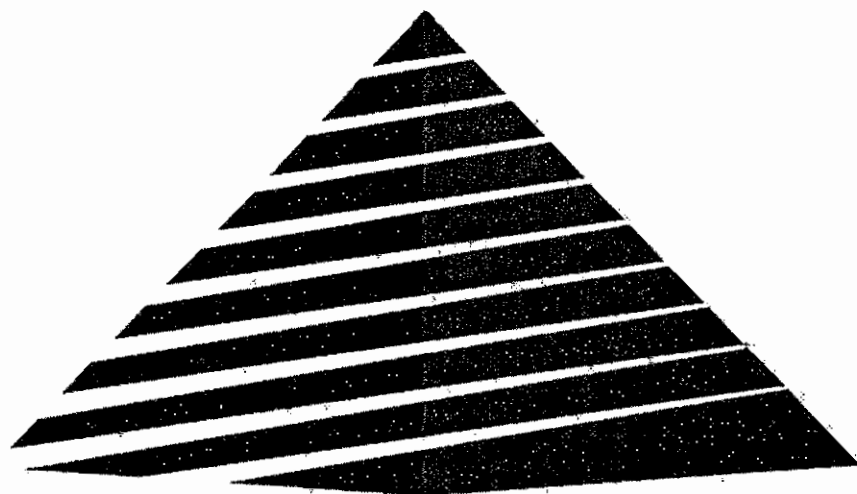




**صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم**

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی 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 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: 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 کوکا 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 ۲۵۰۰۰ 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 ۲۴۷۵۰۰۰ 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	نوع واحد	تعداد واحد	درصد از کل واحدهای ممتاز
۱	شرکت سبذگردان الگوریتم	ممتاز	۱۳۰۰۰	۵۲
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز	۷۰۰۰	۲۸
۳	شرکت تأمین سرمایه سپهر	ممتاز	۴۰۰۰	۱۶
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز	۱۰۰۰	۴
			۲۵۰۰۰	

اطلاع‌رسانی:

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



انحصار مصرف برای هر واحد - خزانه گنجینه ملی -

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰

صورت خالص دارایی ها:

دارایی ها:	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۶/۳۱
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۴۰۷.۳۲۵.۸۴۳.۳۰۰	۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱
سرمایه گذاری در سپرده بانکی	۱.۴۵۶.۳۷۲.۱۱۲	۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با در آمد ثابت یا علی الحساب	۸۱۴.۲۵۴.۷۹۲.۸۸۹	۲۰۲.۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴
صندوق های سرمایه گذاری	۷۹۳.۲۶۲.۴۹۷.۴۶۷	۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳
حساب های دریافتی	۵۲۸.۸۹۶.۲۳۲	۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳
سایر دارایی ها	۳۹۷.۶۷۰.۹۶۵	۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲
جمع دارایی ها	۲.۰۱۷.۲۳۶.۰۷۲.۹۶۵	۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴

بدهی ها:

جاری کارگزاران	-	(۴۳۱.۶۵۹.۹۲۱.۱۱۸)
بدهی به ارکان صندوق	(۴.۵۸۴.۸۲۸.۸۰۰)	(۱۰۰.۷۸.۲۰۵.۸۳۵)
پرداختی به سرمایه گذاران	(۱۰۲۴.۷۰۵)	.
تسهیلات مالی دریافتی	(۲۱۱.۰۵۰.۵۳۵.۹۵۵)	.
پیش دریافت	(۲۲.۲۴۰.۷۶۱.۰۱۵)	.
سایر حسابهای پرداختی و ذخایر	(۱.۵۴۷.۹۶۳.۶۲۷)	(۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵)
جمع بدهی ها	(۲۳۹.۴۲۵.۱۱۴.۱۰۳)	(۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸)
خالص دارایی ها	۱.۷۷۷.۸۰۰.۹۵۸.۸۶۳	۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۱.۱۸۴.۷۹۱	۱.۱۴۷.۹۶۵

