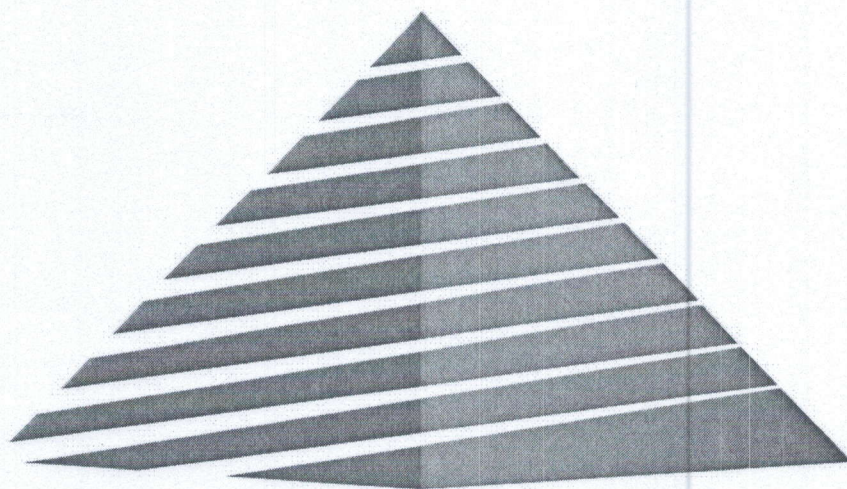




**صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم**

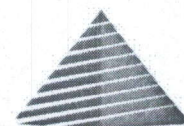
گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم برای دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱ 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 دارایی‌ها:
۴	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:
۹	استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق:
۹	برنامه ها و فعالیت های آتی:

امضاء

نام و نام خانوادگی

شرکت سیدگردان الگوریتم

حامد حامدی نیا

مدیر صندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی 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 نزد اداره ثبت شرکت‌ها با 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 است 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 نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

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 سبدگردان 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

اطلاعات رسانی:

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 الگوریتم
گزارش عملکرد
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

صورت خالص دارایی‌ها:

دارایی‌ها:

۱۴۰۰/۰۶/۳۱	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	
۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱	۵۴۳.۰۲۱.۷۰۰.۷۱۲	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱	۱۴.۲۲۰.۴۴۰.۸۰۶	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۲۰۲.۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴	۶۴۷.۹۲۵.۰۴۸.۶۵۷	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با در آمد ثابت یا
۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳	۹۳۲.۰۶۱.۶۶۰.۹۷۵	علی‌الحساب
۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳	۵۶۱.۲۶۳.۵۸۰	صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲	۷۱۱.۶۱۸.۶۷۴	حساب‌های دریافتنی
		سایر دارایی‌ها
۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴	۲.۱۳۸.۵۰۱.۷۳۳.۴۰۴	جمع دارایی‌ها

بدهی‌ها:

۱۴۰۰/۰۶/۳۱	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	
(۴۳۱.۶۵۹.۹۲۱.۱۱۸)	(۹۰.۲۲۹.۹۱۸.۴۵۵)	جاری کارگزاران
(۱۰۰.۷۸۲.۰۵۸.۸۳۵)	(۶.۱۵۵.۶۴۶.۸۹۸)	بدهی به ارکان صندوق
.	(۷۹۰.۲۳۰.۰۰۰.۰۰۰)	پرداختی به سرمایه‌گذاران
.	(۱۳۷.۶۲۵.۲۲۷.۵۲۲)	تسهیلات مالی دریافتی
.	(۱۵.۸۳۷.۰۷۴.۴۳۰)	پیش‌دریافت
(۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵)	(۱.۲۵۹.۰۳۵.۵۸۴)	سایر حسابهای پرداختنی و ذخایر
(۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸)	(۳۳۰.۱۲۹.۷۲۰.۸۸۹)	جمع بدهی‌ها
۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	۱.۸۰۸.۳۷۲.۰۱۲.۵۱۵	خالص دارایی‌ها

خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

۱.۱۴۷.۹۶۵

۱.۲۶۸.۱۱۴

سود (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 (ریال)	سود (زیان) فروش
باما	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۲۲۷.۸۵۶.۵۷۶.۰۵۰	۲۵۴.۹۶۶.۸۸۰.۷۱۸	(۱۰۲.۹۲۰.۰۹۸)	(۲۷.۲۱۳.۲۲۴.۷۶۶)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۴۳.۲۷۶.۰۰۶	۱۷۳.۶۳۳.۱۶۵.۷۲۶	۱۸۸.۲۴۸.۷۹۴.۹۳۳	(۱۳۱.۲۱۹.۲۷۳)	(۱۴.۷۴۶.۸۴۸.۴۸۰)
بیمه سرم	۳۸.۸۸۹.۷۳۵	۱۳۸.۵۷۳.۶۶۰.۴۷۰	۱۳۰.۳۴۴.۵۶۶.۱۵۵	(۱۰۰.۶۰۴.۴۳۲)	۸۰.۸۸.۴۸۹.۸۸۳
بیمه رازی	۱۸۴.۰۶۷.۷۴۱	۲۸۱.۰۰۵.۳۷۳.۳۵۶	۲۸۱.۴۷۷.۶۸۲.۰۵۶	(۲۰۶.۵۹۱.۲۴۷)	(۶۷۸.۸۹۹.۹۴۷)
داروسازی سینا	۱۱.۵۴۷.۰۲۴	۲۵۱.۴۸۶.۸۰۹.۳۵۰	۲۳۸.۱۶۴.۰۵۷.۲۳۷	(۱۸۷.۰۷۴.۳۹۹)	۱۳.۱۳۵.۶۷۷.۷۱۴
جمع	۳۰۳.۰۷۸.۲۳۲	۱.۰۷۲.۵۵۵.۵۸۴.۹۵۲	۱.۰۹۳.۲۴۱.۹۸۱.۰۹۹	(۷۲۸.۴۰۹.۴۴۹)	(۲۱.۴۱۴.۸۰۵.۵۹۶)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

سود (زیان) حاصل از فروش واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری:

نام صندوق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش
ارزش آفرین بیدار	۱۱۹.۷۲۴۶۱۷	۱.۲۲۵.۱۳۲.۶۴۷.۱۲۰	۱.۱۷۰.۲۸۳.۳۲۶.۸۳۲	(۱۶۲.۸۵۴.۷۸۸)	۵۴.۶۸۶.۴۶۵.۵۰۰
دارا الگوریتم	۳۲۴.۶۳۹.۲۷۵	۳.۲۷۳.۸۳۵.۷۰۷.۲۶۹	۳.۲۶۷.۰۹۱.۹۳۵.۶۸۹	(۸۰.۱۳۶.۸۴۳)	۶.۶۶۳.۶۳۴.۷۳۷
جمع	۴۴۴.۳۶۳.۸۹۲	۴.۴۹۸.۹۶۸.۳۵۴.۳۸۹	۴.۴۳۷.۳۷۵.۲۶۲.۵۲۱	(۲۴۲.۹۹۱.۶۳۱)	۶۱.۳۵۰.۱۰۰.۲۳۷

سود (زیان) حاصل از فروش اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ ماهه ۲۰٪	۲.۵۴۳	۲.۵۴۳.۰۵۰.۲۸۰	۲.۵۴۳.۰۰۴.۶۳۶	(۳۶۸.۷۴۲)	(۳۲۳.۰۹۸)
جمع	۲.۵۱۰	۲.۵۴۳.۰۵۰.۲۸۰	۲.۵۴۳.۰۰۴.۶۳۶	(۳۶۸.۷۴۲)	(۳۲۳.۰۹۸)

