

گزارش صورت وضعیت پرتفوی مانده



صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی گوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۱- سرمایه‌گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام

۱۴۰۲/۰۹/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۴۰۲/۰۹/۳۰					
شرکت	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره	فروش طی دوره	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها
	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	درصد
داروسازی سینا	۳۸,۹۵۶,۶۵۵	۳۵۹,۲۴۴,۵۹۱,۸۷۹	۶۳۱,۸۸۲,۰۹۲,۶۱۲	۱۴۶,۹۵۶	۲,۴۳۷,۷۲۲,۲۳۶	(۴۷۰,۸۸۱)	۸,۰۱۷,۷۴۸,۰۵۰	۳۸,۶۳۲,۷۳۰	۱۶,۷۵۰	۳۵۷,۳۳۷,۴۳۸,۱۸۲	۶۴۶,۷۰۴,۷۹۱,۷۷۸
ص.س. درآمد ثابت کیمیا-د	۱۴,۷۶۸,۱۰۰	۱۵۳,۳۶۹,۸۷۰,۵۷۴	۱۶۰,۰۷۰,۰۹۵۳,۱۶۸	۵۰,۱۳۱,۱۱۰	۵۵۱,۷۰۰,۹۶۷,۴۶۱	(۳۵,۱۳۲,۰۴۰)	۴۹۷,۸۲۴,۴۰۸,۴۰۹	۱۹,۷۶۷,۱۷۰	۱۱,۰۷۸	۲۰۹,۸۵۰,۹۹۶,۰۸۸	۲۱۸,۹۳۹,۶۵۰,۳۷۷
صندوق س افرا نماد پایدار- ثابت	۸,۳۸۳,۳۷۰	۱۹۵,۹۲۳,۴۹۰,۳۵۰	۱۹۸,۴۷۸,۶۱۱,۸۸۱	۱۷,۴۵۹,۴۰۰	۴۱۸,۶۰۴,۷۲۹,۷۲۲	(۳۵,۸۰۸,۶۲۰)	۶۱۸,۲۲۰,۰۲۱,۷۸۳	۳۴,۰۵۰	۲۴,۱۵۸	۸۲۱,۱۱۴,۹۶۲	۸۲۳,۴۲۵,۶۶۶
صندوق س. توسعه افق رابین-د	۸۶۰,۰۰۰	۸۶۰,۰۰۰,۲۵۸,۰۰۰	۱۰۸,۰۹۸,۹۲۳,۷۶۵	۰	۰	(۸۶۰,۰۰۰)	۱۰,۸۸۳,۶۰۷,۱۱۲	۰	۱۲,۸۳۶	۰	۰
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۱۳,۶۸۵,۰۶۱	۱۵۴,۰۲۹,۷۰۰,۴۰۲	۱۵۴,۱۳۰,۳۱۷,۹۹۸	۲۳۰,۳۴۱,۳۱۲	۲,۵۱۰,۵۱۳,۵۷۸,۶۹۶	(۱۸۳,۳۳۳,۵۶۸)	۲۰,۸۸,۷۸۶,۰۲۳,۱۰۰	۵۰,۷۰۲,۷۰۵	۱۱,۴۹۸	۵۸۱,۲۹۷,۵۷۱,۴۰۶	۵۸۲,۹۶۳,۳۱۳,۶۹۹
صندوق س. کارا -د	۱۱,۹۴۸,۰۰۰	۱۹۵,۲۵۴,۷۱۱,۹۵۶	۱۹۵,۸۶۳,۶۷۶,۸۶۱	۹,۱۳۹,۰۰۰	۱۵۲,۳۳۳,۶۵۴,۳۸۷	(۳۱,۰۸۷,۰۰۰)	۳۴۹,۴۴۰,۷۷۹,۱۶۱	۰	۱۶,۷۳۸	۰	۰
بیمه سرمد	۷۲,۱۰۸,۰۱۱	۱۱۷,۵۵۵,۹۳۰,۷۴۷	۹۳,۵۳۹,۳۹۱,۷۸۹	۰	۰	(۵۰,۰۰۰,۰۰۰)	۶,۵۴۷,۱۹۹,۸۵۹	۶۷,۱۰۸,۰۱۱	۱,۲۹۲	۱۰۹,۴۰۴,۵۵۲,۷۷۲	۸۶,۶۵۰,۸۲۳,۴۵۳
ح. بیمه سرمد	۳۴,۵۲۶,۱۴۳	۲۱,۶۸۸,۶۹۷,۸۰۴	۱۰,۱۱۲,۹۲۷,۴۹۲	۰	۰	۰	۰	۳۴,۵۲۶,۱۴۳	۲۷۷	۲۱,۶۸۸,۶۹۷,۸۰۴	۱۰,۰۷۸,۴۲۲,۳۴۷
سرمایه گذاری خوارزمی	۴۹۸,۵۵۳,۶۲۰	۸۵۰,۷۱۳,۱۳۸,۹۳۱	۱۰,۲۱,۴۱۳,۵۳۳,۷۶۸	۶۵۶,۱۳۶,۰۴۵	۱,۲۵۲,۰۱۶,۷۴۸,۳۳۳	(۴۴۶,۹۱۸,۸۶۶)	۸۴۷,۷۰۰,۷۲۴,۶۵۳	۷۰۷,۷۷۰,۷۷۹	۱,۹۰۳	۱,۳۰۶,۱۱۰,۱۲۷,۴۵۹	۱,۳۴۶,۰۶۸,۸۸۴,۶۵۹
صندوق س. توسعه فولاد- ثابت	۴۶,۱۶۸,۰۰۰	۵۰۰,۰۹۳,۱۸۹,۸۳۸	۵۰۴,۵۲۱,۶۲۴,۳۵۵	۲,۱۴۰,۰۰۰	۲۳,۶۴۷,۱۵۳,۰۰۵	(۳۱,۶۳۹,۲۰۰)	۲۳۹,۳۰۶,۶۴۳,۰۲۳	۲۶,۶۶۸,۸۰۰	۶,۳۴۰	۲۸۹,۳۳۶,۶۷۰,۴۱۹	۲۹۷,۴۶۱,۳۴۸,۳۳۸
صندوق س. با درآمد ثابت کمند	۰	۰	۰	۲۱,۲۷۴,۰۰۰	۲۱۴,۳۱۶,۰۸۸,۷۰۷	(۳۱,۲۷۴,۰۰۰)	۲۱۴,۹۳۶,۴۸۲,۷۴۵	۰	۱۰,۱۰۵	۰	۰
جمع	۷۳۹,۹۶۶,۸۶۰	۲,۵۵۶,۴۷۳,۵۸۰,۴۸۱	۲,۹۸۰,۰۸۲۱,۸۲۲,۷۸۹	۹۷۶,۷۶۷,۷۲۳	۵,۱۲۵,۵۶۹,۶۴۳,۵۳۷	(۷۷۱,۵۱۴,۱۹۵)	۴,۸۸۱,۶۷۳,۶۶۴,۸۹۵	۹۴۵,۲۲۰,۳۸۸		۲,۸۷۵,۸۴۷,۱۶۹,۰۹۲	۳,۱۸۹,۶۸۸,۵۷۰,۳۱۷
											۷۷.۱۸

