

# گزارش صورت وضعیت پرتفوی ماژانه



صندوق سرمایه‌گذاری  
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

برای دوره یک ماهه منتهی به تیرماه ۱۴۰۳

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام

| تغییرات طی دوره               |             |                   |                   | ۱۴۰۳/۰۳/۳۱  |                   |               |                   | ۱۴۰۳/۰۴/۳۱  |               |                   |                   |
|-------------------------------|-------------|-------------------|-------------------|-------------|-------------------|---------------|-------------------|-------------|---------------|-------------------|-------------------|
| شرکت                          | تعداد       | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش    | تعداد       | بهای تمام شده     | خرید طی دوره  | فروش طی دوره      | تعداد       | بهای تمام شده | قیمت بازار هر سهم | خالص ارزش فروش    |
|                               |             | ریال              | ریال              |             | ریال              | ریال          | ریال              |             | ریال          | ریال              | ریال              |
| داروسازی سینا                 | ۴۲,۸۵۸,۷۰۵  | ۴۳۵,۳۹۶,۸۳۹,۸۰۰   | ۶۵۳,۶۲۶,۱۹۱,۸۰۶   | ۵۶۳,۷۱۳     | ۹,۸۶۵,۱۷۴,۱۷۴     | (۲,۸۰۰,۰۰۰)   | ۴۷,۵۷۱,۰۵۹,۲۰۰    | ۴۰,۶۲۲,۴۱۸  | ۱۶,۶۹۰        | ۴۱۶,۷۷۳,۹۱۵,۴۷۸   | ۶۷۷,۵۷۵,۹۳۹,۶۲۱   |
| سرمایه گذاری خوارزمی          | ۸۴۱,۴۷۶,۵۲۱ | ۱,۵۱۴,۰۴۰,۴۴۲,۵۰۵ | ۱,۲۲۵,۲۸۵,۸۶۴,۰۷۲ | ۱۰,۲۳۷,۹۷۴  | ۱۶,۳۸۶,۵۷۴,۸۰۹    | ۰             | ۰                 | ۸۵۱,۷۱۴,۴۹۵ | ۱,۵۶۰         | ۱,۵۳۰,۴۲۷,۰۱۷,۳۱۴ | ۱,۳۲۷,۸۶۶,۷۷۸,۰۳۶ |
| صندوق س توسعه فولاد- ثابت     | ۷,۳۶۸,۱۷۰   | ۷۹,۹۷۴,۷۸۲,۰۳۶    | ۹۱,۳۰۳,۹۷۶,۳۷۴    | ۵,۹۸۶,۸۴۰   | ۷۵,۸۶۴,۳۰۰,۴۴۲    | (۱,۹۰۶,۶۹۰)   | ۲۴,۰۱۱,۲۵۷,۷۷۹    | ۱۱,۴۴۸,۳۲۰  | ۱۲,۶۸۴        | ۱۳۵,۰۲۳,۲۱۹,۰۴۲   | ۱۴۵,۱۸۳,۲۶۳,۹۱۳   |
| صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت | ۹,۴۰۶,۰۰۰   | ۴۳۰,۸۵۱,۸۸۸,۰۳۵   | ۴۳۱,۰۳۳,۷۷۰,۰۱۲   | ۳,۷۶۵,۶۰۰   | ۱۷۴,۱۹۶,۷۱۳,۷۱۰   | (۱۱,۶۹۸,۶۰۰)  | ۵۴۰,۳۷۲,۹۰۴,۵۹۷   | ۱,۴۷۳,۰۰۰   | ۴۶,۸۶۰        | ۶۷,۹۶۸,۷۱۶,۲۱۵    | ۶۹,۰۱۱,۸۳۷,۸۵۴    |
| صندوق س، دارا الگوریتم-د      | ۸,۴۳۹,۴۷۱   | ۱۰۷,۸۲۲,۷۷۴,۶۴۰   | ۱۰۷,۹۰۳,۸۳۸,۹۹۴   | ۱۰۶,۶۵۵,۹۳۱ | ۱,۳۸۰,۸۴۳,۶۶۰,۵۱۹ | (۹۸,۹۴۷,۴۸۵)  | ۱,۲۸۳,۸۴۲,۴۳۱,۴۳۹ | ۱۶,۱۴۷,۹۱۷  | ۱۳,۰۸۴        | ۲۱۰,۵۸۴,۹۳۴,۷۰۲   | ۲۱۱,۲۷۳,۰۰۷,۶۴۸   |
| صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت | ۰           | ۰                 | ۰                 | ۸,۰۲۴,۰۰۰   | ۲۲۱,۳۵۲,۰۱۱,۷۱۶   | (۷,۱۴۳,۰۰۰)   | ۱۹۷,۰۵۶,۵۶۱,۰۵۴   | ۸۹۱,۰۰۰     | ۲۷,۶۲۲        | ۲۴,۵۷۱,۲۵۸,۲۴۷    | ۲۴,۶۰۶,۵۸۷,۴۰۰    |
| جمع                           | ۹۰۹,۵۴۸,۸۶۷ | ۲,۵۶۸,۰۸۶,۷۲۷,۰۱۶ | ۲,۵۰۹,۱۵۳,۶۴۱,۱۵۸ | ۱۳۵,۲۴۴,۰۵۸ | ۱,۸۷۸,۵۰۸,۴۳۵,۳۷۰ | (۱۲۲,۴۹۵,۷۷۵) | ۲,۰۹۲,۷۵۴,۲۱۴,۰۶۹ | ۹۲۲,۲۹۷,۱۵۰ |               | ۲,۳۸۵,۳۴۹,۰۶۰,۹۹۸ | ۲,۴۵۵,۵۱۷,۴۱۴,۴۷۱ |