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

نام شرکت	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
داروسازی سینا	۱۴.۵۱۱.۶۵۴	۳۵۶.۲۶۱.۱۰۵.۷۰۰	۳۱۶.۲۸۰.۱۲۳.۹۹۴	(۲۱۶.۶۰۶.۷۵۲)	۳۹.۷۶۴.۳۷۴.۹۵۴
بیمه سرمد	۳۰.۱۴۸.۵۸۶	۹۳.۹۴۲.۹۹۳.۹۷۶	۷۸.۰۰۰.۸۸۸.۶۲۰	(۵۷.۱۱۷.۳۴۰)	۱۵.۸۸۴.۹۸۸.۰۱۶
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۸.۶۳۹.۸۴۲	۳۴.۰۷۳.۶۳۱.۱۷۶	۳۷.۴۰۴.۳۴۱.۲۹۰	(۲۰.۷۱۶.۷۷۰)	(۳.۳۵۱.۴۲۶.۸۸۴)
بیمه رازی	۳۳.۰۵۷.۸۲۲	۵۹.۰۷۴.۳۲۷.۹۱۴	۶۵.۱۶۱.۰۵۵.۲۴۸	(۳۵.۹۱۷.۱۹۱)	(۶.۱۲۲.۶۴۴.۵۲۵)
جمع	۹۶.۳۵۷.۹۰۴	۵۴۳.۳۵۲.۰۵۸.۷۶۶	۴۹۶.۸۴۶.۴۰۹.۱۵۲	(۳۳۰.۳۵۸.۰۵۴)	۴۶.۱۷۵.۲۹۱.۵۶۱

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	۳۳.۱۰۰.۶۶۵	۳۳۶.۶۹۹.۹۶۴.۳۸۰	۳۳۵.۵۹۴.۷۶۸.۶۴۳	(۱۰.۱۰۰.۹۹۹)	۱.۰۹۵.۰۹۴.۷۳۸
ارزش آفرین بیدار	۲۵.۵۳۱.۵۰۲	۲۷۴.۴۶۳.۶۴۶.۵۰۰	۲۷۴.۱۵۵.۰۶۲.۵۸۳	(۶۵.۱۸۵.۱۱۹)	۲۴۳.۳۹۸.۷۹۸
جمع	۵۸.۶۳۲.۱۶۷	۶۱۱.۱۶۳.۶۱۰.۸۸۰	۶۰۹.۷۴۹.۸۳۱.۲۲۶	(۷۵.۲۸۶.۱۱۸)	۱.۳۳۸.۴۹۳.۵۳۶

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ ماهه ۲۰٪	۲۴۲.۰۹۱	۲۴۲.۰۹۱.۰۰۰.۰۰۰	۲۴۲.۱۱۹.۲۷۲.۱۳۴	(۲۷.۸۴۰.۴۶۵)	(۵۶.۱۱۲.۵۹۹)
جمع	۲۴۲.۰۹۱	۲۴۲.۰۹۱.۰۰۰.۰۰۰	۲۴۲.۱۱۹.۲۷۲.۱۳۴	(۲۷.۸۴۰.۴۶۵)	(۵۶.۱۱۲.۵۹۹)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

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

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
داروسازی سینا	۵۶۸۹.۴۸۳	۴.۸۴۷.۶۷۴	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 ۱۴۰۰/۱۲/۲۹):

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	۱۱.۱۶۳.۹۸۴	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	۱.۰۰۵.۸۰۰.۹۴۶.۱۴۰
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۴۸.۵۱۳.۱۸۲	۳۸.۷۷۵.۵۸۶	۴۲۷.۹۶۸.۹۶۰.۳۹۱	۳۵۹.۳۲۰.۳۱۵.۸۵۲
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ ماهه ۲۰٪	۵۲۶۰۶	۲.۵۱۰	۵۲۶۰۶.۴۳۳.۵۵۰	۲.۵۰۹.۶۳۶.۰۵۰

خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
شرکت داروسازی سینا	۴.۵۹۸.۶۷۶	۴.۳۳۸.۶۱۴	۱۱۶.۱۲۹.۹۱۷.۴۰۱	۱۰۳.۳۷۱.۲۰۷.۵۲۰
شرکت بیمه سرمد	۱۴.۴۹۳.۲۱۲	۲۳.۹۶۲.۳۱۳	۴۱.۲۸۰.۱۹۶.۷۲۷	۶۸.۶۷۹.۴۰۲.۰۷۴
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۸.۷۷۶.۱۰۱	۱۷.۸۳۶.۴۳۰	۷۷.۷۴۶.۴۹۹.۶۰۸	۵۳.۴۴۵.۲۷۵.۴۱۳
شرکت بیمه رازی	۹۵.۶۴۴.۲۹۵	۷۶.۴۳۰.۷۳۹	۱۷۴.۹۸۸.۰۲۳.۳۶۸	۱۴۰.۵۷۳.۴۳۸.۶۵۱
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۷۳.۱۸۲.۰۴۹	۱۹۵.۸۴۴.۲۵۱	۱.۷۵۰.۱۸۶.۸۷۳.۸۵۶	۱.۹۷۶.۴۱۸.۵۷۴.۷۰۳
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۵۰.۱۹۳.۶۲۲	۴۹.۸۲۹.۴۶۵	۵۵۳.۰۳۴.۶۰۲.۴۰۹	۵۴۶.۵۸۴.۰۱۵.۲۲۰
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ ماهه ۲۰٪	۱۹۲.۰۲۸	۳۳	۱۹۲.۰۵۵.۸۴۳.۲۲۰	۳۳.۰۴۵.۴۸۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱



مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۳۰/۹/۱۴۰۰):

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

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	۱۷.۸۶۲.۱۹۵۴	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 ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۵.۱۱۶	۱.۰۰۵.۱۱۶	۵/۴۸

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۳۱/۳/۱۴۰۱):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۸.۹۳۷.۲۹۰	۲۶.۱۲۵.۹۸۸	۳۴/۲۱
شرکت بیمه سرمد	۳۸.۴۵۵.۵۲۵	۴۷۷.۶۰۷.۸۸۵	۸/۰۵
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۵۱.۸۷۵.۱۴۰	۱۲۹.۳۹۴.۸۷۴	۴۰/۰۹
شرکت بیمه رازی	۱۷۲.۰۷۵.۰۳۴	۲.۷۹۲.۹۹۶.۵۳۳	۶/۱۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳۶۹.۰۲۶.۳۰۰	۳۷۲.۶۸۱.۵۴۹	۹۹
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۱۰۰.۰۲۳.۰۸۷	۲۱۹.۰۸۵.۵۷۵	۴۵/۶۵
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۱۹۲.۰۶۱	۱.۰۰۵.۱۴۹	۱۹/۱۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

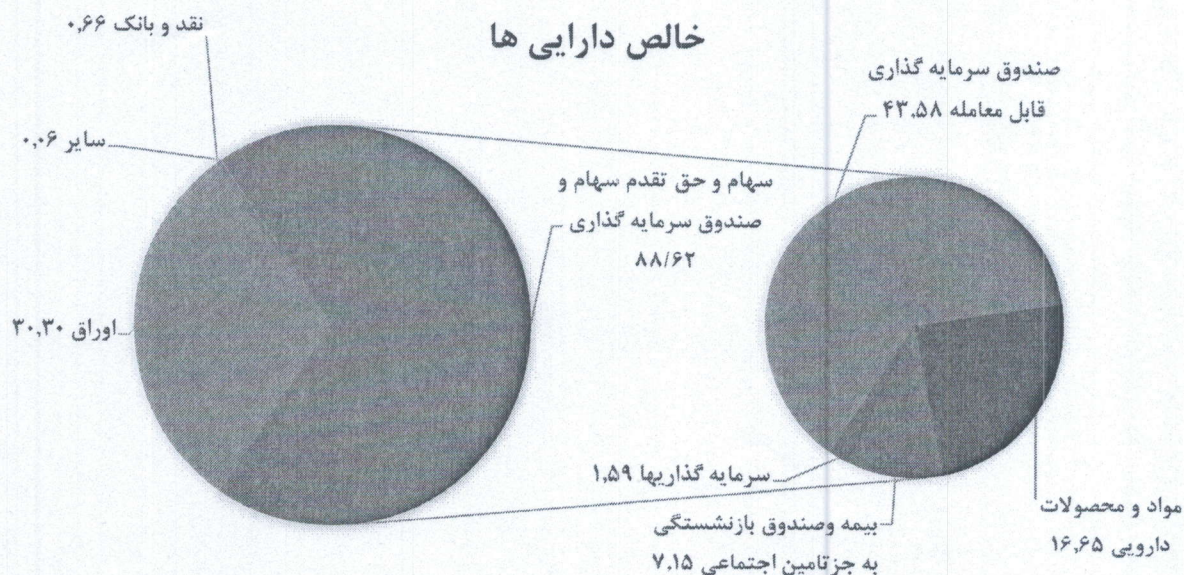
دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱

ترکیب دارائی‌های صندوق:

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		۱۴۰۱/۰۳/۳۱
	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (%)	نسبت به کل دارایی (درصد)	نسبت به کل دارایی (درصد)
سهام	۱۷۲.۲۶۸	۳۳/۷۶	۴۷۹.۶۷۸	۲۰/۵۵	۵۲۵.۲۵۲	۲۳/۷۴	۲۵/۳۹
اوراق	۸۶.۰۸۰	۱۶/۸۷	۸۵۱.۸۸۴	۳۶/۵	۸۱۹.۱۶۳	۳۷/۰۲	۳۰/۳
وجه نقد	۳۱.۶۰۶	۶/۱۹	۱۶.۹۷۳	۰/۷۳	۱۵.۰۲۶	۰/۶۸	۰/۶۶
سایر دارایی‌ها	۷.۱۰۳	۱/۳۹	۳۳.۷۰۳	۱/۴۴	۴۹.۰۵۳	۲/۲۲	۰/۰۶
صندوق سرمایه‌گذاری	۷۸۷.۴۹۲	۱۵۴/۳۴	۹۵۱.۶۹۹	۴۰/۷۸	۸۰۴.۲۰۵	۳۶/۳۴	۴۳/۵۸

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *

نمودار ترکیب دارایی:



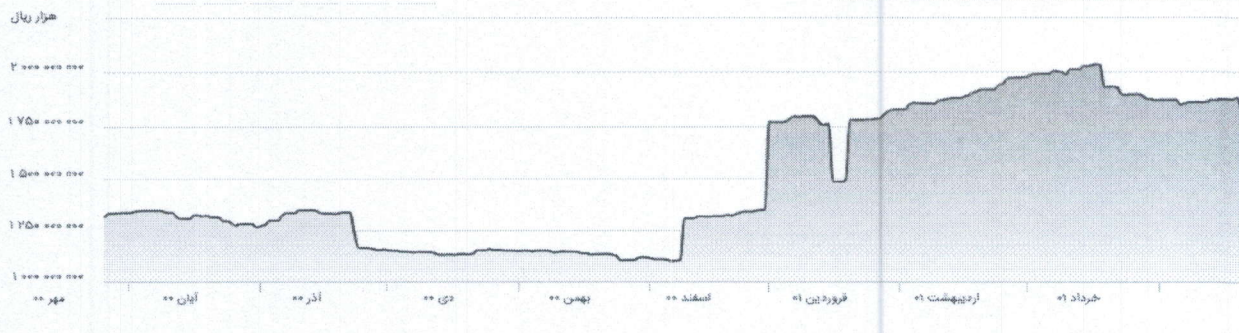
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

دوره مالی نه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۱



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم		
سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	شرح
۱,۳۳۸,۴۹۲,۹۴۸,۵۵۶	۱,۸۰۸,۳۷۳,۰۱۲,۵۱۵	خالص ارزش روز دارایی‌ها (ریال)
۱,۱۴۸,۹۹۷	۱,۲۶۹,۲۰۵	قیمت صدور هر واحد (ریال)
۱,۱۴۷,۹۶۵	۱,۲۶۸,۱۱۴	قیمت ابطال هر واحد (ریال)
۱,۱۵۷,۲۵۹	۱,۴۲۶,۰۳۳	تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری

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،