

# گزارش صورت وضعیت پرتفوی مانده



صندوق سرمایه‌گذاری  
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱- سرمایه‌گذاری‌ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام

| تغییرات طی دوره               |             |                   |                   |              |                 |              |                 |             |               |                   |                      |
|-------------------------------|-------------|-------------------|-------------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|-------------|---------------|-------------------|----------------------|
| ۱۴۰۱/۰۷/۳۰                    |             |                   |                   | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱   |                 |              |                 |             |               |                   |                      |
| شرکت                          | تعداد       | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش    | خرید طی دوره | بهای تمام شده   | تعداد        | فروش طی دوره    | تعداد       | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش    | درصد به کل دارایی‌ها |
|                               |             | ریال              | ریال              |              | ریال            |              | ریال            |             | ریال          | ریال              | درصد                 |
| داروسازی سینا                 | ۱۴,۵۰۹,۶۵۶  | ۳۳۱,۱۱۴,۶۳۹,۸۹۰   | ۳۳۲,۶۷۳,۶۰۲,۰۳۶   | ۸۸۳,۱۸۶      | ۱۹,۵۳۱,۴۲۸,۹۶۵  | (۷۸۸,۰۸۶)    | ۱۷,۹۳۷,۹۰۳,۶۴۳  | ۱۴,۶۰۴,۷۵۶  | ۲۲,۱۶۰        | ۳۳۲,۴۴۴,۶۱۸,۹۹۳   | ۱۷,۵۱                |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د      | ۲۳,۶۶۰,۴۰۳  | ۲۳۹,۶۸۰,۸۳۷,۶۰۰   | ۳۷۰,۹۶۸,۲۹۰,۶۸۵   | ۴۶,۵۹۱,۸۱۷   | ۴۷۰,۶۴۶,۸۳۰,۱۷۸ | (۳۳,۵۷۰,۰۴۷) | ۳۳۹,۶۴۲,۲۸۲,۵۲۹ | ۳۶,۶۸۲,۱۷۳  | ۱۰,۱۷۳        | ۳۷۳,۱۵۶,۵۵۰,۸۹۷   | ۲۰,۲۱                |
| بیمه سرمد                     | ۵۱,۱۸۹,۱۹۵  | ۱۳۹,۲۴۴,۶۲۸,۵۵۱   | ۱۳۹,۲۴۴,۶۲۸,۵۵۱   | ۰            | ۰               | ۰            | ۰               | ۵۱,۱۸۹,۱۹۵  | ۲,۶۵۹         | ۱۳۶,۰۲۹,۳۱۳,۳۶۷   | ۷,۳۷                 |
| سرمایه‌گذاری صنایع ایران      | ۱۴,۱۴۵,۲۷۰  | ۲۶,۳۷۰,۶۲۲,۴۸۴    | ۳۷,۲۹۰,۷۵۴,۷۱۵    | ۹,۳۸۷,۰۷۷    | ۱۵,۹۶۱,۵۴۹,۹۱۳  | (۲,۷۸۵,۹۵۶)  | ۴,۵۹۱,۶۰۶,۰۴۷   | ۲۰,۷۴۶,۳۹۱  | ۱,۶۳۰         | ۳۳,۷۹۶,۰۵۶,۸۲۷    | ۱,۸۳                 |
| بیمه رازی                     | ۴۹,۲۰۶,۱۲۳  | ۸۶,۲۱۷,۹۷۳,۷۱۰    | ۷۵,۱۸۹,۹۷۳,۵۰۹    | ۲۳,۸۳۲,۳۱۹   | ۳۶,۸۹۰,۸۳۱,۰۲۱  | (۲۸,۳۴۱,۵۵۶) | ۴۴,۸۹۵,۴۲۷,۵۹۲  | ۴۴,۶۹۶,۸۸۶  | ۱,۶۸۹         | ۷۵,۴۴۷,۱۴۰,۶۸۵    | ۴۰,۰۹                |
| صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت | ۳۸,۸۵۴,۱۲۵  | ۶۷۲,۸۴۱,۴۴۹,۱۸۲   | ۵۴۵,۹۸۸,۶۴۲,۵۹۳   | ۹,۲۲۲,۴۸۴    | ۱۶۴,۱۳۱,۶۴۹,۱۷۹ | (۱۶,۵۷۸,۱۳۶) | ۲۹۴,۲۳۲,۱۴۱,۸۶۲ | ۳۱,۴۹۸,۴۷۳  | ۱۷,۸۹۳        | ۵۶۳,۴۹۶,۵۰۱,۹۸۱   | ۳۰,۵۱                |
| جمع                           | ۱۹۱,۵۶۴,۷۷۲ | ۱,۴۹۵,۴۷۰,۱۵۱,۴۱۷ | ۱,۵۰۱,۳۵۵,۸۹۲,۰۸۹ | ۸۹,۹۱۶,۸۸۳   | ۷۰۷,۱۶۲,۲۸۹,۲۵۶ | (۸۲,۰۶۳,۷۸۱) | ۷۰۱,۲۹۹,۳۶۱,۶۷۳ | ۱۹۹,۴۱۷,۸۷۴ |               | ۱,۵۰۵,۳۷۰,۱۸۲,۷۴۹ | ۸۱,۵۱                |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
 صورت وضعیت پر تقویتی  
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱-۳- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

| اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                      |                                |                    |              |               |              |            |          |                    |                |                 |