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت

| نام اوراق                         | دارای مجوز از سازمان | پذیرفته شده در بورس یا فرابورس | تاریخ انتشار اوراق | تاریخ سررسید | ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ | ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ |
|-----------------------------------|----------------------|--------------------------------|--------------------|--------------|------------|------------|
| 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٪        |

| نام اوراق                         | ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ |                 | تغییرات طی دوره |              |              |       | ۱۴۰۳/۰۴/۳۱    |         |                 |                 |
|-----------------------------------|------------|-----------------|-----------------|--------------|--------------|-------|---------------|---------|-----------------|-----------------|
|                                   | تعداد      | بهای تمام شده   | خالص ارزش فروش  | خرید طی دوره | فروش طی دوره | تعداد | بهای تمام شده | تعداد   | مبلغ فروش       | تعداد           |
|                                   | ریال       | ریال            | ریال            | ریال         | ریال         | ریال  | ریال          | ریال    | ریال            | ریال            |
| صکوک اجاره خوارزم (۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪) | ۵۰۰,۱۲۲    | ۵۰۰,۰۷۸,۵۷۷,۶۱۸ | ۵۳۰,۷۹۶,۴۷۵,۷۱۴ | ۱۶           | ۱۵,۸۴۱,۸۱۹   | ۰     | ۰             | ۵۰۰,۱۳۸ | ۹۹۰,۰۰۰         | ۵۰۰,۰۹۴,۴۱۹,۴۳۷ |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق (۱۴۰۵۰۹۲۱)    | ۴۴۰,۰۰۰    | ۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰ | ۴۴۲,۰۳۱,۱۷۱,۲۶۸ | ۰            | ۰            | ۰     | ۰             | ۴۴۰,۰۰۰ | ۱,۰۰۰,۰۰۰       | ۴۴۸,۶۱۹,۵۵۹,۶۰۷ |
| جمع                               | ۹۴۰,۱۲۲    | ۹۴۰,۰۹۳,۱۷۷,۶۱۸ | ۹۷۲,۸۲۷,۶۴۶,۹۸۲ | ۱۶           | ۱۵,۸۴۱,۸۱۹   | ۰     | ۰             | ۹۴۰,۱۳۸ | ۹۴۰,۱۰۹,۰۱۹,۴۳۷ | ۹۸۸,۴۶۹,۹۸۲,۸۳۶ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۱-۳- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| مشخصات حساب بانکی       |               |                 |                   |                    |               |                   |                   |               |
|-------------------------|---------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------------|-------------------|-------------------|---------------|
| ۱۴۰۳/۰۴/۳۱              |               | تغییرات طی دوره |                   | ۱۴۰۳/۰۳/۳۱         |               |                   |                   |               |
| سپرده های بانکی         | شماره حساب    | نوع سپرده       | تاریخ افتتاح حساب | نرخ سود علی الحساب | مبلغ          | افزایش            | کاهش              | مبلغ          |
| درصد به کل دارایی‌ها    |               |                 |                   |                    | ریال          | ریال              | ریال              | ریال          |
| بانک صادرات میدان فرهنگ | ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۲/۰۵/۱۴        | ۵                  | ۷۶۲,۰۹۹,۱۱۱   | ۳۵,۸۷۵,۸۰۰        | ۳۳۴,۶۵۶,۳۲۹       | ۴۶۳,۳۱۸,۵۸۲   |
| بانک صادرات میدان فرهنگ | ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۲/۰۵/۱۴        | ۵                  | ۱,۹۰۸,۶۸۰,۸۴۲ | ۱,۰۱۷,۴۵۲,۷۵۵,۳۳۸ | ۱,۰۱۴,۱۸۴,۰۷۴,۲۷۰ | ۵,۱۷۷,۳۶۱,۹۱۰ |
| بانک صادرات میدان فرهنگ | ۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۲/۰۵/۱۴        | ۵                  | ۶,۰۳۲,۴۹۳     | ۳۳,۴۵۳,۱۵۵,۰۵۹    | ۳۰,۹۲۶,۹۹۵,۱۱۶    | ۲,۵۳۲,۱۹۲,۴۳۶ |
| بانک صادرات میدان فرهنگ | ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۲/۰۵/۱۴        | ۵                  | ۹۵۳,۱۹۵,۹۱۹   | ۵۸۲,۲۵۹           | ۳۳۸,۷۰۶,۸۳۲       | ۶۱۵,۰۷۱,۳۴۶   |
| بانک صادرات میدان فرهنگ | ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵ | سپرده کوتاه مدت | ۱۴۰۲/۰۵/۱۴        | ۵                  | ۶۹۶,۳۸۷,۰۴۴   | ۱۲۰,۰۶۹,۷۵۰       | ۳۳۱,۴۶۳,۶۴۲       | ۴۸۴,۹۹۳,۱۵۲   |
| جمع                     |               |                 |                   |                    | ۴,۳۲۶,۳۹۵,۴۰۹ | ۱,۰۵۱,۰۶۲,۴۳۸,۲۰۶ | ۱,۰۴۶,۱۱۵,۸۹۶,۱۸۹ | ۹,۲۷۲,۹۳۷,۴۲۶ |
| ۰.۲۵                    |               |                 |                   |                    |               |                   |                   |               |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| شرح                                                      | یادداشت | مبلغ            | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی ها |
|----------------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------------|----------------------|
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام                       | ۱-۲     | ۱۳۶,۹۹۶,۵۱۵,۰۵۲ | ۳۱.۴۳              | ۳.۶۲                 |
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت | ۲-۲     | ۱۲۸,۲۰۹,۴۲۷,۵۵۷ | ۲۹.۴۲              | ۳.۳۹                 |
| درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی                | ۳-۲     | ۱۳۳,۵۶۹,۳۴۲     | ۰.۰۳               | ۰.۰۰                 |
| سایر درآمدها                                             | ۴-۲     | ۱۷۰,۵۰۷,۳۹۴,۰۳۵ | ۳۹.۱۲              | ۴.۵۱                 |
| جمع                                                      |         | ۴۳۵,۸۴۶,۹۰۵,۹۸۶ | ۱۰۰                | ۱۱.۵                 |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

