

# گزارش صورت و وضعیت پرتفوی ماژنه



صندوق سرمایه‌گذاری  
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

برای دوره یک ماهه منتهی به مهرماه ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۱- سرمایه گذاری ها

۱-۱-سرمایه‌گذاری در سهام

| تغییرات طی دوره      |             |                   |                   |              |                |              |                 |             |                   |                   |                      |
|----------------------|-------------|-------------------|-------------------|--------------|----------------|--------------|-----------------|-------------|-------------------|-------------------|----------------------|
| ۱۴۰۴/۰۶/۳۱           |             |                   |                   | ۱۴۰۴/۰۷/۳۰   |                |              |                 |             |                   |                   |                      |
| شرکت                 | تعداد       | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش    | خرید طی دوره |                | فروش طی دوره |                 | تعداد       | قیمت بازار هر سهم | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش       |
|                      |             |                   |                   | تعداد        | بهای تمام شده  | تعداد        | مبلغ فروش       |             |                   |                   |                      |
|                      |             | ریال              | ریال              |              | ریال           |              | ریال            |             | ریال              | ریال              | درصد به کل دارایی‌ها |
| داروسازی سینا        | ۳۱,۳۱۰,۶۱۴  | ۵۲۰,۱۱۳,۱۴۸,۹۳۷   | ۹۱۲,۴۶۲,۳۸۹,۵۹۷   | ۳۴۵,۰۰۰      | ۱۰,۸۹۸,۰۸۰,۴۱۳ | (۳۴۵,۰۰۰)    | ۱۰,۶۶۷,۸۱۰,۰۰۶۲ | ۳۱,۳۱۰,۶۱۴  | ۳۵,۱۰۰            | ۵۲۵,۲۸۰,۲۹۶,۱۷۸   | ۱,۰۹۸,۳۳۴,۳۵۷,۸۴۹    |
| سرمایه گذاری خوارزمی | ۹۴۸,۹۵۳,۲۳۲ | ۱,۷۸۶,۸۴۷,۰۸۴,۵۰۷ | ۲,۱۵۷,۵۵۶,۰۱۰,۶۹۰ | ۲۱,۹۷۸,۰۰۰   | ۴۹,۵۱۲,۶۸۱,۷۲۶ | (۷۶,۹۲۳,۰۰۰) | ۱۸۷,۶۶۵,۸۶۳,۰۵۷ | ۸۹۴,۰۰۸,۲۳۲ | ۲,۹۸۱             | ۱,۶۹۱,۰۲۱,۲۴۹,۲۸۲ | ۲,۶۶۳,۴۱۸,۱۹۶,۱۶۰    |
| جمع                  | ۹۸۰,۲۶۳,۸۴۶ | ۲,۳۰۶,۹۶۰,۲۳۳,۴۴۴ | ۳,۰۷۰,۰۱۸,۴۰۰,۲۸۷ | ۲۲,۲۲۳,۰۰۰   | ۶۰,۴۱۰,۷۶۲,۱۳۹ | (۷۷,۲۶۸,۰۰۰) | ۱۹۸,۳۳۳,۶۷۳,۱۱۹ | ۹۲۵,۳۱۸,۸۴۶ |                   | ۲,۲۱۶,۳۰۱,۵۴۵,۴۶۰ | ۳,۷۶۱,۷۵۲,۵۵۴,۰۰۹    |
|                      |             |                   |                   |              |                |              |                 |             |                   |                   | ۴۵.۲۹                |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
 صورت وضعیت پرتفوی  
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۱- سرمایه گذاری ها  
 ۲-۱-سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه گذاری