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۱-۲- 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 ۴۴۱-۶ماهه 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٪			

تغییرات طی دوره										
نام اوراق		۱۴۰۲/۰۹/۳۰		فروش طی دوره				خرید طی دوره		۱۴۰۲/۱۰/۳۰
		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
		ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪		۳۱۹,۱۲۲	۳۱۹,۱۵۷,۷۷۴,۱۱۸	۳۴۱,۸۹۵,۳۳۸,۶۹۰	۰	۰	۰	۰	۰	۳۴۷,۴۷۷,۳۷۸,۳۳۰
مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱		۴۴۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰	۴۴۱,۸۲۲,۲۹۶,۵۲۳	۰	۰	۰	۰	۰	۴۴۸,۱۹۳,۶۴۸,۲۰۵
جمع		۷۵۹,۱۲۲	۷۵۹,۱۷۲,۳۷۴,۱۱۸	۷۸۳,۷۱۷,۶۳۵,۲۱۳	۰	۰	۰	۰	۰	۷۹۵,۶۷۱,۰۲۶,۵۳۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

مشخصات حساب بانکی										۱۴۰۲/۰۹/۳۰	تغییرات طی دوره		۱۴۰۲/۱۰/۳۰
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				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۱,۱۵۶,۲۰۳,۳۳۳	۱۱۸,۹۰۵,۸۹۲,۳۹۸	(۱۱۹,۱۱۹,۸۰۷,۷۳۵)	۹۴۲,۲۸۷,۹۹۶	۰.۰۲				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۳,۳۷۴,۱۶۱,۴۵۶	۸۷۴,۲۹۷,۲۷۴,۹۴۶	(۸۷۷,۲۷۵,۲۴۳,۰۶۵)	۳۹۶,۱۹۳,۳۳۷	۰.۰۱				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۵۴,۹۷۰,۰۶۱	۲۷,۱۰۵,۷۳۱,۹۹۲	(۲۷,۰۷۵,۲۱۰,۹۲۹)	۸۵,۴۹۱,۱۲۴	۰.۰۰				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۸۶,۷۶۷,۰۲۰	۷۷,۸۸۰,۲۶۷	(۸۱,۴۶۴,۶۲۵)	۸۳,۱۸۲,۶۶۲	۰.۰۰				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۲۱,۹۰۵,۴۲۲,۶۹۸	۲۹,۹۵۴,۳۷۶,۷۸۵	(۵۰,۹۰۷,۳۷۱,۵۷۶)	۹۵۲,۴۲۷,۹۰۷	۰.۰۲				
بانک صادرات میدان فرهنگ	۰۲۱۸۲۰۳۷۰۲۰۰۲	سپرده کوتاه مدت	۱۴۰۲/۰۵/۱۴	۵	۳,۲۷۸,۳۹۲	۶,۵۴۷,۲۱۳,۳۴۴	(۳,۹۵۴,۸۹۹)	۶,۵۴۶,۵۳۶,۸۳۷	۰.۱۶				
جمع					۲۶,۵۸۰,۸۰۲,۹۶۰	۱,۰۵۶,۸۸۸,۳۶۹,۷۳۲	(۱,۰۷۴,۴۶۳,۰۵۲,۸۲۹)	۹,۰۰۶,۱۱۹,۸۶۳	۰.۲۲				

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

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	۲۴۱,۲۴۷,۳۲۹,۳۵۸	۶۷.۴۸	۵.۸۴
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۴۶,۱۴۷,۵۳۲,۱۱۴	۱۲.۹۱	۱.۱۲
درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳-۲	۲۴,۱۶۳,۹۰۲	۰.۰۱	۰.۰۰
سایر درآمدها	۴-۲	۷۰,۱۱۰,۲۴۱,۲۴۷	۱۹.۶۱	۱.۷۰
جمع		۳۵۷,۵۲۹,۲۶۶,۶۲۱	۱۰۰	۸.۷

