

# گزارش صورت وضعیت پرتفوی مانده



صندوق سرمایه‌گذاری  
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام

| ۱۴۰۱/۱۰/۳۰           |                   |                   |                   |             | تغییرات طی دوره |              |                 |            | ۱۴۰۱/۰۹/۳۰        |                   |             |                               |
|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------|-----------------|--------------|-----------------|------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------------------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | خالص ارزش فروش    | بهای تمام شده     | قیمت بازار هر سهم | تعداد       | فروش طی دوره    |              | خرید طی دوره    |            | خالص ارزش فروش    | بهای تمام شده     | تعداد       | شرکت                          |
|                      |                   |                   |                   |             | مبلغ فروش       | تعداد        | بهای تمام شده   | تعداد      |                   |                   |             |                               |
| درصد                 | ریال              | ریال              | ریال              |             | ریال            |              | ریال            |            | ریال              | ریال              |             |                               |
| ۱۷.۴۳                | ۳۷۷,۹۸۷,۳۰۱,۵۴۷   | ۳۱۶,۵۴۲,۷۲۶,۸۸۸   | ۹,۰۰۸۰            | ۴۱,۶۵۳,۸۸۳  | ۴,۷۷۰,۶۹۷,۶۹۷   | (۵۲۰,۰۰۰)    | ۰               | ۰          | ۳۶۸,۷۹۷,۱۱۱,۱۹۲   | ۳۲۰,۴۹۴,۳۹۲,۵۲۱   | ۴۲,۱۷۳,۸۸۳  | داروسازی سینا                 |
| ۳۴.۱۲                | ۷۴۰,۰۰۵,۳۸۴,۳۵۰   | ۷۳۴,۱۳۱,۸۶۴,۹۳۷   | ۱۰,۱۶۳            | ۷۲,۸۱۵,۸۶۰  | ۳۲۰,۳۲۳,۷۰۰,۲۹۸ | (۳۱,۸۰۵,۹۸۲) | ۴۳۹,۳۰۰,۰۱۴,۴۳۴ | ۴۳,۶۵۵,۵۵۱ | ۶۲۰,۱۹۱,۴۷۲,۰۴۱   | ۶۱۵,۵۵۹,۳۲۹,۰۸۲   | ۶۰,۹۶۶,۲۹۱  | صندوق س. دارا الگوریتم-د      |
| ۶.۰۷                 | ۱۳۱,۵۸۹,۱۷۳,۱۹۵   | ۱۳۹,۲۴۴,۶۲۸,۵۵۱   | ۱,۸۲۶             | ۷۲,۱۰۸,۰۱۱  | ۰               | ۰            | ۰               | ۰          | ۱۱۵,۹۵۱,۲۴۸,۴۵۱   | ۱۳۹,۲۴۴,۶۲۸,۵۵۱   | ۷۲,۱۰۸,۰۱۱  | بیمه سرمد                     |
| ۰.۸۳                 | ۱۷,۹۶۲,۰۸۳,۵۲۰    | ۱۴,۸۸۶,۲۲۳,۷۵۰    | ۲,۱۶۴             | ۸,۳۰۵,۴۵۸   | ۰               | ۰            | ۰               | ۰          | ۱۶,۶۲۵,۷۱۷,۷۸۸    | ۱۴,۸۸۶,۲۲۳,۷۵۰    | ۸,۳۰۵,۴۵۸   | سرمایه گذاری صنایع ایران      |
| ۱.۳۲                 | ۲۸,۶۸۱,۸۲۱,۸۱۱    | ۲۶,۶۶۸,۶۳۱,۸۹۹    | ۱۸,۹۰۱            | ۱,۵۱۷,۷۶۱   | ۶۲,۰۰۰,۳۱۰,۰۸۰  | (۳,۳۲۱,۴۶۰)  | ۶۲,۲۶۸,۸۱۳,۲۱۲  | ۳,۳۴۵,۰۰۰  | ۲۷,۷۲۴,۵۵۳,۹۸۹    | ۲۶,۲۳۰,۴۲۳,۲۷۲    | ۱,۴۹۴,۲۲۱   | صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت |
| ۳.۶۴                 | ۷۸,۸۸۰,۰۱۷,۳۸۰    | ۷۶,۷۲۸,۳۸۰,۳۹۵    | ۳۹,۸۷۷            | ۱,۹۷۸,۴۵۴   | ۱۰۱,۳۱۳,۳۷۰,۶۱۷ | (۲,۵۵۸,۰۹۱)  | ۰               | ۰          | ۱۷۷,۹۴۸,۸۹۸,۳۰۹   | ۱۷۶,۵۳۸,۲۲۱,۰۵۵   | ۴,۵۳۶,۵۴۵   | صندوق س. با درآمد ثابت کیان   |
| ۶۳.۴۱                | ۱,۳۷۵,۱۰۵,۷۸۱,۸۰۴ | ۱,۳۰۸,۲۰۲,۴۵۶,۳۲۰ |                   | ۱۹۸,۳۷۹,۴۲۷ | ۴۸۸,۴۰۷,۶۹۹,۶۹۲ | (۳۸,۲۰۵,۵۳۳) | ۵۰۱,۵۶۸,۸۲۷,۶۴۶ | ۴۷,۰۰۰,۵۵۱ | ۱,۳۲۷,۲۳۹,۰۰۱,۷۷۱ | ۱,۲۹۲,۹۵۳,۲۱۸,۲۳۱ | ۱۸۹,۵۸۴,۴۰۹ | جمع                           |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۲-۱- 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 |
|----------------------------------|----------------------|--------------------------------|--------------------|--------------|--------------|--------------|
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ | بله                  | بله                            | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸         | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸   | ۲۰٪          | ۲۰٪          |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱     | بله                  | بله                            | ۱۴۰۱/۰۹/۲۱         | ۱۴۰۵/۰۹/۲۱   | ۱۸٪          | ۱۸٪          |