| تغییرات طی دوره                |            |                 |                 |                   |                    |               |                    |                     |                   |                   |                      |       |
|--------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-------------------|--------------------|---------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|----------------------|-------|
| ۱۴۰۴/۰۷/۳۰                     |            |                 |                 |                   |                    | ۱۴۰۴/۰۶/۳۱    |                    |                     |                   |                   |                      |       |
| صندوق                          | تعداد      | بهای تمام شده   | خالص ارزش فروش  | خرید/صدور طی دوره |                    |               |                    | فروش/ ابطال طی دوره |                   |                   |                      |       |
|                                |            |                 |                 | تعداد             | بهای تمام شده      | تعداد         | مبلغ فروش          | تعداد               | قیمت بازار هر سهم | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش       |       |
|                                | ریال       | ریال            | ریال            | ریال              | ریال               | ریال          | ریال               | ریال                | ریال              | ریال              | درصد به کل دارایی‌ها |       |
| صندوق ارمغان فیروزه آسیا- ثابت | ۲,۳۰۲,۳۶۰  | ۱۴۹,۴۵۹,۵۲۱,۶۴۱ | ۱۵۲,۴۸۶,۶۳۶,۸۷۴ | ۲۷,۲۸۳,۹۵۰        | ۱,۸۶۹,۶۱۴,۷۴۹,۳۸۵  | (۲۵,۹۴۴,۷۷۰)  | ۱,۷۴۱,۳۱۰,۰۸۸,۹۷۹  | ۴,۲۸۳,۵۴۰           | ۶۷,۹۹۳            | ۲۸۳,۶۲۴,۳۵۲,۶۶۸   | ۲۹۱,۱۹۶,۱۲۵,۷۰۷      | ۳۵۱   |
| صندوق تداوم اطمینان تمدن- ثابت | ۲۷,۹۰۴,۵۰۰ | ۴۹۵,۲۵۳,۶۳۳,۷۷۸ | ۵۳۵,۲۴۷,۴۵۴,۷۸۱ | ۱۰,۴۹۶,۳۴۰        | ۸۹۹,۷۱۵,۵۴۱        | (۵۶,۷۲۰)      | ۱,۰۹۱,۴۸۷,۶۳۲      | ۲۷,۸۹۴,۵۰۰          | ۱۹,۶۸۷            | ۴۹۵,۰۹۶,۹۴۵,۵۳۰   | ۵۴۹,۰۵۶,۰۵۴,۱۸۳      | ۶۶۱   |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د       | ۱۳,۵۴۴,۷۴۰ | ۲۴۶,۵۲۹,۳۰۲,۴۹۸ | ۲۴۸,۱۷۲,۸۲۵,۶۱۲ | ۲۸۰,۲۲۱,۲۱۰       | ۱۲,۲۶۶,۹۱۶,۷۷۴,۶۷۵ | (۵۴۴,۸۴۴,۳۷۶) | ۱۰,۱۳۵,۱۵۷,۰۰۹,۳۲۴ | ۱۲۹,۰۹۲,۰۷۴         | ۱۸,۷۹۴            | ۲,۴۲۱,۰۶۱,۶۰۳,۷۷۴ | ۲,۴۲۶,۰۸۳,۶۵۴,۰۶۳    | ۲۹,۲۱ |
| صندوق س.مانا الگوریتم-سپاهم    | ۱۰,۵۷,۴۰۲  | ۹,۹۸۵,۶۷۶,۶۱۱   | ۹,۶۷۳,۳۹۰,۰۰۷   | ۲۷۵,۶۶۳           | ۴۱,۰۸۶,۶۸۳,۴۲۶     | (۱,۱۹۵,۴۵۳)   | ۱۱,۸۳۶,۱۰۰,۸۰۰     | ۳,۹۲۰,۲۳۰           | ۱۰,۵۳۰            | ۳۹,۸۱۵,۶۴۷,۵۶۷    | ۴۱,۲۷۲,۱۷۸,۶۹۶       | ۰,۵۰  |
| صندوق س.بخشی فرا الگوریتم ۱-ب  | ۲,۲۹۷,۱۳۷  | ۲۲,۹۹۵,۲۷۵,۵۷۶  | ۲۳,۵۹۸,۵۹۸,۰۸۹  | ۲۸,۱۸۳,۵۵۱        | ۹۲,۰۱۷,۵۷۶,۱۰۰     | (۷,۸۴۵,۰۲۳)   | ۸۸,۰۰۲۷,۳۴۵,۹۰۲    | ۲,۷۰۲,۵۵۹           | ۱۲,۴۳۹            | ۳۰,۹۲۰,۲۶۴,۱۲۱    | ۳۳,۶۱۰,۷۴۴,۱۴۶       | ۰,۴۰  |
| صندوق س توسعه فولاد- ثابت      | ۰          | ۰               | ۰               | ۲۰,۰۰۰,۰۰۰        | ۳۵۴,۲۰۶,۴۰۱,۱۸۰    | (۲۰,۰۰۰,۰۰۰)  | ۳۵۴,۴۷۳,۵۲۳,۷۸۷    | ۰                   | ۰                 | ۰                 | ۰                    | ۰,۰۰  |
| جمع                            | ۴۷,۱۰۶,۱۳۹ | ۹۲۴,۲۲۳,۴۱۰,۱۰۴ | ۹۶۹,۱۷۸,۹۰۵,۳۶۳ | ۳۶۶,۴۶۰,۷۱۴       | ۱۴,۲۷۰,۵۳۵,۴۹۹,۱۲۷ | (۵۹۹,۸۸۶,۳۴۲) | ۱۱,۹۷۷,۴۲۴,۰۳۲,۶۳۷ | ۱۶۷,۸۹۲,۹۰۳         |                   | ۳,۲۷۰,۵۱۸,۸۱۳,۶۶۰ | ۳,۳۴۱,۲۱۸,۷۵۶,۷۹۵    | ۴۰,۲۳ |

| اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                      |                                |                    |              |              |      |              |      |         |                    |                 |                                     |       |
|------------------------------------|----------------------|--------------------------------|--------------------|--------------|--------------|------|--------------|------|---------|--------------------|-----------------|-------------------------------------|-------|
| نام اوراق                          | دارای مجوز از سازمان | پذیرفته شده در بورس یا فرابورس | تاریخ انتشار اوراق | تاریخ سررسید | ۱۴۰۴/۰۶/۳۱   |      | ۱۴۰۴/۰۷/۳۰   |      |         |                    |                 |                                     |       |
|                                    |                      |                                |                    |              |              |      |              |      |         |                    |                 |                                     |       |
|                                    |                      |                                |                    |              |              |      |              |      |         |                    |                 |                                     |       |
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪   | بله                  | بله                            | ۱۴۰۰/۱۱/۱۸         | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸   | ۲۰٪          | ۲۰٪  | ۲۰٪          | ۲۰٪  |         |                    |                 |                                     |       |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱       | بله                  | بله                            | ۱۴۰۱/۰۹/۲۱         | ۱۴۰۵/۰۹/۲۱   | ۱۸٪          | ۱۸٪  | ۱۸٪          | ۱۸٪  |         |                    |                 |                                     |       |
| تغییرات طی دوره                    |                      |                                |                    |              |              |      |              |      |         |                    |                 |                                     |       |
| 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 درصد به کل دارایی ها |       |
|                                    |                      |                                | تعداد              | ریال         | تعداد        | ریال | تعداد        | ریال |         |                    |                 |                                     | تعداد |
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪   | ۵۰۹,۱۳۸              | ۵۰۹,۰۰۵,۴۴۴,۰۸۷                | ۵۱۵,۲۹۶,۸۸۹,۰۳۵    | ۰            | ۰            | ۰    | ۰            | ۰    | ۵۰۹,۱۳۸ | ۹۹۰,۰۰۰            | ۵۰۹,۰۰۵,۴۴۴,۰۸۷ | ۵۲۳,۳۴۸,۲۸۶,۹۸۷                     | ۶.۳۰  |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱       | ۴۴۰,۰۰۰              | ۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰                | ۴۴۲,۰۲۵,۶۹۴,۷۸۵    | ۰            | ۰            | ۰    | ۰            | ۰    | ۴۴۰,۰۰۰ | ۱,۰۰۰,۰۰۰          | ۴۴۰,۰۱۴,۶۰۰,۰۰۰ | ۴۴۸,۳۸۴,۴۱۶,۲۵۳                     | ۵.۴۰  |
| جمع                                | ۹۴۹,۱۳۸              | ۹۴۹,۰۲۰,۰۴۴,۰۸۷                | ۹۵۷,۳۲۲,۵۸۳,۸۲۰    | ۰            | ۰            | ۰    | ۰            | ۰    | ۹۴۹,۱۳۸ |                    | ۹۴۹,۰۲۰,۰۴۴,۰۸۷ | ۹۷۱,۷۳۲,۷۰۳,۲۴۰                     | ۱۱.۷۰ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت پرتفوی