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

نام شرکت	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد و مالیات (ریال)	زیان فروش
پاما	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۲۲۷.۸۵۶.۵۷۶.۰۵۰	۲۵۴.۹۶۶.۸۸۰.۷۱۸	(۱۰۲.۹۲۰.۰۹۸)	(۲۷.۲۱۳.۲۲۴.۷۶۶)
سرمایه گذاری 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	۱۰.۷۶۳۷.۰۰۲	۱۴۰.۳۳۱.۹۹۲.۵۳۶	۱۵۳.۵۹۰.۴۸۱.۶۶۹	(۱۰۶.۶۴۹.۰۷۸)	(۱۳.۳۶۵.۱۳۸.۲۱۱)
داروسازی سینا	۷.۲۰۸.۴۱۰	۱۴۸.۰۴۱.۰۳۷.۱۸۰	۱۴۷.۹۷۵.۵۴۲.۳۵۲	(۱۱۲.۵۰۹.۷۴۹)	(۴۷.۰۱۴.۹۲۱)
جمع	۸۸.۵۰۱.۱۲۶	۶۸۶.۶۲۳.۴۴۲.۸۴۳	۷۶۴.۶۶۲.۴۵۲.۰۰۰	(۳۶۴.۳۷۸.۹۷۹)	(۵۸۸.۸۸۶.۲۵۶۲)

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

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	۶۹,۸۹۵,۱۵۲	۶۷۸,۴۵۴,۷۹۶,۵۰۰	۶۶۵,۵۲۴,۲۴۷,۴۵۸	(۶۹,۰۱۹,۳۸۸)	۱۲,۸۶۱,۵۲۹,۶۵۴
دارا الگوریتم	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	(۹۷,۰۹۴,۲۹۶)	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	۲,۵۱۰,۰۰۰,۳۴۸,۷	(۳۶۳,۹۵۰)	(۳۶۷,۳۳۷)
جمع	۲,۵۱۰	۲,۵۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۵۱۰,۰۰۰,۳۴۸,۷	(۳۶۳,۹۵۰)	(۳۶۷,۳۳۷)

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	۳۹۶,۱۷۶,۸۷	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	۱۸,۰۶۰,۳۳۲,۲۶۶	(۱۶,۲۷۶,۹۸۰)	۳,۳۴۰,۵۷۰,۲۵۵
جمع	۷۰,۱۵۱,۱۰۷	۳۰۷,۶۳۵,۶۴۶,۳۹۱	۳۱۵,۳۰۰,۲۹۸,۷۳۷	(۳۰,۹۸۰,۳۰۱)	(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 الگوریتم	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	۵۰۰,۹۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۹۶۴,۳۰۰,۰۶۳	(۷,۲۶۳,۹۲۰)	(۷,۶۹۳,۹۸۳)
جمع	۵۰,۰۹۶	۵۰۰,۹۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۹۶۴,۳۰۰,۰۶۳	(۷,۲۶۳,۹۲۰)	(۷,۶۹۳,۹۸۳)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



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

نوع معامله	مبلغ خرید	مبلغ فروش	تعداد خرید	تعداد فروش
داروسازی سینا	۱۱۶,۰۴۱,۱۲۹,۰۸۱	۴,۸۴۷,۶۷۴	۵۶۸۹,۴۸۳	۱۰۰,۳۱۷,۱۶۲,۲۳۰
بیمه سرمد	۱۷,۹۷۴,۶۸۲,۷۴۰	۵,۵۳۵,۳۶۱	۳,۴۶۵,۹۷۱	۲۸,۳۱۸,۶۳۳,۶۰۱
باما	۱۱۱,۵۲۱,۳۷۷,۶۵۸	۲۵,۲۹۷,۷۲۶	۱۱,۹۵۶,۲۲۰	۲۲۷,۷۵۳,۶۵۵,۹۵۲
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۸۰,۱۰۳,۷۵۷,۰۰۸	۱۴,۲۷۵,۵۹۲	۱۵,۳۹۶,۴۲۶	۷۳,۹۷۸,۳۱۳,۲۰۹
بیمه رازی	۲۸,۲۰۵,۵۱۴,۴۱۵	۶,۸۲۱,۹۳۸	۱۶,۰۹۴,۸۷۲	۱۳,۹۱۲,۲۸۲,۱۳۲
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۴۳۹,۱۰۴,۹۷۶,۱۸۸	۲۹,۱۰۰,۱۱۰	۴۳,۸۷۴,۶۱۵	۲۹۱,۵۳۶,۰۴۹,۵۸۳
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۴۶,۶۶۸,۰۵۰,۷۹۴	۳۱,۱۱۹,۵۶۶	۳۴,۷۸۷,۵۳۱	۳۱۹,۰۶۵,۴۶۱,۲۶۰