| نام اوراق                        | ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ |                 | تغییرات طی دوره |                 |              |            |                    |                 | ۱۴۰۱/۱۰/۳۰      |       | درصد به کل دارایی ها |
|----------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|--------------------|-----------------|-----------------|-------|----------------------|
|                                  | تعداد      | بهای تمام شده   | خرید طی دوره    |                 | فروش طی دوره |            | قیمت بازار هر ورقه | بهای تمام شده   | خالص ارزش فروش  | ریال  |                      |
|                                  |            |                 | تعداد           | بهای تمام شده   | تعداد        | مبلغ فروش  |                    |                 |                 |       |                      |
|                                  | ریال       | ریال            | ریال            | ریال            | ریال         | ریال       | ریال               | ریال            | ریال            | ریال  | ریال                 |
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ | ۲۹۰,۱۱۶    | ۲۹۰,۱۴۹,۶۴۷,۷۵۴ | ۱۰              | ۱۰,۰۰۱,۱۵۰      | (۱۰)         | ۱۰,۰۴۸,۸۴۵ | ۲۹۰,۱۱۶            | ۲۹۰,۱۴۹,۶۴۷,۷۴۴ | ۳۱۵,۸۹۴,۰۶۸,۱۳۶ | ۱۴,۵۷ |                      |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱     | ۳۰۰,۰۰۰    | ۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۰۰,۰۰۰         | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۰            | ۰          | ۴۰۰,۰۰۰            | ۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۴۰۷,۴۴۸,۷۷۱,۱۲۲ | ۱۸,۷۹ |                      |
| جمع                              | ۵۹۰,۱۱۶    | ۵۹۰,۱۴۹,۶۴۷,۷۵۴ | ۱۰۰,۰۱۰         | ۱۰۰,۰۲۰,۰۰۱,۱۵۰ | (۱۰)         | ۱۰,۰۴۸,۸۴۵ | ۶۹۰,۱۱۶            | ۶۹۰,۱۵۹,۶۴۷,۷۴۴ | ۷۲۳,۳۴۲,۸۳۹,۲۵۸ | ۳۳,۳۶ |                      |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| مشخصات حساب بانکی    |                   |                 |                   |                    |               |                 |                 |                |                      | ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ | تغییرات طی دوره |  |  | ۱۴۰۱/۱۰/۳۰ |
|----------------------|-------------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------------|-----------------|-----------------|----------------|----------------------|------------|-----------------|--|--|------------|
| 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                 | ریال       |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۳۷-۰۰-۱  | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۱۲/۲۴        | ۱۰                 | ۱,۳۵۹,۶۸۴,۲۴۶ | ۱۲۴,۰۱۸,۹۴۱,۳۴۹ | ۱۲۴,۳۹۰,۸۷۹,۸۰۹ | ۸۸۷,۷۴۵,۷۸۶    | ۰.۰۴                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۳۶-۰۰-۹  | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۱۲/۲۴        | ۱۰                 | ۲۷,۴۴۸,۸۱۶    | ۱۶۱,۶۱۲         | ۷,۷۸۵,۹۹۸       | ۱۹,۸۲۴,۴۳۰     | ۰.۰۰                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۵۲-۰۰-۸  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۴۵۸,۸۴۹,۷۶۳   | ۱۰۷,۸۳۷,۸۷۲,۲۹۳ | ۱۰۷,۶۷۲,۵۳۹,۶۰۶ | ۶۲۴,۱۸۲,۴۵۰    | ۰.۰۲۹                |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۴۵-۰۰-۸  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۱۱۶,۹۳۹,۶۵۴   | ۹۶۱,۱۴۸         | ۲۶,۶۱۷,۱۵۷      | ۹۱,۲۸۳,۶۴۵     | ۰.۰۰                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۹-۰۰-۶  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۱,۹۹۹,۸۴۰,۴۲۱ | ۶,۳۳۲,۳۶۹       | ۴۵,۱۴۹,۳۳۵      | ۱,۹۶۱,۰۲۳,۴۵۵  | ۰.۰۹                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۳-۰۰-۷  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۰۳/۰۸        | ۱۰                 | ۵۳۱,۶۸۴,۳۶۹   | ۴,۳۷۰,۰۰۹       | ۴۷,۲۳۴,۸۸۹      | ۴۸۸,۸۱۹,۴۸۹    | ۰.۰۲                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۷۷۵۲۴۵-۰۰-۱  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸        | ۱۰                 | ۴۹۷,۴۶۵,۵۲۵   | ۱۰,۸۳۸,۷۴۹      | ۸۲,۴۲۰,۸۴۲      | ۴۲۵,۸۸۳,۴۳۲    | ۰.۰۲                 |            |                 |  |  |            |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۷۵۴۵۰۱۳-۰۰-۸  | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۱/۰۷/۱۸        | ۱۰                 | ۱۱۶,۳۲۹,۰۷۱   | ۶۲,۵۷۵,۴۵۹      | ۰               | ۱۷۸,۹۰۴,۵۳۰    | ۰.۰۱                 |            |                 |  |  |            |
| بانک سامان           | ۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۱ | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۴/۱۲/۱۶        | ۸                  | ۰             | ۳۶,۷۹۳,۴۵۷,۵۰۰  | ۰               | ۳۶,۷۹۳,۴۵۷,۵۰۰ | ۱.۷۰                 |            |                 |  |  |            |
| بانک سامان           | ۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹ | سپرده کوتاه مدت | ۱۳۹۹/۰۸/۲۶        | ۸                  | ۷۳,۰۹۶        | ۱,۴۴۳           | ۰               | ۷۴,۵۳۹         | ۰.۰۰                 |            |                 |  |  |            |
| جمع                  |                   |                 |                   |                    | ۵,۰۰۸,۳۱۴,۹۶۱ | ۲۶۸,۷۳۵,۵۱۱,۹۳۱ | ۲۳۲,۲۷۲,۶۲۷,۶۳۶ | ۴۱,۴۷۱,۱۹۹,۲۵۶ | ۱.۹۱                 |            |                 |  |  |            |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۱-۲-۲ سود سپرده بانکی

