰۲.۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴	۸۱۴.۲۵۴.۷۹۲.۸۸۹	علی‌الحساب
۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳	۷۹۳.۲۶۲.۴۹۷.۴۶۷	صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳	۵۲۸.۸۹۶.۲۳۲	حساب‌های دریافتی
۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲	۳۹۷.۶۷۰.۹۶۵	سایر دارایی‌ها
.	۳۱.۶۷۹.۷۳۱.۱۴۲	جاری کارگزاران
۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴	۲.۰۴۸.۹۰۵.۸۰۴.۱۰۷	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
(۴۳۱.۶۵۹.۹۲۱.۱۱۸)	.	جاری کارگزاران
(۱۰۰.۰۷۸.۲۰۵.۸۳۵)	(۴.۵۸۴.۸۲۸.۸۰۰)	بدهی به ارکان صندوق
.	(۱.۰۲۴.۷۰۵)	پرداختی به سرمایه‌گذاران
.	(۲۴۲.۷۳۰.۲۶۷.۰۹۷)	تسهیلات مالی دریافتی
.	(۲۲.۲۴۰.۷۶۱.۰۱۵)	پیش‌دریافت
(۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵)	(۱.۵۴۷.۹۶۳.۶۲۷)	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
(۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸)	(۲۷۱.۱۰۴.۸۴۵.۲۴۴)	جمع بدهی‌ها
۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	۱.۷۷۷.۸۰۰.۹۵۸.۸۶۳	خالص دارایی‌ها
۱.۱۴۷.۹۶۵	۱.۱۸۴.۷۹۱	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

زیان حاصل از فروش سهام و حق تقدم سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس:

نام شرکت	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد و مالیات (ریال)	زیان فروش
باما	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۲۲۷.۸۵۶.۵۷۶.۰۵۰	۲۵۴.۹۶۶.۸۸۰.۷۱۸	(۱۰۲.۹۲۰.۰۹۸)	(۲۷.۲۱۳.۲۲۴.۷۶۶)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۵.۴۳۹.۵۷۶	۱۲۰.۱۴۷.۹۸۰.۶۲۵	۱۳۷.۵۱۷.۱۳۳.۱۶۶	(۹۱.۳۰۹.۵۸۵)	(۱۷.۴۶۰.۴۶۲.۱۲۶)
بیمه سرمد	۱۴.۹۲۷.۴۲۲	۶۹.۸۴۶.۷۳۶.۴۳۳	۷۰.۵۹۳.۴۱۶.۵۰۴	(۵۳.۰۸۲.۴۶۹)	(۷۹۹.۷۶۲.۵۴۰)
بیمه رازی	۱۰۷.۶۳۷.۰۰۲	۱۴۰.۳۳۱.۹۹۲.۵۳۶	۱۵۳.۵۹۰.۴۸۱.۶۶۹	(۱۰۶.۶۴۹.۰۷۸)	(۱۳.۳۶۵.۱۳۸.۲۱۱)
داروسازی سینا	۷.۲۰۸.۴۱۰	۱۴۸.۰۴۱۰.۳۷.۱۸۰	۱۴۷.۹۷۵.۵۴۲.۳۵۲	(۱۱۲.۵۰۹.۷۴۹)	(۴۷.۰۱۴.۹۲۱)
جمع	۱۸۰.۵۱۰.۱۳۶	۷۰۶.۲۲۴.۳۳۲.۸۲۴	۷۶۴.۶۴۳.۴۵۴.۴۰۹	(۴۶۶.۴۷۰.۹۷۹)	(۵۸.۸۸۵.۶۰۲.۵۶۴)



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتیم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

سود حاصل از فروش واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری:

نام صندوق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود فروش
ارزش آفرین بیدار	۶۹۸۹۵.۱۵۲	۶۷۸.۴۵۴.۷۹۶.۵۰۰	۶۶۵.۵۲۴.۲۴۷.۴۵۸	(۶۹۰.۱۹.۳۸۸)	۱۲.۸۶۱.۵۲۹.۶۵۴
دارا الگوریتیم	۱۲۸.۷۹۵.۰۲۴	۱.۲۹۷.۳۶۵.۰۷۰.۶۳۱	۱.۲۹۲.۵۱۴.۰۳۹.۶۲۲	(۲۸.۰۷۴.۹۰۸)	۴.۸۲۲.۹۵۶.۱۰۱
جمع	۱۹۸.۶۹۰.۱۷۶	۱.۹۷۵.۸۱۹.۸۶۷.۱۳۱	۱.۹۵۸.۰۳۸.۲۸۷.۰۸۰	(۹۷۰.۹۴.۲۹۶)	۱۷.۶۸۴.۴۸۵.۷۵۵