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

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

طی دی ماه ۱۴۰۲										از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲									
سهام	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	جمع											
	پادداشت ۱-۱-۲	پادداشت ۲-۱-۲	پادداشت ۳-۱-۲	مبلغ	درصد از کل درآمد ها	پادداشت ۱-۱-۲	پادداشت ۲-۱-۲	پادداشت ۳-۱-۲	مبلغ										
	ریال	ریال	ریال	ریال	درصد	ریال	ریال	ریال	ریال										
سرمایه گذاری خوارزمی	۰	(۱۲۰,۲۰۷,۴۱۲,۱۳۴)	۴۰,۵۴۶,۷۵۹,۳۴۵	(۷۹,۶۶۰,۶۵۲,۷۸۹)	۲۲۷,۴۱	۰	۳۱,۹۸۲,۱۱۵,۸۳۵	۸۸,۵۶۶,۵۳۷,۰۹۳	۱۲۰,۵۴۸,۶۵۲,۹۲۸	۴۹,۹۷									
صندوق س. با درآمد ثابت کمند	۰	۰	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	(۱,۷۷)	۰	۰	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	۰,۲۶									
اروسازی سینا	۰	۱۹,۷۰۷,۱۵۸,۵۲۴	۶۹۵,۵۶۶,۴۶۶	۲۰,۴۰۲,۷۲۴,۹۹۰	(۵۸,۲۴)	۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰	۴۵,۸۴۴,۱۳۳,۷۷۸	۵۸۷,۰۴۲,۱۹۶	۸۲,۰۳۷,۱۵۸,۵۲۴	۳۴,۰۱									
صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت	۰	(۲,۵۵۳,۸۱۰,۸۲۷)	۴,۵۱۲,۹۱۶,۶۷۳	۱,۹۵۹,۱۰۵,۸۴۶	(۵۵۹)	۰	۱,۳۱۰,۷۰۴	۱۱,۱۱۱,۳۵۷,۳۰۲	۱۱,۱۱۲,۶۶۸,۰۰۶	۴,۶۱									
صندوق س. کارا -د	۰	۰	۱,۲۴۴,۴۴۷,۹۱۳	۱,۲۴۴,۴۴۷,۹۱۳	(۳,۵۵)	۰	۰	۵,۸۹۶,۴۱۳,۳۹۱	۵,۸۹۶,۴۱۳,۳۹۱	۲,۴۴									
ص.س.درآمد ثابت کیمیا-د	۰	۲,۳۸۷,۵۷۱,۶۹۷	۲,۶۱۴,۵۶۶,۴۶۲	۵,۰۰۲,۱۳۸,۱۵۹	(۱۴,۲۸)	۰	۹,۰۸۸,۶۵۴,۲۸۹	۴,۰۱۸,۱۵۲,۷۴۳	۱۳,۱۰۶,۸۰۷,۰۳۲	۵,۴۳									
صندوق س. دارا الگوریتم-د	۰	۱,۵۶۴,۱۲۳,۶۹۷	۵,۵۴۱,۳۱۴,۴۰۸	۷,۱۰۵,۴۳۸,۱۰۵	(۲۰,۲۸)	۰	۱,۶۶۴,۶۴۱,۲۹۲	۱۷,۶۳۰,۱۸۶,۶۳۶	۱۹,۲۹۴,۸۲۷,۹۲۸	۸,۰۰									
بیمه سرمد	۰	۷۰۲,۱۰۶,۳۳۸	(۱,۰۴۳,۳۶۳,۸۱۵)	(۳۴۱,۲۵۷,۴۷۷)	۰,۹۷	۰	(۱۵,۲۲۶,۶۹۲,۲۴۸)	(۱,۰۴۳,۳۶۳,۸۱۵)	(۱۶,۲۷۰,۰۵۶,۰۶۳)	(۶,۷۴)									
صندوق س توسعه فولاد- ثابت	۰	۳,۶۹۶,۲۴۳,۳۰۱	۴,۹۰۲,۹۷۰,۵۹۹	۸,۵۹۹,۲۱۳,۹۰۰	(۲۴,۵۵)	۰	۸,۱۲۴,۶۷۷,۹۱۸	۴,۹۰۲,۹۷۰,۵۹۹	۱۳,۰۲۷,۶۴۸,۵۱۷	۵,۴۰									
صندوق س. توسعه افق رایبین-د	۰	۰	۷۳,۷۱۴,۳۶۸	۷۳,۷۱۴,۳۶۸	(۲۱)	۰	۰	۱,۳۲۲,۰۰۴,۵۸۷	۱,۳۲۲,۰۰۴,۵۸۷	۰,۵۵									
صندوق س. پایا ثروت پویا-د	۰	۰	۰	۰	۰,۰۰	۰	۰	۳۸,۵۹۲,۷۶۴	۳۸,۵۹۲,۷۶۴	۰,۰۲									
صندوق س سیر سرمایه پیدار- ثابت	۰	۰	۰	۰	۰,۰۰	۰	۰	۱,۸۴۱,۹۱۵,۷۷۵	۱,۸۴۱,۹۱۵,۷۷۵	۰,۷۶									
صندوق س.اعتماد داریک-د	۰	۰	۰	۰	۰,۰۰	۰	۰	۲۸۰,۵۷۷,۳۸۸	۲۸۰,۵۷۷,۳۸۸	۰,۱۲									
ج. بیمه سرمد	۰	(۳۴,۵۱۵,۱۴۵)	۰	(۳۴,۵۱۵,۱۴۵)	۰,۱۰	۰	(۱۱,۶۱۰,۲۷۵,۴۵۷)	۰	(۱۱,۶۱۰,۲۷۵,۴۵۷)	(۴,۸۱)									
جمع	۰	(۹۴,۷۲۸,۵۳۴,۵۴۹)	۵۹,۷۰۹,۲۸۶,۴۵۷	(۳۵۰,۲۹۲,۴۸۰,۹۲)	۱۰۰	۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰	۶۹,۸۶۸,۵۶۶,۱۱۱	۱۳۵,۷۷۲,۷۸۰,۶۹۷	۲۴۱,۲۴۷,۳۲۹,۳۵۸	۱۰۰									