| از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۱ |             |                | طی دی 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              |                                  |
| ۱۹,۳۴۷,۷۰۶,۱۹۴                              | ۰           | ۱۹,۳۴۷,۷۰۶,۱۹۴ | ۵,۰۷۴,۶۳۴,۶۱۸  | ۰           | ۵,۰۷۴,۶۳۴,۶۱۸  | ۲۰                | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸    | -                 | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ ماهه ۲۰٪ |
| ۶,۲۵۴,۰۷۰,۴۹۱                               | ۰           | ۶,۲۵۴,۰۷۰,۴۹۱  | ۴,۹۷۷,۰۹۵,۵۸۰  | ۰           | ۴,۹۷۷,۰۹۵,۵۸۰  | ۱۸                | ۱۴۰۵/۰۹/۲۱    | -                 | مراجعه ت. صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱    |
| ۱,۴۴۳                                       | ۰           | ۱,۴۴۳          | ۱,۴۴۳          | ۰           | ۱,۴۴۳          | ۸                 | -             | ۱۵م               | بانک سامان                       |
| ۲۳,۵۴۱,۲۵۶                                  | ۰           | ۲۳,۵۴۱,۲۵۶     | ۷,۲۳۷,۰۵۸      | ۰           | ۷,۲۳۷,۰۵۸      | ۱۰                | -             | ۱۳م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۱۲,۱۴۹,۰۰۲                                  | ۰           | ۱۲,۱۴۹,۰۰۲     | ۱۶۱,۶۱۲        | ۰           | ۱۶۱,۶۱۲        | ۱۰                | -             | ۱۳م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۱۲,۳۵۷,۷۵۷                                  | ۰           | ۱۲,۳۵۷,۷۵۷     | ۳,۷۷۱,۳۶۸      | ۰           | ۳,۷۷۱,۳۶۸      | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۱۶,۳۱۶,۶۶۳                                  | ۰           | ۱۶,۳۱۶,۶۶۳     | ۹۶۱,۱۴۸        | ۰           | ۹۶۱,۱۴۸        | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۲۲,۳۰۵,۸۴۰                                  | ۰           | ۲۲,۳۰۵,۸۴۰     | ۶,۳۳۲,۳۶۹      | ۰           | ۶,۳۳۲,۳۶۹      | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۱۹,۹۳۰,۳۹۸                                  | ۰           | ۱۹,۹۳۰,۳۹۸     | ۴,۳۷۰,۰۰۹      | ۰           | ۴,۳۷۰,۰۰۹      | ۱۰                | -             | ۱۴م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۷,۹۷۸,۱۴۵                                   | ۰           | ۷,۹۷۸,۱۴۵      | ۰              | ۰           | ۰              | ۱۰                | -             | ۱۷م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۲۰,۳۴۴                                      | ۰           | ۲۰,۳۴۴         | ۵,۴۷۳          | ۰           | ۵,۴۷۳          | ۱۰                | -             | ۱۷م               | بانک صادرات اسدابادی             |
| ۲۵,۷۱۶,۳۷۷,۵۳۳                              | -           | ۲۵,۷۱۶,۳۷۷,۵۳۳ | ۱۰,۰۷۴,۵۷۰,۶۷۸ | -           | ۱۰,۰۷۴,۵۷۰,۶۷۸ |                   |               |                   | جمع                              |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