زیان حاصل از فروش اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	زیان فروش
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ ماهه ۲۰٪	۲.۵۱۰	۲.۵۱۰.۰۰۰.۰۰۰	۲.۵۱۰.۰۰۰.۳۴۸۷	(۳۶۳.۹۵۰)	(۳۶۷.۴۳۷)
جمع	۲.۵۱۰	۲.۵۱۰.۰۰۰.۰۰۰	۲.۵۱۰.۰۰۰.۳۴۸۷	(۳۶۳.۹۵۰)	(۳۶۷.۴۳۷)

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

نام شرکت	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد و مالیات (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
داروسازی سینا	۱۴.۲۵۱.۵۹۲	۲۸۰.۷۵۶.۳۶۲.۳۹۹	۲۹۰.۳۳۸.۷۲۱.۴۷۷	(۲۱۳.۳۷۴.۸۳۵)	(۹.۷۹۵.۷۳۳.۹۱۳)
بیمه سرمد	۳۹.۶۱۷.۶۸۷	۹۵.۱۲۲.۰۶۶.۴۸۷	۹۶.۵۱۱.۸۴۱.۵۴۳	(۷۲.۲۹۲.۷۷۱)	(۱.۴۶۲.۰۶۷.۸۲۷)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲.۴۳۷.۵۶۲	۱۰.۳۴۰.۱۳۸.۰۰۴	۱۰.۳۸۹.۵۰۳.۴۵۱	(۷.۸۵۸.۵۰۵)	(۵۷.۲۲۳.۹۵۲)
بیمه رازی	۱۳.۸۴۴.۲۶۶	۲۱.۴۱۷.۰۷۹.۵۰۱	۱۸.۰۶۰.۲۳۲.۲۶۶	(۱۶.۲۷۶.۹۸۰)	۳.۳۴۰.۵۷۰.۲۵۵
جمع	۷۰.۱۵۱.۱۰۷	۴۰۷.۶۳۵.۶۴۶.۳۹۱	۴۱۵.۳۰۰.۲۹۸.۷۳۷	(۳۰۹.۸۰۳.۰۹۱)	(۷.۹۷۴.۴۵۵.۴۳۷)

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری:

نام صندوق	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
دارا الگوریتیم	۵۵.۷۶۲.۸۶۷	۵۵۹.۰۲۲.۷۴۱.۶۷۴	۵۵۹.۹۸۵.۷۹۰.۸۵۳	(۱۲.۵۷۸.۰۱۲)	(۹۷۵.۶۲۷.۱۹۱)
ارزش آفرین بیدار	۲۵.۱۶۷.۳۴۵	۲۳۴.۳۰۷.۹۸۱.۹۵۰	۲۲۵.۸۷۹.۵۳۹.۵۵۰	(۵۵.۶۴۸.۱۴۶)	۸.۳۷۲.۷۹۴.۲۵۴
جمع	۸۰.۹۳۰.۲۱۲	۷۹۳.۳۳۰.۷۲۳.۶۲۴	۷۸۵.۸۶۵.۳۳۰.۴۰۳	(۶۸.۲۲۶.۱۵۷)	۷.۳۹۷.۱۶۷.۰۶۴

زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	زیان تحقق نیافته نگهداری
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ ماهه ۲۰٪	۵۰.۰۹۶	۵۰.۰۹۶.۰۰۰.۰۰۰	۵۰.۰۹۶.۴۳۰.۰۶۳	(۷.۲۶۳.۹۲۰)	(۷.۶۹۳.۹۸۳)
جمع	۵۰.۰۹۶	۵۰.۰۹۶.۰۰۰.۰۰۰	۵۰.۰۹۶.۴۳۰.۰۶۳	(۷.۲۶۳.۹۲۰)	(۷.۶۹۳.۹۸۳)

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۳۰/۰۹/۱۴۰۰):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
داروسازی سینا	۵۶۸۹.۴۸۳	۴۸۴۷.۶۷۴	۱۱۶.۰۴۱.۱۲۹.۰۸۱	۱۰۰.۳۱۷.۱۶۲.۲۳۰
بیمه سرمد	۳.۴۶۵.۹۷۱	۵.۵۳۵.۳۶۱	۱۷.۹۷۴.۶۸۲.۷۴۰	۲۸.۲۱۸.۶۳۳.۶۰۱
باما	۱۱.۹۵۶.۲۲۰	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۱۱۱.۵۲۱.۳۷۷.۶۵۸	۲۲۷.۷۵۳.۶۵۵.۹۵۲
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۵.۳۹۶.۴۲۶	۱۴.۲۷۵.۵۹۲	۸۰.۱۰۳.۷۵۷.۰۰۸	۷۳.۹۷۸.۳۱۳.۲۰۹
بیمه رازی	۱۶.۰۹۴.۸۷۲	۶.۸۲۱.۹۳۸	۲۸.۲۰۵.۵۱۴.۴۱۵	۱۳.۹۱۲.۲۸۲.۱۳۲
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۴۳.۸۷۴.۶۱۵	۲۹.۱۰۰.۱۱۰	۴۳۹.۱۰۴.۹۷۶.۱۸۸	۲۹۱.۵۳۶.۰۴۹.۵۸۳
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۴.۷۸۷.۵۳۱	۳۱.۱۱۹.۵۶۶	۳۴۶.۶۶۸.۰۵۰.۷۹۴	۳۱۹.۰۶۵.۴۶۱.۲۶۰

خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۲۹/۱۲/۱۴۰۰):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
شرکت داروسازی سینا	۳.۰۹۲.۵۹۱	۲.۳۶۰.۷۳۶	۶۰.۷۹۹.۵۷۱.۸۷۸	۴۷.۶۱۱.۳۶۵.۲۰۱
شرکت بیمه سرمد	۱۶.۲۲۸.۵۷۹	۹.۳۹۲.۰۶۱	۷۳.۲۹۵.۹۹۰.۶۵۵	۴۱.۵۷۵.۰۲۰.۳۶۳
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۶.۶۸۸.۱۷۵	۱۱.۱۶۲.۹۸۴	۲۶.۸۲۲.۸۸۶.۱۳۳	۴۶.۰۷۸.۳۵۷.۸۳۱
شرکت بیمه رازی	۷۷.۸۰۶.۸۹۰	۱۰۰.۸۱۵.۰۶۴	۹۴.۱۹۸.۰۷۸.۵۷۷	۱۲۶.۳۱۳.۰۶۱.۳۲۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۵۷.۸۶۸.۸۵۸	۹۹.۶۹۴.۹۱۴	۵۸۰.۳۸۳.۳۶۶.۸۰۷	۱۰۰.۵۸۰.۰۹۴.۱۴۰
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۴۸.۵۱۳.۱۸۲	۳۸.۷۷۵.۵۸۶	۴۲۷.۹۶۸.۹۶۰.۳۹۱	۳۵۹.۳۲۰.۳۱۵.۸۵۲
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۲۶۰۶	۲.۵۱۰	۵۲.۶۰۶.۴۳۳.۵۵۰	۲.۵۰۹.۶۳۶.۰۵۰

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۳۰/۰۹/۱۴۰۰):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۱۰.۵۳۷.۱۵۷	۱۶.۱۲۳.۰۱۸	۶۵/۳۵
شرکت بیمه سرمد	۹.۰۰۱.۳۳۲	۴۳.۷۰۲.۴۴۵	۲۰/۶۰
شرکت باما	۳۷.۲۵۳.۹۴۶	۱.۷۲۹.۲۸۵.۶۵۴	۲/۱۵
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۹.۶۷۲.۰۱۸	۱۱۲.۵۴۳.۲۶۸	۲۶/۳۶
شرکت بیمه رازی	۲۲.۹۱۶.۸۱۰	۲۳۱.۵۵۶.۲۵۶	۹/۹۰
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۷۲.۹۷۴.۷۲۵	۱۲۲.۵۶۷.۴۲۸	۵۹/۵۴
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۶۵.۹۰۷.۰۹۷	۲۱۷.۱۰۶.۸۰۱	۳۰/۳۶

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۲۹/۱۲/۱۴۰۰):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۵.۴۵۳.۳۲۷	۱۹.۷۶۸.۶۹۲	۲۷/۵۹
شرکت بیمه سرمد	۲۵.۶۲۰.۶۴۰	۱۵۰.۴۰۴.۴۱۹	۱۷/۰۳
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۷.۸۵۲.۱۵۹	۶۷.۴۴۹.۹۴۹	۲۶/۴۷
شرکت بیمه رازی	۱۷۸.۶۲۱.۹۵۴	۱.۷۶۷.۳۱۸.۰۲۵	۱۰/۱۱
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۵۷.۵۶۳.۷۷۲	۱۹۷.۷۸۸.۶۹۷	۷۹/۶۶
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۸۷.۲۸۸.۷۶۸	۱۶۱.۳۷۴.۸۷۷	۵۴/۰۹
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۵.۱۱۶	۱.۰۰۵.۱۱۶	۵/۴۸

ترکیب دارایی‌های صندوق:

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		۱۴۰۰/۱۲/۲۹
	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)
سهام	۳۶/۷۶	۴۳۶.۰۰۶	۲۴/۷۳	۴۳۴.۷۱۶	۲۳/۳۷	۴۰۷.۳۲۵	۱۹/۸۸
اوراق	۱۲/۴۱	۳۳۷.۶۲۵	۱۹/۱۵	۶۵۰.۸۳۵	۳۴/۹۹	۸۱۴.۲۵۴	۳۹/۷۴
وجه نقد	۷/۴۴	۳۳.۴۶۰	۱/۹	۳۶.۱۳۶	۱/۹۴	۱.۴۵۶	۰/۰۷
سایر دارایی‌ها	۱/۳۸	۲۷.۱۸۵	۱/۵۴	۷.۱۶۷	۰/۳۹	۳۲.۶۰۶	۱/۵۹
صندوق سرمایه‌گذاری	۱۷۵/۰۷	۹۲۸.۸۱۰	۵۲/۶۸	۷۳۰.۹۵۷	۳۹/۳	۷۹۳.۲۶۲	۳۸/۷۲

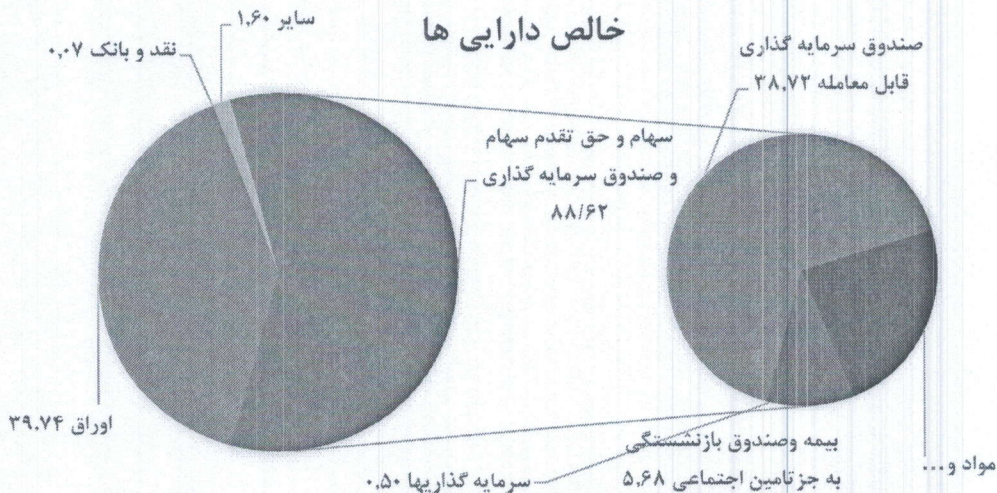
مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد*

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

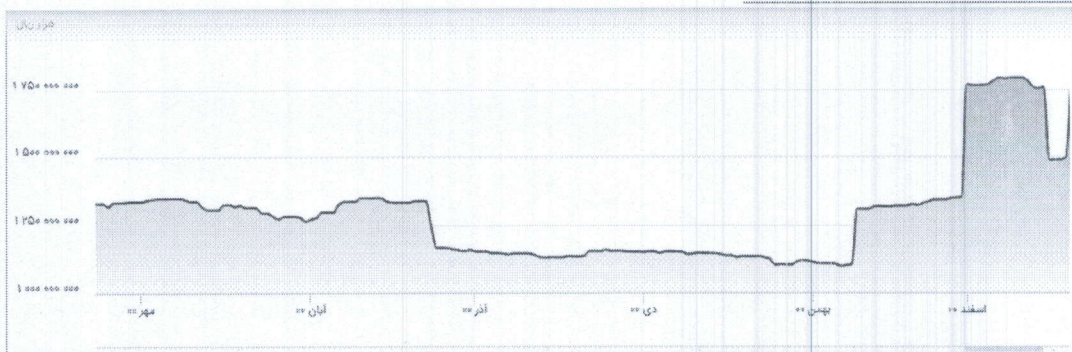
گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

نمودار ترکیب دارایی:



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم		
سال مالی منتهی به	دوره مالی شش ماهه منتهی	شرح
۱۴۰۰/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹ به	خالص ارزش روز دارایی‌ها (ریال)
۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	۱.۷۷۷.۸۰۰.۹۵۸.۸۶۳	قیمت صدور هر واحد (ریال)
۱.۱۴۸.۹۹۷	۱.۱۸۵.۹۷۶	قیمت ابطال هر واحد (ریال)
۱.۱۴۷.۹۶۵	۱.۱۸۴.۷۹۱	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری
۱.۱۵۷.۲۵۹	۱.۵۰۰.۵۱۸	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



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، جهت نقدشوندگی هر چه بیشتر اوراق بهادار موضوع بازارگردانی تحت مدیریت و کاهش نوسان آن و در نهایت کسب بازدهی بهینه سرمایه‌گذاران می‌باشد.

برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی:

اهم برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی صندوق بشرح زیر می‌باشد:

۱. افزایش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی،
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،