|------------------------------------|----------------------|--------------------------------|--------------------|--------------|---------------|--------------|------------|----------|--------------------|----------------|-----------------|
| نام اوراق                          | دارای مجوز از سازمان | پذیرفته شده در بورس یا فرابورس | تاریخ انتشار اوراق | تاریخ سررسید | نرخ سود اسمی  | نرخ سود مؤثر |            |          |                    |                |                 |
| سکوک اجاره خوارزم (۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪)  | بله                  | بله                            | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸         | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸   | ۳۰٪           | ۳۰٪          |            |          |                    |                |                 |
|                                    |                      |                                |                    |              |               |              |            |          |                    |                |                 |
| ۱۴۰۱/۰۶/۳۱                         |                      |                                | تغییرات طی دوره    |              |               |              | ۱۴۰۱/۰۷/۳۰ |          |                    |                |                 |
| نام اوراق                          | تعداد                | بهای تمام شده                  | خالص ارزش فروش     | خرید طی دوره |               | فروش طی دوره |            | تعداد    | قیمت بازار هر ورقه | بهای تمام شده  | خالص ارزش فروش  |
|                                    | ریال                 | ریال                           | ریال               | تعداد        | بهای تمام شده | تعداد        | مبلغ فروش  | ریال     | ریال               | ریال           | ریال            |
| سکوک اجاره خوارزم (۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪)  | ۲۸۹,۹۹۳              | ۲۹۰.۰۲۶۶۳۳,۶۱۴                 | ۲۹۷,۸۶۷,۹۹۸,۹۸۱    | ۸۹           | ۸۹۰.۱۰.۲۳۵    | ۰            | ۰          | ۲۹۰.۰۰۸۲ | ۱.۰۰۰.۰۰۰          | ۳۹۰.۱۱۵۶۴۳,۸۴۹ | ۳۰۱,۱۰۹.۰۳۴,۹۵۳ |
| جمع                                | ۲۸۹,۹۹۳              | ۲۹۰.۰۲۶۶۳۳,۶۱۴                 | ۲۹۷,۸۶۷,۹۹۸,۹۸۱    | ۸۹           | ۸۹۰.۱۰.۲۳۵    | ۰            | ۰          | ۲۹۰.۰۰۸۲ |                    | ۳۹۰.۱۱۵۶۴۳,۸۴۹ | ۳۰۱,۱۰۹.۰۳۴,۹۵۳ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| مشخصات حساب بانکی    |                   | ۱۴۰۱/۰۶/۳۱      | تغییرات طی دوره   |                    | ۱۴۰۱/۰۷/۳۰    |               |               |               |                      |
|----------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------------|
| سپرده های بانکی      | شماره حساب        | نوع سپرده       | تاریخ افتتاح حساب | نرخ سود علی الحساب | مبلغ          | افزایش        | کاهش          | مبلغ          | درصد به کل دارایی‌ها |
|                      |                   |                 |                   | درصد               | ریال          | ریال          | ریال          | ریال          | درصد                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۳۷-۰۰-۱  | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۱۲/۲۴        | ۱۰                 | ۱,۰۰۵,۲۶۲,۳۴۱ | ۲۹۲,۹۵۹,۵۵۷   | ۲۹۳,۶۸۲,۳۲۵   | ۱,۰۰۴,۵۳۹,۵۷۳ | ۰.۰۵                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۲۶-۰۰-۹  | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۱۲/۲۴        | ۱۰                 | ۱,۰۸۴,۶۰۸,۶۴۳ | ۶,۸۳۲,۹۷۳     | ۳۳۳,۵۹۶,۲۵۴   | ۷۵۷,۸۴۵,۳۶۲   | ۰.