| شرح                                                      | یادداشت | مبلغ            | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی‌ها |
|----------------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------------|----------------------|
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام                       | ۱-۲     | ۱۱۹,۳۵۲,۱۶۴,۲۹۶ | ۷۲.۲۰              | ۵.۵۰                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۲-۲     | ۲۴,۰۹۶,۰۲۱,۶۸۴  | ۱۴.۵۸              | ۱.۱۱                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی                | ۳-۲     | ۱۱۴,۶۰۰,۸۴۸     | ۰.۰۷               | ۰.۰۱                 |
| سایر درآمدها                                             | ۴-۲     | ۲۱,۷۴۱,۸۵۶,۰۴۶  | ۱۳.۱۵              | ۱.۰۰                 |
| جمع                                                      |         | ۱۶۵,۳۰۴,۶۴۲,۸۷۴ | ۱۰۰                | ۷.۶                  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

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

| اطلاعات مجمع             |                  | طی دی ماه ۱۴۰۱                 |                     |                    |              | از ابتدای سال مالی تا پایان دی 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 |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د | -                | -                              | -                   | ۱۰,۶۶۹,۱۰۰,۹۲۵     | ۰            | ۱۰,۶۶۹,۱۰۰,۹۲۵                              | ۳۱,۵۰۱,۵۶۸,۳۴۱     | ۰            | ۳۱,۵۰۱,۵۶۸,۳۴۱      |
| سرمایه گذاری صنایع ایران | ۱۴۰۱/۱۰/۲۸       | ۸,۳۰۵,۴۵۸                      | ۴۰                  | ۳۳۲,۲۱۸,۳۲۰        | (۴۷,۴۰۴,۰۲۳) | ۲۸۴,۸۱۴,۲۹۷                                 | ۳۳۲,۲۱۸,۳۲۰        | (۴۷,۴۰۴,۰۲۳) | ۲۸۴,۸۱۴,۲۹۷         |
| جمع                      |                  |                                |                     | ۱۱,۰۰۱,۳۱۹,۲۴۵     | (۴۷,۴۰۴,۰۲۳) | ۱۰,۹۵۳,۹۱۵,۲۲۲                              | ۳۱,۸۳۳,۷۸۶,۶۶۱     | (۴۷,۴۰۴,۰۲۳) | ۳۱,۷۸۶,۳۸۲,۶۳۸      |