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۳-۱- سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی

| ۱۴۰۴/۰۷/۳۰           |               | تغییرات طی دوره      |                    | ۱۴۰۴/۰۶/۳۱     |                             |
|----------------------|---------------|----------------------|--------------------|----------------|-----------------------------|
| درصد به کل دارایی‌ها | مبلغ          | کاهش                 | افزایش             | مبلغ           | سپرده های بانکی             |
| درصد                 | ریال          | ریال                 | ریال               | ریال           |                             |
| ۰.۰۸                 | ۶,۳۷۸,۳۹۱,۶۶۵ | (۱۰,۰۶۲,۰۰۰,۹۰۷,۴۸۵) | ۱۰,۰۵۷,۸۷۲,۳۸۵,۱۱۱ | ۱۰,۵۰۶,۹۱۴,۰۳۹ | سپرده بانکی نزد بانک صادرات |
| ۰.۰۸                 | ۶,۳۷۸,۳۹۱,۶۶۵ | (۱۰,۰۶۲,۰۰۰,۹۰۷,۴۸۵) | ۱۰,۰۵۷,۸۷۲,۳۸۵,۱۱۱ | ۱۰,۵۰۶,۹۱۴,۰۳۹ | جمع                         |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

| شرح                                                          | یادداشت | مبلغ            | درصد از کل درآمدها | درصد از کل دارایی‌ها |
|--------------------------------------------------------------|---------|-----------------|--------------------|----------------------|
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم سهام            | ۱-۲     | ۸۲۹,۶۵۷,۰۶۴,۷۰۱ | ۸۷.۵۰              | ۹.۹۹                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق‌های سرمایه‌گذاری | ۲-۲     | ۷۹,۱۹۲,۹۷۳,۳۴۹  | ۸.۳۵               | ۰.۹۵                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت     | ۳-۲     | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰  | ۱.۵۲               | ۰.۱۷                 |
| درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده      | ۴-۲     | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲      | ۰.۰۰               | ۰.۰۰                 |
| سایر درآمدها                                                 | ۵-۲     | ۲۴,۹۰۳,۰۲۹,۳۰۲  | ۲.۶۳               | ۰.۳۰                 |
| جمع                                                          |         | ۹۴۸,۱۷۷,۰۶۰,۷۶۴ | ۱۰۰                | ۱۱.۴                 |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |                 |                |                  |                | طی مهر ماه ۱۴۰۴ |                 |                |                  |                |                             |
|----------------------------------------------|-----------------|----------------|------------------|----------------|-----------------|-----------------|----------------|------------------|----------------|-----------------------------|
| جمع                                          |                 | درآمد فروش     | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود سهام | جمع             |                 | درآمد فروش     | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود سهام | سهام                        |
| درصد از کل                                   | مبلغ            |                |                  |                | درصد از کل      | مبلغ            |                |                  |                |                             |
| درآمدها                                      | ریال            |                |                  |                | درآمدها         | ریال            | ریال           | ریال             | ریال           |                             |
| ۶۷.۹۲                                        | ۶۴۴,۰۱۵,۳۶۶,۸۰۱ | ۱۲,۸۲۰,۲۲۱,۵۱۱ | ۶۳۱,۱۹۵,۱۴۵,۲۹۰  | ۰              | ۶۷.۹۲           | ۶۴۴,۰۱۵,۳۶۶,۸۰۱ | ۱۲,۸۲۰,۲۲۱,۵۱۱ | ۶۳۱,۱۹۵,۱۴۵,۲۹۰  | ۰              | سرمایه گذاری خوارزمی        |