۰۴                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۵۲-۰۰-۸  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۹۷۸,۱۳۶,۴۶۲   | ۶,۷۴۹,۱۸۵,۰۰۷ | ۷,۲۱۹,۸۸۹,۵۴۷ | ۵۰۷,۴۳۱,۹۲۲   | ۰.۰۲۷                |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۴۵-۰۰-۸  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۶۳۸,۰۹۵,۱۸۸   | ۵,۴۱۹,۴۳۹     | ۴۱,۵۴۳,۸۴۷    | ۶۰۱,۹۷۰,۷۸۰   | ۰.۰۳                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۹-۰۰-۶  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۱,۰۰۲,۰۵۴,۲۱۷ | ۶۸۰,۶۰۳,۰۰۸   | ۶۸۰,۸۰۳,۶۰۲   | ۱,۰۰۱,۸۵۳,۶۲۳ | ۰.۰۵                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۳-۰۰-۷  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۱,۰۰۲,۱۸۲,۱۳۹ | ۴۸۲,۱۲۳,۹۲۶   | ۴۸۷,۲۱۹,۷۳۱   | ۹۹۷,۰۸۶,۳۳۴   | ۰.۰۵                 |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۷۷۵۲۴۵-۰۰-۱  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸        | ۱۰                 | ۵۰۸,۷۹۶,۷۶۷   | ۱۳۰,۳۶۱,۹۵۲   | ۱۳۹,۷۳۴,۵۰۳   | ۴۹۹,۴۲۴,۲۱۶   | ۰.۰۳                 |
| بانک سامان           | ۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹ | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۰۸/۲۶        | ۸                  | ۹۳,۰۹۶        | ۰             | ۲۰,۰۰۰        | ۷۳,۰۹۶        | ۰.۰۰                 |
| جمع                  |                   |                 |                   |                    | ۶,۲۱۹,۲۲۸,۸۵۳ | ۸,۳۴۷,۴۸۵,۸۶۲ | ۹,۱۹۶,۴۸۹,۸۰۹ | ۵,۳۷۰,۲۲۴,۹۰۶ | ۰.۲۹                 |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱-۲-۲ سود سپرده بانکی

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |             |               | طی مهر ماه ۱۴۰۱ |             |               | نرخ سود<br>(درصد) | تاریخ سر رسید | روز دریافت<br>سود | شرح                              |
|----------------------------------------------|-------------|---------------|-----------------|-------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|----------------------------------|
| خالص درآمد                                   | هزینه تنزیل | درآمد سود     | خالص درآمد      | هزینه تنزیل | درآمد سود     |                   |               |                   |                                  |
| ریال                                         | ریال        | ریال          | ریال            | ریال        | ریال          |                   |               | درصد              |                                  |
| ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶                                | ۰           | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶ | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶   | ۰           | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶ | ۲۰                | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸    | -                 | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ ماهه ۲۰٪ |
| ۸,۴۶۴,۶۰۶                                    | ۰           | ۸,۴۶۴,۶۰۶     | ۸,۴۶۴,۶۰۶       | ۰           | ۸,۴۶۴,۶۰۶     | ۱۰                | -             | ۱۳۳م              | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۵,۵۳۴,۷۵۶                                    | ۰           | ۵,۵۳۴,۷۵۶     | ۵,۵۳۴,۷۵۶       | ۰           | ۵,۵۳۴,۷۵۶     | ۱۰                | -             | ۱۳۳م              | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۸۸۳,۱۱۰                                      | ۰           | ۸۸۳,۱۱۰       | ۸۸۳,۱۱۰         | ۰           | ۸۸۳,۱۱۰       | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۵,۴۱۹,۴۳۹                                    | ۰           | ۵,۴۱۹,۴۳۹     | ۵,۴۱۹,۴۳۹       | ۰           | ۵,۴۱۹,۴۳۹     | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۶,۲۵۹                                        | ۰           | ۶,۲۵۹         | ۶,۲۵۹           | ۰           | ۶,۲۵۹         | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۲۹۳,۵۵۱                                      | ۰           | ۲۹۳,۵۵۱       | ۲۹۳,۵۵۱         | ۰           | ۲۹۳,۵۵۱       | ۱۰                | -             | ۱۷م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۴,۶۱۹,۳۱۹,۰۵۷                                | -           | ۴,۶۱۹,۳۱۹,۰۵۷ | ۴,۶۱۹,۳۱۹,۰۵۷   | -           | ۴,۶۱۹,۳۱۹,۰۵۷ |                   |               |                   | جمع                              |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری ها

| شرح                                                      | یادداشت | مبلغ           | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی ها |
|----------------------------------------------------------|---------|----------------|--------------------|----------------------|
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام                       | ۱-۲     | ۵,۸۹۳,۵۵۶,۵۳۰  | ۴۹.۹۸              | ۰.۳۲                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۲-۲     | ۳,۱۴۸,۸۹۸,۶۱۲  | ۲۶.۷۱              | ۰.۱۷                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی                | ۳-۲     | ۲۰,۶۰۱,۷۲۱     | ۰.۱۷               | ۰.۰۰                 |
| سایر درآمدها                                             | ۴-۲     | ۲,۷۲۷,۹۷۶,۲۴۵  | ۲۳.۱۴              | ۰.۱۵                 |
| جمع                                                      |         | ۱۱,۷۹۱,۰۳۳,۱۰۸ | ۱۰۰                | ۰.۶                  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱-۲-۱ درآمد سود سهام و صندوق های سرمایه گذاری

| اطلاعات مجمع             |                  | طی مهر ماه ۱۴۰۱                |                     |                    |             | از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |                    |             |                     |
|--------------------------|------------------|--------------------------------|---------------------|--------------------|-------------|----------------------------------------------|--------------------|-------------|---------------------|
| نام سهام                 | تاریخ تشکیل مجمع | تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع | سود متعلق به هر سهم | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام                          | جمع درآمد سود سهام | هزینه تنزیل | خالص درآمد سود سهام |
|                          |                  |                                |                     | ریال               | ریال        | ریال                                         | ریال               | ریال        | ریال                |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د | -                | -                              | -                   | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴      | ۰           | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴                                | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴      | ۰           | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴       |
| جمع                      |                  |                                |                     | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴      | -           | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴                                | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴      | ۰           | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴       |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۲-۱-۲ درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |                     |                   |             | طی مهر ماه ۱۴۰۱               |                     |                   |             | شرح                             |
|----------------------------------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-------------------|-------------|---------------------------------|
| سود و زیان ناشی از تغییر قیمت                | ارزش دفتری          | خالص ارزش فروش    | تعداد       | سود و زیان ناشی از تغییر قیمت | ارزش دفتری          | خالص ارزش فروش    | تعداد       |                                 |
| ریال                                         | ریال                | ریال              |             | ریال                          | ریال                | ریال              |             |                                 |
| (۱۰,۴۰۷,۳۵۹,۵۱۸)                             | (۳۳۳,۸۵۱,۹۷۸,۵۱۱)   | ۳۲۳,۴۴۴,۶۱۸,۹۹۳   | ۱۴,۶۰۴,۷۵۶  | (۱۰,۴۰۷,۳۵۹,۵۱۸)              | (۳۳۳,۸۵۱,۹۷۸,۵۱۱)   | ۳۲۳,۴۴۴,۶۱۸,۹۹۳   | ۱۴,۶۰۴,۷۵۶  | داروسازی سینا                   |
| (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)                              | (۱۳۸,۸۹۴,۱۶۵,۳۹۸)   | ۱۳۶,۰۲۹,۳۱۳,۳۶۷   | ۵۱,۱۸۹,۱۹۵  | (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)               | (۱۳۸,۸۹۴,۱۶۵,۳۹۸)   | ۱۳۶,۰۲۹,۳۱۳,۳۶۷   | ۵۱,۱۸۹,۱۹۵  | بیمه سرمد                       |
| ۵,۴۶۵,۷۹۲,۸۲۲                                | (۶۹,۹۸۱,۳۴۷,۸۶۳)    | ۷۵,۴۴۷,۱۴۰,۶۸۵    | ۴۴,۶۹۶,۸۸۶  | ۵,۴۶۵,۷۹۲,۸۲۲                 | (۶۹,۹۸۱,۳۴۷,۸۶۳)    | ۷۵,۴۴۷,۱۴۰,۶۸۵    | ۴۴,۶۹۶,۸۸۶  | بیمه رازی                       |
| (۳,۳۹۰,۷۸۱,۴۷۴)                              | (۳۷,۱۸۶,۸۳۸,۳۰۱)    | ۳۳,۷۹۶,۰۵۶,۸۲۷    | ۲۰,۷۴۶,۳۹۱  | (۳,۳۹۰,۷۸۱,۴۷۴)               | (۳۷,۱۸۶,۸۳۸,۳۰۱)    | ۳۳,۷۹۶,۰۵۶,۸۲۷    | ۲۰,۷۴۶,۳۹۱  | سرمایه‌گذاری صنایع ایران        |
| ۱,۸۰۰,۱۶۱,۲۲۱                                | (۳۷۱,۳۵۶,۳۸۹,۶۷۶)   | ۳۷۳,۱۵۶,۵۵۰,۸۹۷   | ۳۶,۶۸۲,۱۷۳  | ۱,۸۰۰,۱۶۱,۲۲۱                 | (۳۷۱,۳۵۶,۳۸۹,۶۷۶)   | ۳۷۳,۱۵۶,۵۵۰,۸۹۷   | ۳۶,۶۸۲,۱۷۳  | صندوق س. دارا الگوریتم-د        |
| ۸,۶۲۲,۴۰۳,۸۷۵                                | (۵۵۴,۸۷۴,۰۹۸,۱۰۶)   | ۵۶۳,۴۹۶,۵۰۱,۹۸۱   | ۳۱,۴۹۸,۴۷۳  | ۸,۶۲۲,۴۰۳,۸۷۵                 | (۵۵۴,۸۷۴,۰۹۸,۱۰۶)   | ۵۶۳,۴۹۶,۵۰۱,۹۸۱   | ۳۱,۴۹۸,۴۷۳  | صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت   |
| (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۳۴)                              | (۲۹۱,۴۹۸,۴۵۹,۲۹۴)   | ۲۹۰,۰۴۸,۶۴۰,۵۷۰   | ۲۹۰,۰۸۲     | (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۳۴)               | (۲۹۱,۴۹۸,۴۵۹,۲۹۴)   | ۲۹۰,۰۴۸,۶۴۰,۵۷۰   | ۲۹۰,۰۸۲     | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| (۲,۲۲۴,۴۵۳,۸۲۹)                              | (۱,۷۹۷,۶۴۳,۲۷۷,۱۴۹) | ۱,۷۹۵,۴۱۸,۸۲۳,۳۲۰ | ۱۹۹,۷۰۷,۹۵۶ | (۲,۲۲۴,۴۵۳,۸۲۹)               | (۱,۷۹۷,۶۴۳,۲۷۷,۱۴۹) | ۱,۷۹۵,۴۱۸,۸۲۳,۳۲۰ | ۱۹۹,۷۰۷,۹۵۶ | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱-۳ سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| شرح                          | طی مهر ماه ۱۴۰۱ |                 |                   |                         | از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |                 |                   |                         |
|------------------------------|-----------------|-----------------|-------------------|-------------------------|----------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------|