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

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۱ |                     |                   |             | طی دی 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              |             |                                 |
| ۶۰,۴۰۷,۲۹۳,۰۷۸                              | (۳۱۷,۵۸۰,۰۰۸,۴۶۹)   | ۳۷۷,۹۸۷,۳۰۱,۵۴۷   | ۴۱,۶۵۳,۸۸۳  | ۱۳,۱۵۴,۸۰۵,۲۳۹                | (۳۶۴,۸۳۲,۴۹۶,۳۰۸)   | ۳۷۷,۹۸۷,۳۰۱,۵۴۷   | ۴۱,۶۵۳,۸۸۳  | داروسازی سینا                   |
| (۷,۳۰۴,۹۹۲,۲۰۲)                             | (۱۳۸,۸۹۴,۱۶۵,۳۲۷)   | ۱۳۱,۵۸۹,۱۷۳,۱۹۵   | ۷۲,۱۰۸,۰۱۱  | ۱۵,۶۳۷,۹۲۴,۷۴۵                | (۱۱۵,۹۵۱,۲۴۸,۴۵۰)   | ۱۳۱,۵۸۹,۱۷۳,۱۹۵   | ۷۲,۱۰۸,۰۱۱  | بیمه سرمد                       |
| ۳,۱۰۴,۰۰۲,۱۵۱                               | (۱۴,۸۵۸,۰۸۱,۳۷۰)    | ۱۷,۹۶۲,۰۸۳,۵۲۱    | ۸,۳۰۵,۴۵۸   | ۱,۳۳۶,۳۶۵,۷۳۴                 | (۱۶,۶۲۵,۷۱۷,۷۸۷)    | ۱۷,۹۶۲,۰۸۳,۵۲۱    | ۸,۳۰۵,۴۵۸   | سرمایه گذاری صنایع ایران        |
| ۵,۸۶۱,۷۹۳,۳۵۴                               | (۷۳۴,۱۴۳,۵۹۰,۹۹۸)   | ۷۴۰,۰۰۵,۳۸۴,۳۵۲   | ۷۲,۸۱۵,۸۶۰  | ۱,۳۴۸,۶۱۷,۸۱۷                 | (۷۳۸,۷۵۶,۷۶۶,۵۳۵)   | ۷۴۰,۰۰۵,۳۸۴,۳۵۲   | ۷۲,۸۱۵,۸۶۰  | صندوق س. دارا الگوریتم-د        |
| ۱,۷۴۰,۵۵۰,۰۱۰                               | (۲۶,۹۴۱,۲۷۱,۸۰۰)    | ۲۸,۶۸۱,۸۲۱,۸۱۰    | ۱,۵۱۷,۷۶۱   | ۵۱۹,۰۵۹,۱۹۵                   | (۲۸,۱۶۲,۷۶۲,۶۱۵)    | ۲۸,۶۸۱,۸۲۱,۸۱۰    | ۱,۵۱۷,۷۶۱   | صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت   |
| ۳,۱۵۱,۶۳۷,۰۸۶                               | (۷۶,۷۳۸,۳۸۰,۲۹۵)    | ۷۸,۸۸۰,۰۱۷,۳۸۱    | ۱,۹۷۸,۴۵۴   | ۷۴۰,۹۵۹,۸۳۳                   | (۷۸,۱۳۹,۰۵۷,۵۴۸)    | ۷۸,۸۸۰,۰۱۷,۳۸۱    | ۱,۹۷۸,۴۵۴   | صندوق س. با درآمد ثابت کیان     |
| (۱,۴۴۹,۷۵۵,۰۳۰)                             | (۲۹۱,۵۳۲,۳۹۱,۶۹۰)   | ۲۹۰,۰۸۲,۶۳۶,۶۶۰   | ۲۹۰,۱۱۶     | ۴۷,۶۷۲                        | (۲۹۰,۰۸۲,۵۸۸,۹۸۸)   | ۲۹۰,۰۸۲,۶۳۶,۶۶۰   | ۲۹۰,۱۱۶     | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| (۵۶,۰۰۰,۰۰۰)                                | (۴۰۰,۰۱۰,۰۰۰,۰۰۰)   | ۳۹۹,۹۵۴,۰۰۰,۰۰۰   | ۴۰۰,۰۰۰     | (۲۱,۵۰۰,۰۰۰)                  | (۳۹۹,۹۷۵,۵۰۰,۰۰۰)   | ۳۹۹,۹۵۴,۰۰۰,۰۰۰   | ۴۰۰,۰۰۰     | مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱    |
| ۶۴,۴۵۴,۵۲۸,۴۴۷                              | (۲,۰۰۰,۶۸۷,۸۹۰,۰۱۹) | ۲,۰۶۵,۱۴۲,۴۱۸,۴۶۶ | ۱۹۹,۰۶۹,۵۴۳ | ۳۲,۶۱۶,۲۸۰,۲۳۵                | (۲,۰۳۲,۵۲۶,۱۳۸,۲۳۱) | ۲,۰۶۵,۱۴۲,۴۱۸,۴۶۶ | ۱۹۹,۰۶۹,۵۴۳ | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