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

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

اطلاعات مجمع		طی دی ماه ۱۴۰۲			از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲		
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
				ریال	ریال	ریال	ریال
شرکت سرمایه گذاری خوارزمی	۱۴۰۲/۰۷/۲۷	۷۶۱,۶۲۵,۲۹۵	۱۵۰	۰	۰	۰	۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰
جمع				۰	۰	۰	۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۲-۱-۲ در آمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲				طی دی ماه ۱۴۰۲				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		
۳۱,۹۸۲,۱۱۵,۸۳۵	(۱,۳۱۴,۰۸۶,۷۶۸,۸۲۴)	۱,۳۴۶,۰۶۸,۸۸۴,۶۵۹	۷۰۷,۷۷۰,۷۷۹	(۱۲۰,۲۰۷,۴۱۲,۱۳۴)	(۱,۴۶۶,۲۷۶,۲۹۶,۷۹۳)	۱,۳۴۶,۰۶۸,۸۸۴,۶۵۹	۷۰۷,۷۷۰,۷۷۹	سرمایه گذاری خوارزمی
۴۵,۸۴۴,۱۳۳,۷۷۸	(۶۰۰,۸۶۰,۶۵۷,۹۹۹)	۶۴۶,۷۰۴,۷۹۱,۷۷۷	۲۸,۶۳۲,۷۳۰	۱۹,۷۰۷,۱۵۸,۵۲۴	(۶۲۶,۹۹۷,۶۳۳,۲۵۳)	۶۴۶,۷۰۴,۷۹۱,۷۷۷	۲۸,۶۳۲,۷۳۰	داروسازی سینا
۱,۳۱۰,۷۰۴	(۸۲۱,۱۱۴,۹۶۲)	۸۲۲,۴۲۵,۶۶۶	۳۴,۰۵۰	(۲,۵۵۳,۸۱۰,۸۲۷)	(۳,۳۷۶,۲۳۶,۴۹۳)	۸۲۲,۴۲۵,۶۶۶	۳۴,۰۵۰	صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت
۹,۰۸۸,۶۵۴,۲۸۹	(۲۰۹,۸۵۰,۹۹۶,۰۸۸)	۲۱۸,۹۳۹,۶۵۰,۳۷۷	۱۹,۷۶۷,۱۷۰	۲,۳۸۷,۵۷۱,۶۹۷	(۲۱۶,۵۵۲,۰۷۸,۶۸۰)	۲۱۸,۹۳۹,۶۵۰,۳۷۷	۱۹,۷۶۷,۱۷۰	ص.س.درآمد ثابت کیمیا-د
۱,۶۶۴,۶۴۱,۲۹۲	(۵۸۱,۳۹۷,۵۷۱,۴۰۶)	۵۸۲,۹۶۲,۲۱۲,۶۹۸	۵۰,۷۰۲,۷۰۵	۱,۵۶۴,۱۲۳,۶۹۷	(۵۸۱,۳۹۸,۰۸۹,۰۰۱)	۵۸۲,۹۶۲,۲۱۲,۶۹۸	۵۰,۷۰۲,۷۰۵	صندوق س. دارا الگوریتم-د
(۱۱,۶۱۰,۲۷۵,۴۵۷)	(۲۱,۶۸۸,۶۹۷,۸۰۴)	۱۰,۰۷۸,۴۲۲,۳۴۷	۳۴,۵۳۶,۱۴۳	(۳۴,۵۱۵,۱۴۵)	(۱۰,۱۱۲,۹۳۷,۴۹۲)	۱۰,۰۷۸,۴۲۲,۳۴۷	۳۴,۵۳۶,۱۴۳	ج. بیمه سرمد