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

| طی تیر ماه ۱۴۰۳                |                |                  |                |                 |                |                  |                   |                  |                     | ۱۴۰۲/۰۴/۳۱ |  |  |  |  |
|--------------------------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|------------------|-------------------|------------------|---------------------|------------|--|--|--|--|
| سهام                           | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | جمع             | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش        | جمع              | درصد از کل درآمد ها |            |  |  |  |  |
|                                | یادداشت ۱-۲    | یادداشت ۲-۲      | یادداشت ۳-۱-۲  | مبلغ            | یادداشت ۱-۲    | یادداشت ۲-۲      | یادداشت ۳-۱-۲     | مبلغ             |                     |            |  |  |  |  |
|                                | ریال           | ریال             | ریال           | ریال            | ریال           | ریال             | ریال              | ریال             |                     |            |  |  |  |  |
| داروسازی سینا                  | ۵۷,۵۱۷,۸۷۹,۴۹۹ | ۵۸,۰۲۶,۶۰۱,۷۰۳   | ۳,۶۲۹,۰۲۸,۸۴۶  | ۱۱۹,۱۷۳,۵۱۰,۰۴۸ | ۵۴,۶۳          | ۳۹,۱۵۴,۴۰۳,۵۹۴   | ۶,۳۴۸,۳۶۷,۹۹۴     | ۱۰۳,۰۲۰,۶۵۱,۰۸۷  | ۷۵,۲۰               |            |  |  |  |  |
| سرمایه گذاری خوارزمی           | ۰              | ۸۶,۱۹۴,۳۳۹,۱۵۴   | ۰              | ۸۶,۱۹۴,۳۳۹,۱۵۴  | ۳۹,۵۲          | ۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰   | (۲۱۰,۱۹۴,۷۷۷,۱۰۶) | (۹۰,۲۱۱,۶۱۸,۲۴۹) | (۶۵,۸۵)             |            |  |  |  |  |
| ح. بیمه سرمد                   | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | (۲۰,۷۰۶,۰۲۸,۶۸۴) | (۱۵,۱۱)             |            |  |  |  |  |
| بیمه سرمد                      | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | (۲۱,۳۱۱,۲۲۲,۲۵۱) | (۱۵,۵۶)             |            |  |  |  |  |
| صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت  | ۰              | ۸۶۱,۲۳۹,۶۶۲      | ۳,۱۹۳,۰۱۹,۰۶۷  | ۴,۰۵۴,۳۵۸,۷۲۹   | ۱,۸۶           | ۰                | ۱۰,۴۳,۱۲۱,۶۳۸     | ۱۰,۵۳۳,۷۴۸,۴۶۴   | ۸,۴۵                |            |  |  |  |  |
| صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت  | ۰              | ۳۵,۳۲۹,۱۵۲       | ۲۷۵,۸۰۷,۵۸۵    | ۳۱۱,۱۳۶,۷۳۷     | ۰,۱۴           | ۰                | ۳۵,۳۲۹,۱۵۲        | ۱۵,۳۸۵,۱۶۶,۳۳۸   | ۱۱,۱۸               |            |  |  |  |  |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د       | ۰              | ۶۰۷,۰۰۸,۵۹۲      | ۵,۷۶۰,۹۳۰,۹۸۲  | ۶,۳۶۷,۹۳۹,۵۷۴   | ۲,۹۲           | ۰                | ۶۸۸,۰۷۲,۹۴۵       | ۵۹,۰۱۴,۳۰۰,۴۲۲   | ۴۳,۵۸               |            |  |  |  |  |
| صندوق س توسعه فولاد- ثابت      | ۰              | (۱,۱۶۹,۱۴۹,۳۶۷)  | ۳,۱۹۵,۳۹۴,۳۴۳  | ۲,۰۲۶,۲۴۴,۹۷۶   | ۰,۹۳           | ۰                | ۱۰,۱۶۰,۰۴۴,۸۷۰    | ۳۰,۳۹۰,۲۷۰,۹۹۵   | ۲۹,۶۰               |            |  |  |  |  |
| صندوق س پایا ثروت پویا-د       | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۳۸,۵۹۲,۷۶۴       | ۰,۰۳                |            |  |  |  |  |
| صندوق س سپر سرمایه بیدار- ثابت | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۱,۸۴۱,۹۱۵,۷۷۵    | ۱,۳۴                |            |  |  |  |  |
| صندوق س. با درآمد ثابت کمند    | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸      | ۰,۴۵                |            |  |  |  |  |
| صندوق س. کارا -د               | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۵,۹۲۲,۲۱۸,۸۸۸    | ۴,۳۲                |            |  |  |  |  |
| ص.س.درآمد ثابت کیمیا-د         | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۲۹,۰۲۸,۹۷۴,۹۰۶   | ۲۱,۱۹               |            |  |  |  |  |
| صندوق س اعتماد داریک-د         | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۲۸۰,۵۷۷,۲۸۸      | ۰,۳۰                |            |  |  |  |  |
| صندوق س. توسعه افق رابین-د     | ۰              | ۰                | ۰              | ۰               | ۰,۰۰           | ۰                | ۰                 | ۱,۳۲۲,۰۰۴,۵۶۶    | ۰,۹۶                |            |  |  |  |  |
| جمع                            | ۵۷,۵۱۷,۸۷۹,۴۹۹ | ۱۴۴,۵۵۵,۳۶۸,۸۹۶  | ۱۶,۰۵۴,۱۸۰,۸۲۳ | ۲۱۸,۱۲۷,۴۲۹,۲۱۸ | ۱۰۰            | ۹۳,۱۲۳,۸۶۲,۰۴۹   | (۱۵۹,۱۱۳,۸۰۴,۹۰۷) | ۲۰۲,۹۸۹,۴۵۷,۹۱۰  | ۱۳۶,۹۹۶,۵۱۵,۰۵۲     |            |  |  |  |  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۲-۱-درآمد سود سهام