۱- سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| شرح                           | طی دی ماه ۱۴۰۱ |                 |                   |                         | از ابتدای سال مالی تا پایان دی 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                    |
| سازی سینا                     | ۵۲۰,۰۰۰        | ۴,۷۷۰,۶۹۷,۶۹۷   | (۳,۹۶۴,۶۱۴,۸۸۴)   | ۸۰۶,۰۸۲,۸۱۳             | ۲,۹۸۵,۹۱۹                                   | ۶۴,۰۵۷,۴۱۸,۲۶۲    | (۶۰,۲۸۸,۰۶۵,۸۷۶)    | ۳,۷۶۹,۳۵۲,۳۸۶           |
| رازی                          | ۰              | ۰               | ۰                 | ۰                       | ۱۰۲,۶۲۰,۴۴۲                                 | ۱۵۱,۴۶۵,۰۶۷,۷۱۰   | (۱۵۸,۱۱۵,۸۶۲,۱۰۷)   | (۶,۶۵۰,۷۹۴,۳۹۷)         |
| ایه گذاری صنایع ایران         | ۰              | ۰               | ۰                 | ۰                       | ۲۱,۳۵۰,۶۸۹                                  | ۳۷,۸۸۰,۵۲۲,۲۹۵    | (۳۷,۸۲۶,۳۴۲,۴۴۸)    | ۵۴,۱۷۹,۸۴۷              |
| وق. س. دارا الگوریتم-د        | ۳۱,۸۰۵,۹۸۲     | ۳۲۰,۳۲۳,۷۰۰,۲۹۸ | (۳۲۰,۷۳۴,۷۱۹,۹۳۹) | (۴۱۱,۰۱۹,۶۴۱)           | ۲۰۱,۲۸۳,۹۲۵                                 | ۲,۰۲۸,۶۱۷,۱۸۳,۶۸۹ | (۲,۰۳۰,۶۰۱,۳۵۶,۲۳۹) | (۱,۹۸۴,۱۷۲,۵۵۰)         |
| وق. س. افرا نماد پایدار-ثابت  | ۳,۳۲۱,۴۶۰      | ۶۲,۰۰۰,۰۳۱,۰۸۰  | (۶۱,۸۳۰,۶۰۴,۵۸۵)  | ۱۶۹,۴۲۶,۴۹۵             | ۵۶,۸۲۲,۰۰۲                                  | ۱,۰۳۱,۹۲۵,۰۷۷,۱۵۳ | (۱,۰۰۷,۹۲۵,۶۴۰,۹۰۵) | ۲۳,۹۹۹,۴۳۶,۲۴۸          |
| وق. س. با درآمد ثابت کیان     | ۲,۵۵۸,۰۹۱      | ۱۰۱,۳۱۳,۲۷۰,۶۱۷ | (۹۹,۸۰۹,۸۴۰,۷۶۰)  | ۱,۵۰۳,۴۲۹,۸۵۷           | ۳,۴۷۹,۸۴۸                                   | ۱۳۶,۷۴۳,۸۰۴,۷۶۲   | (۱۳۵,۰۸۵,۰۲۲,۶۹۶)   | ۱,۶۵۸,۷۸۲,۰۶۶           |
| وق. س. نوع دوم کارا -د        | ۰              | ۰               | ۰                 | ۰                       | ۲۴,۰۱۵,۳۸۳                                  | ۳۰۰,۷۵۸,۵۴۴,۰۳۷   | (۳۹۹,۹۹۹,۸۲۹,۴۵۶)   | ۷۵۸,۷۱۴,۵۸۱             |
| ک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ | ۱۰             | ۱۰,۰۴۸,۸۴۵      | (۱۰,۰۴۸,۸۲۴)      | ۲۱                      | ۱۵                                          | ۱۵,۰۷۳,۲۶۸        | (۱۵,۰۷۳,۲۳۹)        | ۲۹                      |
| ج                             | ۳۸,۲۰۵,۵۴۳     | ۴۸۸,۴۱۷,۷۴۸,۵۳۷ | (۴۸۶,۳۴۹,۸۲۸,۹۹۲) | ۲,۰۶۷,۹۱۹,۵۴۵           | ۴۱۲,۵۵۸,۲۲۳                                 | ۳,۷۵۱,۴۶۲,۶۹۱,۱۷۶ | (۳,۷۲۹,۸۵۷,۱۹۲,۹۶۶) | ۲۱,۶۰۵,۴۹۸,۲۱۰          |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