|                              | تعداد           | خالص ارزش فروش  | ارزش دفتری        | سود و زیان ناشی از فروش | تعداد                                        | خالص ارزش فروش  | ارزش دفتری        | سود و زیان ناشی از فروش |
|                              | ریال            | ریال            | ریال              | ریال                    | ریال                                         | ریال            | ریال              | ریال                    |
| سازی سینا                    | ۷۸۸,۰۰۸۶        | ۱۷,۹۳۷,۹۰۳,۶۴۳  | (۱۸,۰۳۸,۵۶۸,۶۹۴)  | (۱۰۰,۶۶۵,۰۵۱)           | ۷۸۸,۰۰۸۶                                     | ۱۷,۹۳۷,۹۰۳,۶۴۳  | (۱۸,۰۳۸,۵۶۸,۶۹۴)  | (۱۰۰,۶۶۵,۰۵۱)           |
| رازی                         | ۲۸,۳۴۱,۵۵۶      | ۴۴,۸۹۵,۴۲۷,۵۹۲  | (۴۳,۸۲۱,۰۶۸,۸۳۷)  | ۱,۰۷۴,۳۵۸,۷۵۵           | ۲۸,۳۴۱,۵۵۶                                   | ۴۴,۸۹۵,۴۲۷,۵۹۲  | (۴۳,۸۲۱,۰۶۸,۸۳۷)  | ۱,۰۷۴,۳۵۸,۷۵۵           |
| ایه گذاری صنایع ایران        | ۲,۷۸۵,۹۵۶       | ۴,۵۹۱,۶۰۶,۰۴۷   | (۵,۰۲۶,۵۰۷,۲۰۱)   | (۴۳۴,۹۰۱,۱۵۴)           | ۲,۷۸۵,۹۵۶                                    | ۴,۵۹۱,۶۰۶,۰۴۷   | (۵,۰۲۶,۵۰۷,۲۰۱)   | (۴۳۴,۹۰۱,۱۵۴)           |
| وق. س. دارا الگوریتم-د       | ۳۳,۵۷۰,۰۴۷      | ۳۳۹,۶۴۲,۲۸۲,۵۲۹ | (۳۳۹,۹۳۳,۱۷۹,۹۱۷) | (۳۹۰,۸۹۷,۳۸۸)           | ۳۳,۵۷۰,۰۴۷                                   | ۳۳۹,۶۴۲,۲۸۲,۵۲۹ | (۳۳۹,۹۳۳,۱۷۹,۹۱۷) | (۳۹۰,۸۹۷,۳۸۸)           |
| وق. س. افرا نماد پایدار-ثابت | ۱۶,۵۷۸,۱۳۶      | ۲۹۴,۲۳۲,۱۴۱,۸۶۲ | (۲۹۲,۰۲۳,۳۹۷,۱۲۳) | ۲,۲۰۸,۷۴۴,۷۳۹           | ۱۶,۵۷۸,۱۳۶                                   | ۲۹۴,۲۳۲,۱۴۱,۸۶۲ | (۲۹۲,۰۲۳,۳۹۷,۱۲۳) | ۲,۲۰۸,۷۴۴,۷۳۹           |
| ع                            | ۸۲,۰۶۳,۷۸۱      | ۷۰۱,۲۹۹,۳۶۱,۶۷۳ | (۶۹۸,۸۴۲,۷۲۱,۷۷۲) | ۲,۴۵۶,۶۳۹,۹۰۱           | ۸۲,۰۶۳,۷۸۱                                   | ۷۰۱,۲۹۹,۳۶۱,۶۷۳ | (۶۹۸,۸۴۲,۷۲۱,۷۷۲) | ۲,۴۵۶,۶۳۹,۹۰۱           |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۱-۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام:

| طی مهر ماه ۱۴۰۱               |                |                  |               |                  |                     |                  |                  |               |                  | از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|-------------------------------|----------------|------------------|---------------|------------------|---------------------|------------------|------------------|---------------|------------------|----------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| سهام                          | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع              | درآمد سود سهام      | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش       | جمع           |                  |                                              |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                               | یادداشت ۱-۲    | یادداشت ۲-۱      | یادداشت ۳-۱   | مبلغ             | درصد از کل درآمد ها | یادداشت ۱-۲      | یادداشت ۲-۱      | یادداشت ۳-۱   | مبلغ             |                                              |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                               | ریال           | ریال             | ریال          | ریال             | درصد                | ریال             | ریال             | ریال          | ریال             |                                              |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                               | ریال           | ریال             | ریال          | ریال             | درصد                | ریال             | ریال             | ریال          | ریال             |                                              |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| باروسازی سینا                 | ۰              | (۱۰,۴۰۷,۳۵۹,۵۱۸) | (۱۰۰,۶۶۵,۰۵۱) | (۱۰,۴۰۸,۰۲۴,۵۶۹) | (۱۷۸,۳۰)            | ۰                | (۱۰,۴۰۷,۳۵۹,۵۱۸) | (۱۰۰,۶۶۵,۰۵۱) | (۱۰,۴۰۸,۰۲۴,۵۶۹) | (۸۹,۱۲)                                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| بیمه سرمد                     | ۰              | (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)  | ۰             | (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)  | (۴۸,۶۱)             | ۰                | (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)  | ۰             | (۲,۸۶۴,۸۵۲,۰۳۱)  | (۲۴,۳۰)                                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| سرمایه گذاری صنایع ایران      | ۰              | (۳,۳۹۰,۷۸۱,۴۷۴)  | (۴۳۴,۹۰۱,۱۵۴) | (۳,۸۲۵,۶۸۲,۶۲۸)  | (۶۴,۹۱)             | ۰                | (۳,۳۹۰,۷۸۱,۴۷۴)  | (۴۳۴,۹۰۱,۱۵۴) | (۳,۸۲۵,۶۸۲,۶۲۸)  | (۳۲,۴۵)                                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| بیمه رازی                     | ۰              | ۵,۴۶۵,۷۹۲,۸۲۲    | ۱,۰۷۴,۳۵۸,۷۵۵ | ۶,۵۴۰,۱۵۱,۵۷۷    | ۱۱۰,۹۷              | ۰                | ۵,۴۶۵,۷۹۲,۸۲۲    | ۱,۰۷۴,۳۵۸,۷۵۵ | ۶,۵۴۰,۱۵۱,۵۷۷    | ۵۵,۴۷                                        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د      | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴  | ۱,۸۰۰,۱۶۱,۲۲۱    | (۲۹۰,۸۹۷,۳۸۸) | ۵,۷۲۰,۸۱۵,۵۶۷    | ۹۷,۰۷               | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴    | ۱,۸۰۰,۱۶۱,۲۲۱    | (۲۹۰,۸۹۷,۳۸۸) | ۵,۷۲۰,۸۱۵,۵۶۷    | ۴۸,۵۲                                        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت | ۰              | ۸,۶۲۲,۴۰۳,۸۷۵    | ۲,۲۰۸,۷۴۴,۷۳۹ | ۱۰,۸۳۱,۱۴۸,۶۱۴   | ۱۸۴                 | ۰                | ۸,۶۲۲,۴۰۳,۸۷۵    | ۲,۲۰۸,۷۴۴,۷۳۹ | ۱۰,۸۳۱,۱۴۸,۶۱۴   | ۹۱,۸۶                                        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| جمع                           | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴  | (۷۷۴,۶۳۵,۱۰۵)    | ۲,۴۵۶,۶۳۹,۹۰۱ | ۵,۸۹۳,۵۵۶,۵۳۰    | ۱۰۰                 | ۴,۲۱۱,۵۵۱,۷۳۴    | (۷۷۴,۶۳۵,۱۰۵)    | ۲,۴۵۶,۶۳۹,۹۰۱ | ۵,۸۹۳,۵۵۶,۵۳۰    | ۴۹,۹۸                                        |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

ن حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |               |                  |                 | طی مهر ماه ۱۴۰۱ |               |                  |                 | درآمد ثابت            |
|----------------------------------------------|---------------|------------------|-----------------|-----------------|---------------|------------------|-----------------|-----------------------|
| جمع                                          | درآمد فروش    | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق | جمع             | درآمد فروش    | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق |                       |
|                                              | یادداشت ۳-۱-۲ | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۱-۲-۲   |                 | یادداشت ۳-۱-۲ | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۱-۲-۲   |                       |
| ریال                                         | ریال          | ریال             | ریال            | ریال            | ریال          | ریال             | ریال            |                       |