(۱۵,۲۲۶,۶۹۲,۲۴۸)	(۱۰۱,۸۷۷,۵۲۶,۷۰۱)	۸۶,۶۵۰,۸۳۴,۴۵۳	۶۷,۱۰۸,۰۱۱	۷۰۲,۱۰۶,۳۳۸	(۸۵,۹۴۸,۷۲۸,۱۱۵)	۸۶,۶۵۰,۸۳۴,۴۵۳	۶۷,۱۰۸,۰۱۱	بیمه سرمد
۸,۱۲۴,۶۷۷,۹۱۸	(۲۸۹,۳۳۶,۶۷۰,۴۱۹)	۲۹۷,۴۶۱,۳۴۸,۳۳۷	۲۶,۶۶۸,۸۰۰	۳,۶۹۶,۲۴۳,۳۰۱	(۲۹۳,۷۶۵,۱۰۵,۰۳۶)	۲۹۷,۴۶۱,۳۴۸,۳۳۷	۲۶,۶۶۸,۸۰۰	صندوق س توسعه فولاد- ثابت
(۹,۲۰۰,۰۰۰)	(۴۳۹,۹۵۸,۶۰۰,۰۰۰)	۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۰۰	۰	(۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)	۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۰۰	مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱
-	(۳۱۹,۰۸۵,۳۰۰,۹۷۰)	۳۱۹,۰۸۵,۳۰۰,۹۷۰	۳۱۹,۱۲۲	۰	(۳۱۹,۰۸۵,۳۰۰,۹۷۰)	۳۱۹,۰۸۵,۳۰۰,۹۷۰	۳۱۹,۱۲۲	صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪
۶۹,۸۵۹,۳۶۶,۱۱۱	(۳,۸۷۸,۸۶۳,۹۰۵,۱۷۳)	۳,۹۴۸,۷۲۳,۲۷۱,۲۸۴	۹۴۵,۹۷۹,۵۱۰	(۹۴,۷۳۸,۵۳۴,۵۴۹)	(۴,۰۴۳,۴۶۱,۸۰۵,۸۳۳)	۳,۹۴۸,۷۲۳,۲۷۱,۲۸۴	۹۴۵,۹۷۹,۵۱۰	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۲-۳ سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲				طی دی ماه ۱۴۰۲				شرح
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	
۴۴۶,۹۱۸,۸۸۶	۸۴۷,۷۰۰,۷۳۴,۶۵۳	(۸۰۷,۱۵۳,۹۷۵,۳۰۸)	۴۰,۵۴۶,۷۵۹,۳۴۵	۸۷۷,۳۶۹,۲۹۷	۱,۶۴۲,۲۷۶,۱۷۵,۹۲۷	(۱,۵۵۳,۷۰۹,۶۳۸,۸۳۴)	۸۸,۵۶۶,۵۳۷,۰۹۳	سرمایه گذاری خوارزمی
۲۱,۲۷۴,۰۰۰	۲۱۴,۹۳۶,۴۸۲,۷۴۵	(۲۱۴,۳۱۶,۰۸۸,۷۰۷)	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	۲۱,۲۷۴,۰۰۰	۲۱۴,۹۳۶,۴۸۲,۷۴۵	(۲۱۴,۳۱۶,۰۸۸,۷۰۷)	۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸	صندوق س. با درآمد ثابت کمند
۴۷۰,۸۸۱	۸,۰۱۷,۷۴۸,۰۵۰	(۷,۳۲۲,۱۸۱,۵۸۴)	۶۹۵,۵۶۶,۴۶۶	۱,۲۳۲,۹۴۷	۱۹,۷۶۰,۹۴۹,۸۱۸	(۱۹,۱۷۳,۹۰۷,۶۲۲)	۵۸۷,۰۴۲,۱۹۶	داروسازی سینا