| اطلاعات مجمع                |                  | طی تیر ماه ۱۴۰۳                |                     |                    |               | از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |                    |               |                     |
|-----------------------------|------------------|--------------------------------|---------------------|--------------------|---------------|----------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------------|
| 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                |
| شرکت سرمایه گذاری خوارزمی   | ۱۴۰۲/۰۷/۲۷       | ۷۶۱,۶۲۵,۲۹۵                    | ۱۵۰                 | ۰                  | ۰             | ۰                                            | ۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰     | ۰             | ۳۵,۶۰۵,۹۸۲,۵۵۰      |
| شرکت لابراتوارهای سینا دارو | ۱۴۰۲/۰۷/۲۷       | ۷۶۱,۶۲۵,۲۹۵                    | ۱۵۰                 | ۶۶,۷۷۵,۸۹۴,۳۵۰     | ۹,۲۵۸,۰۱۴,۸۵۱ | ۵۷,۵۱۷,۸۷۹,۴۹۹                               | ۶۶,۷۷۵,۸۹۴,۳۵۰     | ۹,۲۵۸,۰۱۴,۸۵۱ | ۵۷,۵۱۷,۸۷۹,۴۹۹      |
| جمع                         |                  |                                |                     | ۶۶,۷۷۵,۸۹۴,۳۵۰     | ۹,۲۵۸,۰۱۴,۸۵۱ | ۵۷,۵۱۷,۸۷۹,۴۹۹                               | ۱۰۲,۳۸۱,۸۷۶,۹۰۰    | ۰             | ۹۳,۱۲۳,۸۶۲,۰۴۹      |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |                     |                   |             | طی تیر ماه ۱۴۰۳               |                     |                   |             | 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              |             |                                 |
| (۲۱۰,۱۹۴,۷۷۷,۱۰۶)                            | (۱,۵۳۸,۰۶۱,۵۵۵,۱۴۱) | ۱,۳۲۷,۸۶۶,۷۷۸,۰۳۵ | ۸۵۱,۷۱۴,۴۹۵ | ۸۶,۱۹۴,۳۳۹,۱۵۴                | (۱,۲۴۱,۶۷۲,۴۳۸,۸۸۱) | ۱,۳۲۷,۸۶۶,۷۷۸,۰۳۵ | ۸۵۱,۷۱۴,۴۹۵ | سرمایه گذاری خوارزمی            |
| ۳۹,۱۵۴,۴۰۳,۵۹۴                               | (۶۳۸,۴۲۱,۵۳۶,۰۲۶)   | ۶۷۷,۵۷۵,۹۳۹,۶۲۰   | ۴۰,۶۲۲,۴۱۸  | ۵۸,۰۲۶۶۰۱,۷۰۳                 | (۶۱۹,۵۴۹,۳۳۷,۹۱۷)   | ۶۷۷,۵۷۵,۹۳۹,۶۲۰   | ۴۰,۶۲۲,۴۱۸  | داروسازی سینا                   |
| ۱,۰۴۳,۱۲۱,۶۳۸                                | (۶۷,۹۶۸,۷۱۶,۲۱۵)    | ۶۹۰,۱۱,۸۳۷,۸۵۳    | ۱,۴۷۳,۰۰۰   | ۸۶۱,۲۳۹,۶۶۲                   | (۶۸,۱۵۰,۵۹۸,۱۹۱)    | ۶۹۰,۱۱,۸۳۷,۸۵۳    | ۱,۴۷۳,۰۰۰   | صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت   |
| ۳۵,۳۲۹,۱۵۲                                   | (۲۴,۵۷۱,۲۵۸,۲۴۷)    | ۲۴,۶۰۶,۵۸۷,۳۹۹    | ۸۹۱,۰۰۰     | ۳۵,۳۲۹,۱۵۲                    | (۲۴,۵۷۱,۲۵۸,۲۴۷)    | ۲۴,۶۰۶,۵۸۷,۳۹۹    | ۸۹۱,۰۰۰     | صندوق س افرا نماد پایدار-ثابت   |
| ۶۸۸,۰۷۲,۹۴۵                                  | (۲۱۰,۵۸۴,۹۳۴,۷۰۲)   | ۲۱۱,۲۷۳,۰۰۷,۶۴۷   | ۱۶,۱۴۷,۹۱۷  | ۶۰۷,۰۰۸,۵۹۲                   | (۲۱۰,۶۶۵,۹۹۹,۰۵۵)   | ۲۱۱,۲۷۳,۰۰۷,۶۴۷   | ۱۶,۱۴۷,۹۱۷  | صندوق س. دارا الگوریتم-د        |
| ۱۰,۱۶۰,۰۴۴,۸۷۰                               | (۱۳۵,۰۲۳,۲۱۹,۰۴۲)   | ۱۴۵,۱۸۳,۲۶۳,۹۱۲   | ۱۱,۴۴۸,۳۲۰  | (۱,۱۶۹,۱۴۹,۳۶۷)               | (۱۴۶,۳۵۲,۴۱۳,۲۷۹)   | ۱۴۵,۱۸۳,۲۶۳,۹۱۲   | ۱۱,۴۴۸,۳۲۰  | صندوق س توسعه فولاد- ثابت       |
| (۹,۲۰۰,۰۰۰)                                  | (۴۳۹,۹۵۸,۶۰۰,۰۰۰)   | ۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰   | ۴۴۰,۰۰۰     | .                             | (۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)   | ۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰   | ۴۴۰,۰۰۰     | مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱    |
| (۴,۹۴۲,۲۸۵,۵۷۶)                              | (۵۰۰,۰۲۱,۹۶۴,۸۶۴)   | ۴۹۵,۰۷۹,۶۷۹,۲۸۸   | ۵۰۰,۱۳۸     | (۲۲,۲۱۶)                      | (۴۹۵,۰۷۹,۷۰۱,۵۰۴)   | ۴۹۵,۰۷۹,۶۷۹,۲۸۸   | ۵۰۰,۱۳۸     | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| (۱۶۴,۰۶۵,۲۹۰,۴۸۳)                            | (۳,۵۵۴,۶۱۱,۷۸۴,۳۳۷) | ۳,۳۹۰,۵۴۶,۴۹۳,۷۵۴ | ۹۲۳,۲۲۷,۲۸۸ | ۱۴۴,۵۵۵,۳۴۶,۶۸۰               | (۳,۲۴۵,۹۹۱,۱۴۷,۰۷۴) | ۳,۳۹۰,۵۴۶,۴۹۳,۷۵۴ | ۹۲۳,۲۲۷,۲۸۸ | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۲-۱-۳ سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| طی تیر ماه ۱۴۰۳ |                   |                     |                         | از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |                    |                      |                         | 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                    |                                 |
| ۲,۸۰۰,۰۰۰       | ۴۷,۵۷۱,۰۵۹,۲۰۰    | (۴۳,۹۴۲,۰۳۰,۳۵۴)    | ۳,۶۲۹,۰۲۸,۸۴۶           | ۵,۰۵۴,۹۰۱                                    | ۸۵,۳۶۲,۰۳۵,۴۴۱     | (۷۹,۰۱۳,۶۶۷,۴۴۷)     | ۶,۳۴۸,۳۶۷,۹۹۴           | داروسازی سینا                   |
| ۱۱,۶۹۸,۶۰۰      | ۵۴۰,۲۷۲,۹۰۴,۵۹۷   | (۵۳۷,۰۰۷۹,۸۸۵,۵۳۰)  | ۳,۱۹۳,۰۱۹,۰۶۷           | ۴۰,۵۰۵,۱۰۰                                   | ۱,۷۸۹,۱۲۱,۰۸۸,۸۶۱  | (۱,۷۷۸,۵۸۷,۳۴۰,۳۹۷)  | ۱۰,۵۳۳,۷۴۸,۴۶۴          | صندوق ارمنان فیروزه آسیا-ثابت   |
| ۷,۱۴۳,۰۰۰       | ۱۹۷,۰۵۶,۵۶۱,۰۵۴   | (۱۹۶,۷۸۰,۷۵۳,۴۶۹)   | ۲۷۵,۸۰۷,۵۸۵             | ۱۰۲,۸۱۸,۹۷۰                                  | ۲,۴۹۲,۴۲۲,۱۸۱,۶۶۲  | (۲,۴۷۷,۱۳۷,۰۱۵,۳۲۴)  | ۱۵,۲۸۵,۱۶۶,۳۳۸          | صندوق سی افرا نماد پایدار-ثابت  |
| ۹۸,۹۴۷,۴۸۵      | ۱,۲۸۳,۸۴۲,۴۳۱,۴۳۹ | (۱,۲۷۸,۰۸۱,۵۰۰,۴۵۷) | ۵,۷۶۰,۹۳۰,۹۸۲           | ۱,۷۷۲,۲۵۴,۲۰۴                                | ۲۰,۶۹۱,۶۷۵,۶۸۱,۳۷۴ | (۲۰,۶۳۲,۶۶۱,۳۸۰,۹۵۲) | ۵۹,۰۱۴,۳۰۰,۴۲۲          | صندوق سی. دارا الگوریتم-د       |
| ۱,۹۰۶,۶۹۰       | ۲۴۰,۱۱,۲۵۷,۷۷۹    | (۲۰,۸۱۵,۸۶۳,۴۳۶)    | ۳,۱۹۵,۳۹۴,۳۴۳           | ۵۷,۵۰۴,۵۲۰                                   | ۶۷۱,۷۰۷۰,۱۶۸,۴۰    | (۶۴۱,۳۱۶,۷۴۵,۸۴۵)    | ۳۰,۳۹۰,۲۷۰,۹۹۵          | صندوق سی توسعه فولاد- ثابت      |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۹۰,۹۵۷,۲۵۱                                   | ۱,۶۹۷,۷۵۹,۹۰۵,۲۳۶  | (۱,۶۱۳,۳۸۲,۷۲۸,۹۲۹)  | ۸۴,۳۷۷,۱۷۶,۳۰۷          | سرمایه گذاری خوارزمی            |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۲۰۰,۰۰۰                                      | ۲,۴۲۱,۳۴۵,۹۱۴      | (۲,۳۸۲,۷۵۳,۱۵۰)      | ۳۸,۵۹۲,۷۶۴              | صندوق سی.پایا ثروت پویا-د       |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۵۶۷۶,۰۰۰                                     | ۱۱۲,۱۰۰,۲۴۲,۴۶۱    | (۱۱۰,۲۵۸,۳۲۶,۶۸۶)    | ۱,۸۴۱,۹۱۵,۷۷۵           | صندوق سی سپر سرمایه بیدار- ثابت |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۲۱,۲۷۴,۰۰۰                                   | ۲۱۴,۹۳۶,۴۸۲,۷۴۵    | (۲۱۴,۳۱۶,۰۸۸,۷۰۷)    | ۶۲۰,۳۹۴,۰۳۸             | صندوق سی. با درآمد ثابت کمند    |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۵۲,۸۹۴,۰۲۰                                   | ۸۵۲,۷۶۸,۲۲۱,۴۲۳    | (۸۴۶,۸۴۶,۰۰۲,۵۳۵)    | ۵,۹۲۲,۲۱۸,۸۸۸           | صندوق سی. کارا -د               |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۸۰,۷۸۵,۱۱۰                                   | ۹۰۵,۷۳۰,۲۷۷,۵۸۲    | (۸۷۶,۷۰۱,۳۰۲,۶۷۶)    | ۲۹,۰۲۸,۹۷۴,۹۰۶          | ص.