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

| طی دی ماه ۱۴۰۱                |                |                  |               |                |                     | از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۱ |                 |                 |                 |        |
|-------------------------------|----------------|------------------|---------------|----------------|---------------------|---------------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|--------|
| سهام                          | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع            | درآمد سود سهام      | درآمد تغییر ارزش                            | درآمد فروش      | جمع             |                 |        |
|                               | یادداشت ۱-۱-۲  | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۳-۱-۲ | مبلغ           | درصد از کل درآمد ها | یادداشت ۱-۱-۲                               | یادداشت ۲-۱-۲   | یادداشت ۳-۱-۲   | مبلغ            |        |
|                               | ریال           | ریال             | ریال          | ریال           | درصد                | ریال                                        | ریال            | ریال            | ریال            |        |
| پاروسازی سینا                 | ۰              | ۱۳,۱۵۴,۸۰۵,۲۳۹   | ۸۰۶,۰۸۲,۸۱۳   | ۱۳,۹۶۰,۸۸۸,۰۵۲ | ۳۰.۵۸               | ۰                                           | ۶۰,۴۰۷,۲۹۳,۰۷۸  | ۳,۷۶۹,۳۵۲,۳۸۶   | ۶۴,۱۷۶,۶۴۵,۴۶۴  | ۳۸.۸۲  |
| بیمه سرمد                     | ۰              | ۱۵,۶۳۷,۹۲۴,۷۴۵   | ۰             | ۱۵,۶۳۷,۹۲۴,۷۴۵ | ۳۴.۲۵               | ۰                                           | (۷,۳۰۴,۹۹۲,۲۰۲) | ۰               | (۷,۳۰۴,۹۹۲,۲۰۲) | (۴.۴۲) |
| سرمایه گذاری صنایع ایران      | ۲۸۴,۸۱۴,۲۹۷    | ۱,۳۳۶,۳۶۵,۷۳۴    | ۰             | ۱,۶۲۱,۱۸۰,۰۳۱  | ۳.۵۵                | ۲۸۴,۸۱۴,۲۹۷                                 | ۳,۱۰۴,۰۰۲,۱۵۱   | ۵۴,۱۷۹,۸۴۷      | ۳,۴۴۲,۹۹۶,۲۹۵   | ۲۰.۰۸  |
| بیمه رازی                     | ۰              | ۰                | ۰             | ۰              | ۰.۰۰                | ۰                                           | ۰               | (۶,۶۵۰,۷۹۴,۳۹۷) | (۶,۶۵۰,۷۹۴,۳۹۷) | (۴.۰۲) |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د      | ۱۰,۶۶۹,۱۰۰,۹۲۵ | ۱,۲۴۸,۶۱۷,۸۱۷    | (۴۱۱,۰۱۹,۶۴۱) | ۱۱,۵۰۶,۶۹۹,۱۰۱ | ۲۵.۲۰               | ۳۱,۵۰۱,۵۶۸,۳۴۱                              | ۵,۸۶۱,۷۹۳,۳۵۴   | (۱,۹۸۴,۱۷۲,۵۵۰) | ۳۵,۳۷۹,۱۸۹,۱۴۵  | ۲۱.۴۰  |
| صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت | ۰              | ۵۱۹,۰۵۹,۱۹۵      | ۱۶۹,۴۲۶,۴۹۵   | ۶۸۸,۴۸۵,۶۹۰    | ۲                   | ۰                                           | ۱,۷۴۰,۵۵۰,۰۱۰   | ۲۳,۹۹۹,۴۳۶,۲۴۸  | ۲۵,۷۳۹,۹۸۶,۲۵۸  | ۱۵.۵۷  |
| صندوق س. با درآمد ثابت کیان   | ۰              | ۷۴۰,۹۵۹,۸۳۳      | ۱,۵۰۳,۴۲۹,۸۵۷ | ۲,۲۴۴,۳۸۹,۶۹۰  | ۵                   | ۰                                           | ۲,۱۵۱,۶۳۷,۰۸۶   | ۱,۶۵۸,۷۸۲,۰۶۶   | ۳,۸۱۰,۴۱۹,۱۵۲   | ۲۰.۳۱  |
| صندوق س. نوع دوم کارا -د      | ۰              | ۰                | ۰             | ۰              | ۰                   | ۰                                           | ۰               | ۷۵۸,۷۱۴,۵۸۱     | ۷۵۸,۷۱۴,۵۸۱     | ۰.۴۶   |
| جمع                           | ۱۰,۹۵۳,۹۱۵,۲۲۲ | ۳۲,۶۳۷,۷۳۲,۵۶۳   | ۲,۰۶۷,۹۱۹,۵۲۴ | ۴۵,۶۵۹,۵۶۷,۳۰۹ | ۱۰۰                 | ۳۱,۷۸۶,۳۸۲,۶۳۸                              | ۶۵,۹۶۰,۳۸۳,۴۷۷  | ۲۱,۶۰۵,۴۹۸,۱۸۱  | ۱۱۹,۳۵۲,۱۶۴,۲۹۶ | ۷۲     |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