۲۵,۸۰۸,۶۲۰	۶۱۸,۲۲۰,۰۲۱,۷۸۳	(۶۱۳,۷۰۷,۱۰۵,۱۱۰)	۴,۵۱۲,۹۱۶,۶۷۳	۶۰,۸۱۶,۶۹۵	۱,۴۱۵,۱۷۵,۶۹۳,۹۹۳	(۱,۴۰۴,۰۶۴,۳۳۶,۶۹۱)	۱۱,۱۱۱,۳۵۷,۳۰۲	صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت
۲۱,۰۸۷,۰۰۰	۳۴۹,۴۴۰,۷۷۹,۱۶۱	(۳۴۸,۱۹۶,۳۳۱,۲۴۸)	۱,۲۴۴,۴۴۷,۹۱۳	۵۱,۲۸۳,۰۲۰	۸۲۶,۸۰۰,۸۲۱,۷۹۳	(۸۲۰,۹۰۴,۴۰۸,۴۰۲)	۵,۸۹۶,۴۱۳,۳۹۱	صندوق س. کارا -د
۴۵,۱۳۲,۰۴۰	۴۹۷,۸۳۴,۴۰۸,۴۰۹	(۴۹۵,۳۱۹,۸۴۱,۹۴۷)	۲,۶۱۴,۵۶۶,۴۶۲	۵۳,۹۵۷,۹۴۰	۵۹۰,۸۷۷,۷۸۳,۹۵۵	(۵۸۶,۸۵۹,۶۳۱,۲۱۲)	۴,۰۱۸,۱۵۲,۷۴۳	ص.س.درآمد ثابت کیمیا-د
۱۸۳,۳۲۳,۵۶۸	۲,۰۸۸,۷۸۶,۰۲۲,۱۰۰	(۲,۰۸۳,۲۴۴,۷۰۷,۶۹۲)	۵,۵۴۱,۳۱۴,۴۰۸	۷۹۸,۵۸۶,۲۷۵	۸,۸۲۲,۲۷۰,۷۱۹,۳۱۲	(۸,۸۰۴,۶۴۰,۵۳۲,۵۷۶)	۱۷,۶۳۰,۱۸۶,۶۳۶	صندوق س. دارا الگوریتم-د
۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۵۴۷,۱۹۹,۸۵۹	(۷,۵۹۰,۵۶۳,۶۷۴)	(۱,۰۴۳,۳۶۳,۸۱۵)	۵,۰۰۰,۰۰۰	۶,۵۴۷,۱۹۹,۸۵۹	(۷,۵۹۰,۵۶۳,۶۷۴)	(۱,۰۴۳,۳۶۳,۸۱۵)	بیمه سرمد
۲۱,۶۳۹,۲۰۰	۲۳۹,۳۰۶,۶۴۳,۰۲۳	(۲۳۴,۴۰۳,۶۷۲,۴۲۴)	۴,۹۰۲,۹۷۰,۵۹۹	۲۱,۶۳۹,۲۰۰	۲۳۹,۳۰۶,۶۴۳,۰۲۳	(۲۳۴,۴۰۳,۶۷۲,۴۲۴)	۴,۹۰۲,۹۷۰,۵۹۹	صندوق س توسعه فولاد- ثابت
۸۶۰,۰۰۰	۱۰,۸۸۳,۶۰۷,۱۱۲	(۱۰,۸۰۹,۸۹۲,۷۴۴)	۷۳,۷۱۴,۳۶۸	۲,۰۰۰,۰۰۰	۲۴,۹۵۹,۵۷۱,۶۹۱	(۲۳,۶۳۷,۵۶۷,۱۰۴)	۱,۳۲۲,۰۰۴,۵۸۷	صندوق س. توسعه افق رابین-د
۰	۰	۰	۰	۲۰۰,۰۰۰	۲,۴۲۱,۳۴۵,۹۱۴	(۲,۳۸۲,۷۵۳,۱۵۰)	۳۸,۵۹۲,۷۶۴	صندوق س.پایا ثروت پویا-د
۰	۰	۰	۰	۵,۶۷۶,۰۰۰	۱۱۲,۱۰۰,۲۴۲,۴۶۱	(۱۱۰,۲۵۸,۳۳۶,۶۸۶)	۱,۸۴۱,۹۱۵,۷۷۵	صندوق س سپر سرمایه بیدار- ثابت
۰	۰	۰	۰	۱,۰۵۵,۰۰۰	۱۸,۷۸۱,۸۰۷,۷۵۶	(۱۸,۵۰۱,۲۳۰,۳۶۸)	۲۸۰,۵۷۷,۳۸۸	صندوق س.اعتماد داریک-د
۷۷۱,۵۱۴,۱۹۵	۴,۸۸۱,۶۷۳,۶۴۶,۸۹۵	(۴,۸۲۱,۹۶۴,۳۶۰,۴۳۸)	۵۹,۷۰۹,۲۸۶,۴۵۷	۱,۹۰۰,۱۹۰,۳۷۴	۱۳,۹۳۶,۲۱۵,۴۳۸,۱۴۷	(۱۳,۸۰۰,۴۴۲,۶۵۷,۴۵۰)	۱۳۵,۷۷۲,۷۸۰,۶۹۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۲-۲-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲

طی دی ماه ۱۴۰۲

اوراق بهادار با درآمد ثابت	طی دی ماه ۱۴۰۲				از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲			
	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	ریال	یادداشت ۱-۲-۲	یادداشت ۲-۱-۲	یادداشت ۳-۱-۲	ریال
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵,۵۸۲,۰۳۹,۶۴۰	۰	۰	۵,۵۸۲,۰۳۹,۶۴۰	۲۱,۲۸۴,۷۸۴,۱۹۶	۰	۰	۲۱,۲۸۴,۷۸۴,۱۹۶
مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱	۶,۳۷۱,۳۵۱,۶۸۲	۰	۰	۶,۳۷۱,۳۵۱,۶۸۲	۲۴,۸۷۱,۹۴۷,۹۱۸	(۹,۲۰۰,۰۰۰)	۰	۲۴,۸۶۲,۷۴۷,۹۱۸
جمع	۱۱,۹۵۳,۳۹۱,۳۲۲	۰	۰	۱۱,۹۵۳,۳۹۱,۳۲۲	۴۶,۱۵۶,۷۳۲,۱۱۴	(۹,۲۰۰,۰۰۰)	۰	۴۶,۱۴۷,۵۳۲,۱۱۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۱-۲-۲ سود سپرده بانکی و اوراق