| ۱۹.۵۸                                        | ۱۸۵,۶۴۱,۶۹۷,۹۰۰ | ۶۱۳,۷۲۶,۶۶۲    | ۱۸۵,۰۲۷,۹۷۱,۲۳۸  | ۰              | ۱۹.۵۸           | ۱۸۵,۶۴۱,۶۹۷,۹۰۰ | ۶۱۳,۷۲۶,۶۶۲    | ۱۸۵,۰۲۷,۹۷۱,۲۳۸  | ۰              | شرکت لابراتوارهای سینا دارو |
| ۸۸                                           | ۸۲۹,۶۵۷,۰۶۴,۷۰۱ | ۱۳,۴۳۳,۹۴۸,۱۷۳ | ۸۱۶,۲۲۳,۱۱۶,۵۲۸  | ۰              | ۸۸              | ۸۲۹,۶۵۷,۰۶۴,۷۰۱ | ۱۳,۴۳۳,۹۴۸,۱۷۳ | ۸۱۶,۲۲۳,۱۱۶,۵۲۸  | ۰              | جمع                         |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۱-درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |                     |                   |               | طی مهر ماه ۱۴۰۴               |                     |                   |               | 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              |               |                                  |
| ۶۳۱,۱۹۵,۱۴۵,۲۹۰                              | (۲,۰۳۲,۲۲۳,۰۵۰,۸۶۹) | ۲,۶۶۳,۴۱۸,۱۹۶,۱۵۹ | ۸۹۴,۰۰۸,۲۳۲   | ۶۳۱,۱۹۵,۱۴۵,۲۹۰               | (۲,۰۳۲,۲۲۳,۰۵۰,۸۶۹) | ۲,۶۶۳,۴۱۸,۱۹۶,۱۵۹ | ۸۹۴,۰۰۸,۲۳۲   | سرمایه گذاری خوارزمی             |
| ۱۸۵,۰۲۷,۹۷۱,۲۳۸                              | (۹۱۳,۳۰۶,۳۸۶,۶۱۰)   | ۱,۰۹۸,۳۳۴,۳۵۷,۸۴۸ | ۳۱,۳۱۰,۶۱۴    | ۱۸۵,۰۲۷,۹۷۱,۲۳۸               | (۹۱۳,۳۰۶,۳۸۶,۶۱۰)   | ۱,۰۹۸,۳۳۴,۳۵۷,۸۴۸ | ۳۱,۳۱۰,۶۱۴    | شرکت لابراتوارهای سینا دارو      |
| ۱۳,۹۹۶,۸۵۳,۰۲۸                               | (۵۳۵,۰۵۹,۲۰۱,۱۵۵)   | ۵۴۹,۰۵۶,۰۵۴,۱۸۳   | ۲۷,۸۹۴,۵۰۰    | ۱۳,۹۹۶,۸۵۳,۰۳۰                | (۵۳۵,۰۵۹,۲۰۱,۱۵۳)   | ۵۴۹,۰۵۶,۰۵۴,۱۸۳   | ۲۷,۸۹۴,۵۰۰    | صندوق تداوم اطمینان تمدن-ثابت    |
| ۵۰,۱۱,۴۳۹,۲۹۲                                | (۲,۴۲۱,۰۷۲,۲۱۴,۷۷۰) | ۲,۴۲۶,۰۸۳,۶۵۴,۰۶۲ | ۱۲۹,۰۹۲,۰۷۴   | ۵۰,۱۱,۴۳۹,۲۹۲                 | (۲,۴۲۱,۰۷۲,۲۱۴,۷۷۰) | ۲,۴۲۶,۰۸۳,۶۵۴,۰۶۲ | ۱۲۹,۰۹۲,۰۷۴   | صندوق س. دارا الگوریتم-د         |
| ۵,۵۵۲,۶۶۹,۲۹۵                                | (۲۸۵,۶۴۳,۴۵۶,۴۱۲)   | ۲۹۱,۱۹۶,۱۲۵,۷۰۷   | ۴,۲۸۳,۵۴۰     | ۵,۵۵۲,۶۶۹,۲۹۶                 | (۲۸۵,۶۴۳,۴۵۶,۴۱۱)   | ۲۹۱,۱۹۶,۱۲۵,۷۰۷   | ۴,۲۸۳,۵۴۰     | صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت    |
| ۱,۴۵۶,۵۳۱,۱۲۸                                | (۳۹,۸۱۵,۶۴۷,۵۶۷)    | ۴۱,۲۷۲,۱۷۸,۶۹۵    | ۳,۹۲۰,۲۳۰     | ۱,۴۵۶,۵۳۱,۱۲۸                 | (۳۹,۸۱۵,۶۴۷,۵۶۷)    | ۴۱,۲۷۲,۱۷۸,۶۹۵    | ۳,۹۲۰,۲۳۰     | صندوق س.مانا الگوریتم-سهام       |
| ۲,۶۲۸,۶۳۰,۴۰۱                                | (۳۰,۹۸۲,۱۱۳,۷۴۵)    | ۳۳,۶۱۰,۷۴۴,۱۴۶    | ۲,۷۰۲,۵۵۹     | ۲,۶۲۸,۶۳۰,۴۰۱                 | (۳۰,۹۸۲,۱۱۳,۷۴۵)    | ۳۳,۶۱۰,۷۴۴,۱۴۶    | ۲,۷۰۲,۵۵۹     | صندوق س.بخشی فرا الگوریتم ۱-ب    |
| ۰                                            | (۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸)   | ۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸   | ۵۰۹,۱۳۸       | ۰                             | (۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸)   | ۵۰۳,۹۸۸,۶۵۴,۶۳۸   | ۵۰۹,۱۳۸       | صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ |
| ۰                                            | (۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)   | ۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰   | ۴۴۰,۰۰۰       | ۰                             | (۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰)   | ۴۳۹,۹۴۹,۴۰۰,۰۰۰   | ۴۴۰,۰۰۰       | مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱     |
| ۸۴۴,۸۶۹,۲۳۹,۶۷۲                              | (۷,۲۰۲,۰۴۰,۱۲۵,۷۶۶) | ۸,۰۴۶,۹۰۹,۳۶۵,۴۳۸ | ۱,۰۹۴,۱۶۰,۸۸۷ | ۸۴۴,۸۶۹,۲۳۹,۶۷۵               | (۷,۲۰۲,۰۴۰,۱۲۵,۷۶۳) | ۸,۰۴۶,۹۰۹,۳۶۵,۴۳۸ | ۱,۰۹۴,۱۶۰,۸۸۷ | جمع                              |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