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

نوع معامله	مبلغ خرید	مبلغ فروش	تعداد خرید	تعداد فروش
شرکت داروسازی سینا	۶۰,۷۹۹,۵۷۱,۸۷۸	۲,۳۶۰,۷۳۶	۳,۰۹۲,۵۹۱	۴۷۶,۱۱۳,۶۵۲,۰۰۱
شرکت بیمه سرمد	۷۳,۲۹۵,۹۹۰,۶۵۵	۹,۳۹۲,۰۶۱	۱۶,۲۲۸,۵۷۹	۴۱,۵۷۵,۰۲۰,۳۶۳
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۶,۸۲۲,۸۸۶,۱۳۳	۱۱,۱۶۳,۹۸۴	۶,۶۸۸,۱۷۵	۴۶,۰۷۸,۳۵۷,۸۳۱
شرکت بیمه رازی	۹۴,۱۹۸,۰۷۸,۵۷۷	۱۰۰,۸۱۵,۰۶۴	۷۷۸,۰۶۸۹۰	۱۲۶,۳۱۳,۰۶۱,۳۲۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۵۸۰,۳۸۳,۳۶۶,۸۰۷	۹۹,۶۹۴,۹۱۴	۵۷,۸۶۸,۸۵۸	۱,۰۰۵,۸۰۰,۹۴۶,۱۴۰
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۴۲۷,۹۶۸,۹۶۰,۳۹۱	۳۸,۷۷۵,۵۸۶	۴۸,۵۱۳,۱۸۲	۲۵۹,۳۲۰,۳۱۵,۸۵۲
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ ماهه ۲۰٪	۵۲۶,۰۶,۴۳۳,۵۵۰	۲,۵۱۰	۵۲۶,۰۶	۲,۵۰۹,۶۳۶,۰۵۰

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

نوع معامله	حجم معاملات در بازار	حجم معاملات در صندوق
شرکت داروسازی سینا	۱۶,۱۲۳,۰۱۸	۱۰,۵۳۷,۱۵۷
شرکت بیمه سرمد	۴۳,۷۰۲,۴۴۵	۹,۰۰۱,۳۳۲
شرکت باما	۱,۷۲۹,۲۸۵,۶۵۴	۳۷,۲۵۳,۹۴۶
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۱۲,۵۴۳,۲۶۸	۲۹,۶۷۲,۰۱۸
شرکت بیمه رازی	۲۳۱,۵۵۶,۲۵۶	۲۲,۹۱۶,۸۱۰
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۲۲,۵۶۷,۴۲۸	۷۲,۹۷۴,۷۲۵
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۲۱۷,۱۰۶,۸۰۱	۶۵,۹۰۷,۰۹۷

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 ۱۴۰۰/۱۲/۲۹):

نوع دارایی	حجم معاملات در بازار	حجم معاملات در صندوق
شرکت داروسازی سینا	۵,۴۵۳,۳۲۷	۱۹,۷۶۸,۶۹۲
شرکت بیمه سرمد	۲۵,۶۲۰,۶۴۰	۱۵۰,۴۰۴,۴۱۹
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۷,۸۵۲,۱۵۹	۶۷,۴۴۹,۹۴۹
شرکت بیمه رازی	۱۷,۸۶۲,۱۹۵	۱,۷۶۷,۳۱۸,۰۲۵
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۵۷,۵۶۳,۷۷۲	۱۹۷,۷۸۸,۶۹۷
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۸۷,۲۸۸,۷۶۸	۱۶۱,۳۷۴,۸۷۷
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۵,۱۱۶	۱,۰۰۵,۱۱۶

ترکیب دارایی‌های صندوق:

نوع دارایی	تاریخ	حجم معاملات	حجم معاملات	حجم معاملات	حجم معاملات	حجم معاملات	حجم معاملات
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۹/۸۸	۴۰۷,۳۲۵	۲۳/۳۷	۴۳۴,۷۱۶	۲۴/۷۳	۴۳۶,۰۰۶	۳۶/۷۶
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۹/۷۴	۸۱۴,۲۵۴	۳۴/۹۹	۶۵۰,۸۳۵	۱۹/۱۵	۳۳۷,۶۲۵	۱۲/۴۱
صندوق سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۰۱/۰۷	۱,۴۵۶	۱/۹۴	۳۶,۱۳۶	۱/۹	۳۳,۴۶۰	۷/۴۴
صندوق سرمایه‌گذاری داروسازی سینا	۱/۵۹	۳۲,۶۰۶	-/۳۹	۷,۱۶۷	۱/۵۴	۲۷,۱۸۵	۱/۳۸
صندوق سرمایه‌گذاری بیمه رازی	۳۸/۷۲	۷۹۳,۲۶۲	۳۹/۳	۷۳۰,۹۵۷	۵۲/۶۸	۹۲۸,۸۱۰	۱۷۵/۰۷

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *

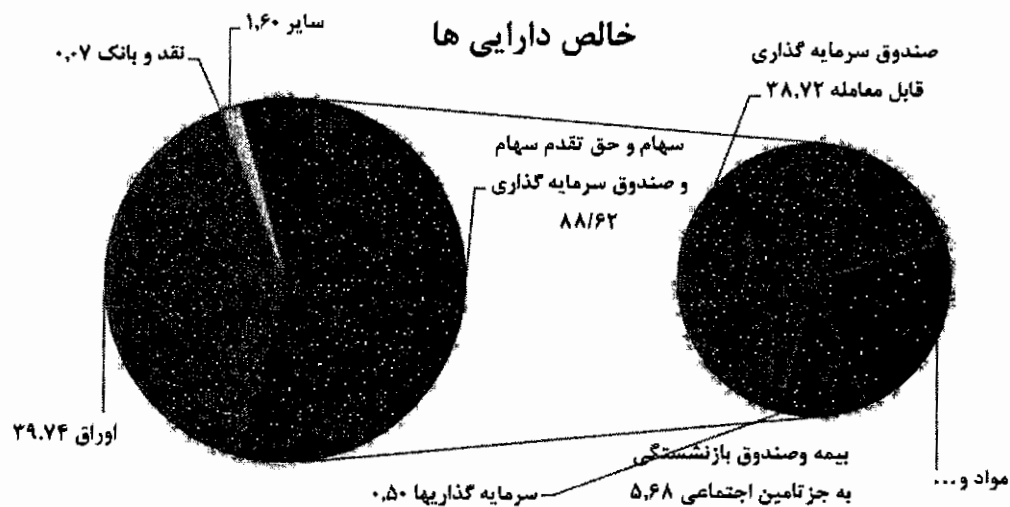
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

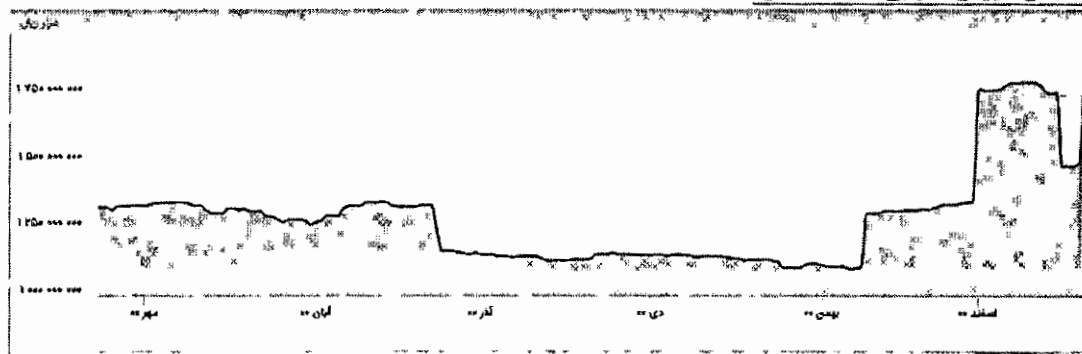
دوره مالی شش ماهه منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۰



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	
۱.۱۴۸.۹۹۷	۱.۱۸۵.۹۷۶	قیمت صدور هر واحد (ریال)
۱.۱۵۷.۲۵۹	۱.۵۰۰.۵۱۸	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری

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.