س.درآمد ثابت کیمیا-د          |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۳۴,۵۳۶,۱۴۳                                   | ۹۸۲,۶۶۹,۱۲۰        | (۳۱,۶۸۸,۶۹۷,۸۰۴)     | (۳۰,۷۰۶۰,۲۸,۶۸۴)        | ح. بیمه سرمد                    |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۷۲,۱۰۸,۰۱۱                                   | ۸۸,۱۵۶,۸۶۸,۱۲۴     | (۱۰۹,۴۶۸,۰۹۰,۳۷۵)    | (۲۱,۳۱۱,۲۲۲,۲۵۱)        | بیمه سرمد                       |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۱۰,۵۵۰,۰۰۰                                   | ۱۸,۷۸۱,۸۰۷,۷۵۶     | (۱۸,۵۰۱,۲۳۰,۳۶۸)     | ۲۸۰,۵۷۷,۲۸۸             | صندوق سی.اعتماد داریک-د         |
| .               | .                 | .                   | .                       | ۲,۰۰۰,۰۰۰                                    | ۲۴,۹۵۹,۵۷۱,۶۹۱     | (۲۳,۶۳۷,۵۶۷,۱۲۵)     | ۱,۳۲۲,۰۰۴,۵۶۶           | صندوق سی. توسعه افق رایین-د     |
| ۱۲۲,۴۹۵,۷۷۵     | ۲,۰۹۲,۷۵۴,۲۱۴,۰۶۹ | (۲,۰۷۶,۷۰۰,۰۲۳,۲۴۶) | ۱۶,۰۵۴,۱۸۰,۸۲۳          | ۳,۱۵۸,۲۴۲,۲۳۰                                | ۲۹,۶۴۸,۸۸۵,۳۹۶,۲۳۰ | (۲۹,۴۴۵,۸۹۸,۹۳۸,۳۲۰) | ۲۰۲,۹۸۶,۴۵۷,۹۱۰         | جمع                             |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |                  |               |                 | طی تیر ماه ۱۴۰۳ |                  |               |                                              |                                  |
|----------------------------------------------|------------------|---------------|-----------------|-----------------|------------------|---------------|----------------------------------------------|----------------------------------|
| درآمد سود اوراق                              | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع             | درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش    | جمع                                          | اوراق بهادار با درآمد ثابت       |
| یادداشت ۱-۲-۲                                | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۳-۱-۲ | طی تیر ماه ۱۴۰۳ | یادداشت ۱-۲-۲   | یادداشت ۲-۱-۲    | یادداشت ۳-۱-۲ | از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |                                  |
| ریال                                         | ریال             | ریال          | ریال            | ریال            | ریال             | ریال          | ریال                                         |                                  |
| ۹,۰۳۶,۸۱۸,۱۱۲                                | (۲۲,۲۱۶)         | ۰             | ۹,۰۳۶,۷۹۵,۸۹۶   | ۶۸,۵۸۸,۵۳۳,۲۶۶  | (۴,۹۴۲,۲۸۵,۵۷۶)  | ۰             | ۶۳,۶۴۶,۲۴۷,۶۹۰                               | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| ۶,۵۸۸,۳۸۸,۳۳۹                                | ۰                | ۰             | ۶,۵۸۸,۳۸۸,۳۳۹   | ۶۴,۵۷۲,۳۷۹,۸۶۷  | (۹,۲۰۰,۰۰۰)      | ۰             | ۶۴,۵۶۳,۱۷۹,۸۶۷                               | مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱     |
| ۱۵,۶۲۵,۲۰۶,۴۵۱                               | (۲۲,۲۱۶)         | ۰             | ۱۵,۶۲۵,۱۸۴,۲۳۵  | ۱۳۳,۱۶۰,۹۱۳,۱۳۳ | (۴,۹۵۱,۴۸۵,۵۷۶)  | ۰             | ۱۲۸,۲۰۹,۴۲۷,۵۵۷                              | جمع                              |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۱-۲-۲ سود سپرده بانکی و اوراق