| ۳,۱۴۸,۸۹۸,۶۱۲                                | ۰             | (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۲۴)  | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶   | ۳,۱۴۸,۸۹۸,۶۱۲   | ۰             | (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۲۴)  | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶   | خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| ۳,۱۴۸,۸۹۸,۶۱۲                                | ۰             | (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۲۴)  | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶   | ۳,۱۴۸,۸۹۸,۶۱۲   | ۰             | (۱,۴۴۹,۸۱۸,۷۲۴)  | ۴,۵۹۸,۷۱۷,۳۳۶   |                       |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۲-۳-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

| نام سپرده بانکی      |                  | طی مهر ماه ۱۴۰۱         |                              | از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۱ |                              |
|----------------------|------------------|-------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|------------------------------|
| نام سپرده            | شماره حساب       | سود سپرده بانکی و گواهی |                              | سود سپرده بانکی و گواهی                      |                              |
|                      |                  | سپرده<br>یادداشت ۱-۲-۲  | درصد سود به<br>میانگین سپرده | سپرده<br>یادداشت ۱-۲-۲                       | درصد سود به<br>میانگین سپرده |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۳۷-۰۰-۱ | ۸,۴۶۴,۶۰۶               | ۴۱.۰۹                        | ۸,۴۶۴,۶۰۶                                    | ۴۱.۰۹                        |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۲۶-۰۰-۹ | ۵,۵۳۴,۷۵۶               | ۲۶.۸۷                        | ۵,۵۳۴,۷۵۶                                    | ۲۶.۸۷                        |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۵۲-۰۰-۸ | ۸۸۳,۱۱۰                 | ۴.۲۹                         | ۸۸۳,۱۱۰                                      | ۴.۲۹                         |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۴۵-۰۰-۸ | ۵,۴۱۹,۴۳۹               | ۲۶.۳۱                        | ۵,۴۱۹,۴۳۹                                    | ۲۶.۳۱                        |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۳-۰۰-۷ | ۶,۲۵۹                   | ۰.۰۳                         | ۶,۲۵۹                                        | ۰.۰۳                         |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۷۷۵۲۴۵-۰۰-۱ | ۲۹۳,۵۵۱                 | ۱.۴۲                         | ۲۹۳,۵۵۱                                      | ۱.۴۲                         |
| جمع                  |                  | ۲۰,۶۰۱,۷۲۱              | ۱۰۰.۰۰                       | ۲۰,۶۰۱,۷۲۱                                   | ۱۰۰.۰۰                       |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۱

۲-۴- سایر درآمدها:

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه<br>سال ۱۴۰۱ | طی مهر ماه ۱۴۰۱ |                    |
|-------------------------------------------------|-----------------|--------------------|
| مبلغ                                            | مبلغ            | سایر درآمدها       |
| ریال                                            | ریال            |                    |
| ۲,۰۶۵,۷۰۵,۳۵۰                                   | ۲,۰۶۵,۷۰۵,۳۵۰   | کارمزد بازارگردانی |
| ۶۶۲,۲۷۰,۸۹۵                                     | ۶۶۲,۲۷۰,۸۹۵     | سایر درآمدها       |
| ۲,۷۲۷,۹۷۶,۲۴۵                                   | ۲,۷۲۷,۹۷۶,۲۴۵   | جمع                |