| از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۱ |                 |                  |               | طی دی ماه ۱۴۰۱ |                 |                  |               |                |
|---------------------------------------------|-----------------|------------------|---------------|----------------|-----------------|------------------|---------------|----------------|
| دار با درآمد ثابت                           | درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع            | درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع            |
|                                             | یادداشت ۱-۲-۲   | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۳-۱-۲ |                | یادداشت ۱-۲-۲   | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۳-۱-۲ |                |
|                                             | ریال            | ریال             | ریال          | ریال           | ریال            | ریال             | ریال          | ریال           |
| جاریه خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪                 | ۵,۰۷۴,۶۳۴,۶۱۸   | ۴۷,۶۷۳           | ۲۱            | ۵,۰۷۴,۶۸۲,۳۱۱  | ۱۹,۳۴۷,۷۰۶,۱۹۴  | (۱,۴۴۹,۷۵۵,۰۳۰)  | ۲۹            | ۱۷,۸۹۷,۹۵۱,۱۹۳ |
| صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱                         | ۴,۹۷۷,۰۹۵,۵۸۰   | (۲۱,۵۰۰,۰۰۰)     | ۰             | ۴,۹۵۵,۵۹۵,۵۸۰  | ۶,۲۵۴,۰۷۰,۴۹۱   | (۵۶,۰۰۰,۰۰۰)     | ۰             | ۶,۱۹۸,۰۷۰,۴۹۱  |
|                                             | ۱۰,۰۵۱,۷۳۰,۱۹۸  | (۲۱,۴۵۲,۳۲۸)     | ۲۱            | ۱۰,۰۳۰,۲۷۷,۸۹۱ | ۲۵,۶۰۱,۷۷۶,۶۸۵  | (۱,۵۰۵,۷۵۵,۰۳۰)  | ۲۹            | ۲۴,۰۹۶,۰۲۱,۶۸۴ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۱

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

| نام سپرده بانکی      |                   | طی دی ماه ۱۴۰۱                |                           | از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۱ |                           |
|----------------------|-------------------|-------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|---------------------------|
| نام سپرده            | شماره حساب        | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده               | درصد سود به میانگین سپرده |
|                      |                   | یادداشت ۱-۲-۲                 | یادداشت ۱-۲-۲             | یادداشت ۱-۲-۲                               | یادداشت ۱-۲-۲             |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۳۷-۰۰-۱  | ۷,۲۳۷,۰۵۸                     | ۳۱.۶۹                     | ۲۳,۵۴۱,۲۵۶                                  | ۲۰.۵۴                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۵۹۷۸۲۶-۰۰-۹  | ۱۶۱,۶۱۲                       | ۰.۷۱                      | ۱۲,۱۴۹,۰۰۲                                  | ۱۰.۶۰                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۵۲-۰۰-۸  | ۳,۷۷۱,۳۶۸                     | ۱۶.۵۱                     | ۱۲,۳۵۷,۷۵۷                                  | ۱۰.۷۸                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۴۵-۰۰-۸  | ۹۶۱,۱۴۸                       | ۴.۲۱                      | ۱۶,۳۱۶,۶۶۳                                  | ۱۴.۲۴                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۹-۰۰-۶  | ۶,۳۳۲,۳۶۹                     | ۲۷.۷۲                     | ۲۲,۳۰۵,۸۴۰                                  | ۱۹.۴۶                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۶۶۹۴۳۳-۰۰-۷  | ۴,۳۷۰,۰۰۹                     | ۱۹.۱۳                     | ۱۹,۹۳۰,۳۹۸                                  | ۱۷.۳۹                     |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۶۷۷۵۲۴۵-۰۰-۱  | ۰                             | ۰.۰۰                      | ۷,۹۷۸,۱۴۵                                   | ۶.۹۶                      |
| بانک صادرات اسدآبادی | ۰۲-۱۷۵۴۵۰۱۳-۰۰-۸  | ۵,۴۷۳                         | ۰.۰۲                      | ۲۰,۳۴۴                                      | ۰.۰۲                      |
| بانک سامان           | ۸۴۹-۸۱۰-۲۲۵۶۹۶۵-۹ | ۱,۴۴۳                         | ۰.۰۱                      | ۱,۴۴۳                                       | ۰.۰۰                      |
| جمع                  |                   | ۲۲,۸۴۰,۴۸۰                    | ۱۰۰.۰۰                    | ۱۱۴,۶۰۰,۸۴۸                                 | ۱۰۰.۰۰                    |

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

۲-۴- سایر درآمدها:

| از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه<br>سال ۱۴۰۱ | طی دی ماه ۱۴۰۱ |                    |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------|
| مبلغ                                           | مبلغ           | سایر درآمدها       |
| ریال                                           | ریال           |                    |
| ۱۸,۹۹۸,۶۱۸,۳۹۳                                 | ۱۰,۳۵۲,۹۹۸,۱۷۰ | کارمزد بازارگردانی |
| ۲,۷۴۳,۲۳۷,۶۵۳                                  | ۶۳۱,۰۹۱,۶۸۷    | سایر درآمدها       |
| ۲۱,۷۴۱,۸۵۶,۰۴۶                                 | ۱۰,۹۸۴,۰۸۹,۸۵۷ | جمع                |