| از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |             |                 | طی تیر ماه ۱۴۰۳ |             |                | 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              |                                  |
| ۶۴,۵۷۲,۳۷۹,۸۶۷                               | ۰           | ۶۴,۵۷۲,۳۷۹,۸۶۷  | ۶,۵۸۸,۳۸۸,۳۳۹   | ۰           | ۶,۵۸۸,۳۸۸,۳۳۹  | ۱۸                | ۱۴۰۵/۰۹/۲۱    | -                 | مراجعه ت. صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱    |
| ۶۸,۵۸۸,۵۳۳,۲۶۶                               | ۰           | ۶۸,۵۸۸,۵۳۳,۲۶۶  | ۹,۰۳۶,۸۱۸,۱۱۲   | ۰           | ۹,۰۳۶,۸۱۸,۱۱۲  | ۲۰                | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸    | -                 | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| ۲۷,۶۷۲,۸۳۲                                   | ۰           | ۲۷,۶۷۲,۸۳۲      | ۱,۹۰۲,۰۶۱       | ۰           | ۱,۹۰۲,۰۶۱      | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷        |
| ۱۱,۲۴۰,۹۱۳                                   | ۰           | ۱۱,۲۴۰,۹۱۳      | ۴۲۲,۲۲۷         | ۰           | ۴۲۲,۲۲۷        | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰        |
| ۱,۳۲۸,۱۶۸                                    | ۰           | ۱,۳۲۸,۱۶۸       | ۲۵,۵۴۷          | ۰           | ۲۵,۵۴۷         | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۲۰۳۶۶۷۰۰۸         |
| ۲,۲۷۴,۱۳۱                                    | ۰           | ۲,۲۷۴,۱۳۱       | ۴۵۴,۸۳۵         | ۰           | ۴۵۴,۸۳۵        | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱        |
| ۲۰,۶۲۴,۶۵۸                                   | ۰           | ۲۰,۶۲۴,۶۵۸      | ۱,۵۴۶,۶۶۲       | ۰           | ۱,۵۴۶,۶۶۲      | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵        |
| ۷۰,۴۲۸,۶۴۰                                   | ۰           | ۷۰,۴۲۸,۶۴۰      | ۰               | ۰           | ۰              | ۵                 | -             | ۱۴                | بانک صادرات ۰۲۱۸۲۰۳۷۰۲۰۰۲        |
| ۱۳۳,۲۹۴,۴۸۲,۴۷۵                              | -           | ۱۳۳,۲۹۴,۴۸۲,۴۷۵ | ۱۵,۶۲۹,۵۵۷,۷۸۳  | -           | ۱۵,۶۲۹,۵۵۷,۷۸۳ |                   |               |                   |                                  |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