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲			طی دی ماه ۱۴۰۲			نرخ سود (درصد)	تاریخ سر رسید	روز دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال			درصد	
۲۴,۸۷۱,۹۴۷,۹۱۸	۰	۲۴,۸۷۱,۹۴۷,۹۱۸	۶,۳۷۱,۳۵۱,۶۸۲	۰	۶,۳۷۱,۳۵۱,۶۸۲	۱۸	۱۴۰۵/۰۹/۲۱	-	مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱
۲۱,۲۸۴,۷۸۴,۱۹۶	۰	۲۱,۲۸۴,۷۸۴,۱۹۶	۵,۵۸۲,۰۳۹,۶۴۰	۰	۵,۵۸۲,۰۳۹,۶۴۰	۲۰	۱۴۰۴/۱۱/۱۸	-	صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪
۱۳,۷۱۰,۷۵۵	۰	۱۳,۷۱۰,۷۵۵	۳,۸۰۳,۸۹۲	۰	۳,۸۰۳,۸۹۲	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷
۱,۶۴۰,۴۵۹	۰	۱,۶۴۰,۴۵۹	۱۷,۰۹۷	۰	۱۷,۰۹۷	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰
۲۳۲,۷۸۴	۰	۲۳۲,۷۸۴	۷۸,۷۳۰	۰	۷۸,۷۳۰	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۲۰۳۶۶۷۰۰۸
۳۹۱,۰۲۲	۰	۳۹۱,۰۲۲	۷۰,۹۰۱	۰	۷۰,۹۰۱	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱
۸,۱۳۰,۳۴۵	۰	۸,۱۳۰,۳۴۵	۲۲,۲۸۲	۰	۲۲,۲۸۲	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵
۵۸,۵۳۷	۰	۵۸,۵۳۷	۱۳,۴۶۲	۰	۱۳,۴۶۲	۵	-	۱۴	بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۷۰۲۰۰۲
۴۶,۱۸۰,۸۹۶,۰۱۶	-	۴۶,۱۸۰,۸۹۶,۰۱۶	۱۱,۹۵۷,۳۹۷,۶۸۶	-	۱۱,۹۵۷,۳۹۷,۶۸۶				جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

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

نام سپرده بانکی		طی دی ماه ۱۴۰۲		از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲	
نام سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده
نام سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده
نام سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷	۳,۸۰۳,۸۹۲	۹۴.۹۵	۱۳,۷۱۰,۷۵۵	۵۶.۷۴	
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰	۱۷,۰۹۷	۰.۴۳	۱,۶۴۰,۴۵۹	۶.۷۹	
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸	۷۸,۷۳۰	۱.۹۷	۲۳۲,۷۸۴	۰.۹۶	
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱	۷۰,۹۰۱	۱.۷۷	۳۹۱,۰۲۲	۱.۶۲	
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵	۲۲,۲۸۲	۰.۵۶	۸,۱۳۰,۳۴۵	۳۳.۶۵	
بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۷۰۲۰۰۲	۱۳,۴۶۲	۰.۳۴	۵۸,۵۳۷	۰.۲۴	
جمع	۴,۰۰۶,۳۶۴	۱۰۰	۲۴,۱۶۳,۹۰۲	۱۰۰	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۴۰۲

۲-۴- سایر درآمدها:

از ابتدای سال مالی تا پایان دی ماه سال ۱۴۰۲	طی دی ماه ۱۴۰۲	
مبلغ	مبلغ	سایر درآمدها
ریال	ریال	
۶۷,۳۷۸,۵۵۳,۳۵۰	۳۷,۷۶۵,۸۵۴,۳۴۸	کارمزد بازارگردانی
۲,۷۳۱,۶۸۷,۸۹۷	.	سایر درآمدها
۷۰,۱۱۰,۲۴۱,۲۴۷	۳۷,۷۶۵,۸۵۴,۳۴۸	جمع