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

| نام سپرده بانکی                 |                               | طی تیر ماه ۱۴۰۳           |                               | از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه سال ۱۴۰۳ |           |
|---------------------------------|-------------------------------|---------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------|-----------|
| نام سپرده                       | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | درصد سود به میانگین سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | درصد سود به میانگین سپرده                    | نام سپرده |
|                                 |                               |                           |                               |                                              |           |
|                                 |                               |                           |                               |                                              |           |
|                                 |                               |                           | یادداشت ۱-۲-۲                 | یادداشت ۱-۲-۲                                |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۴۹۱۰۰۷ | ۱,۹۰۲,۰۶۱                     | ۴۳.۷۱                     | ۲۷,۶۷۲,۸۳۲                    | ۲۰.۷۲                                        |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۵۰۰۰۰۰ | ۴۲۲,۲۲۷                       | ۹.۷۰                      | ۱۱,۲۴۰,۹۱۳                    | ۸.۴۲                                         |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۶۷۰۰۸ | ۲۵,۵۴۷                        | ۰.۵۹                      | ۱,۳۲۸,۱۶۸                     | ۰.۹۹                                         |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۷۲۰۰۱ | ۴۵۴,۸۳۵                       | ۱۰.۴۵                     | ۲,۲۷۴,۱۳۱                     | ۱.۷۰                                         |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۶۹۵۰۰۵ | ۱,۵۴۶,۶۶۲                     | ۳۵.۵۴                     | ۲۰,۶۲۴,۶۵۸                    | ۱۵.۴۴                                        |           |
| بانک صادرات فرهنگ ۰۲۱۸۲۰۳۷۰۲۰۰۲ | .                             | ۰.۰۰                      | ۷۰,۴۲۸,۶۴۰                    | ۵۲.۷۳                                        |           |
| جمع                             | ۴,۳۵۱,۳۳۲                     | ۱۰۰                       | ۱۳۳,۵۶۹,۳۴۲                   | ۱۰۰                                          |           |

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۱ تیر ماه ۱۴۰۳

۲-۴- سایر درآمدها:

| از ابتدای سال مالی تا پایان تیر ماه<br>سال ۱۴۰۳ | طی تیر ماه ۱۴۰۳ |                    |
|-------------------------------------------------|-----------------|--------------------|
| مبلغ                                            | مبلغ            | سایر درآمدها       |
| ریال                                            | ریال            |                    |
| ۱۶۷,۱۸۹,۵۱۷,۷۶۳                                 | ۱۶,۷۲۹,۹۸۳,۷۶۲  | کارمزد بازارگردانی |
| ۳,۳۱۷,۸۷۶,۲۷۲                                   | ۲۸۱,۰۲۲,۲۳۱     | سایر درآمدها       |
| ۱۷۰,۵۰۷,۳۹۴,۰۳۵                                 | ۱۷,۰۱۱,۰۰۵,۹۹۳  | جمع                |