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

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |                      |                    |             | طی مهر ماه ۱۴۰۴         |                      |                    |             | شرح                           |
|----------------------------------------------|----------------------|--------------------|-------------|-------------------------|----------------------|--------------------|-------------|-------------------------------|
| سود و زیان ناشی از فروش                      | ارزش دفتری           | خالص ارزش فروش     | تعداد       | سود و زیان ناشی از فروش | ارزش دفتری           | خالص ارزش فروش     | تعداد       |                               |
| ریال                                         | ریال                 | ریال               |             | ریال                    | ریال                 | ریال               |             |                               |
| ۶۱۳,۷۲۶,۶۶۲                                  | (۱۰,۰۵۴,۰۸۳,۴۰۰)     | ۱۰,۶۶۷,۸۱۰,۰۶۲     | ۳۴۵,۰۰۰     | ۶۱۳,۷۲۶,۶۶۲             | (۱۰,۰۵۴,۰۸۳,۴۰۰)     | ۱۰,۶۶۷,۸۱۰,۰۶۲     | ۳۴۵,۰۰۰     | شرکت لابراتوارهای سینا دارو   |
| ۱۲,۸۲۰,۲۲۱,۵۱۱                               | (۱۷۴,۸۴۵,۶۴۱,۵۴۶)    | ۱۸۷,۶۶۵,۸۶۳,۰۵۷    | ۷۶,۹۲۳,۰۰۰  | ۱۲,۸۲۰,۲۲۱,۵۱۱          | (۱۷۴,۸۴۵,۶۴۱,۵۴۶)    | ۱۸۷,۶۶۵,۸۶۳,۰۵۷    | ۷۶,۹۲۳,۰۰۰  | سرمایه گذاری خوارزمی          |
| ۴,۸۵۲,۱۵۹,۱۳۳                                | (۱,۷۳۶,۴۵۷,۹۲۹,۸۴۶)  | ۱,۷۴۱,۳۱۰,۰۸۸,۹۷۹  | ۲۵,۹۴۴,۷۷۰  | ۴,۸۵۲,۱۵۹,۱۳۳           | (۱,۷۳۶,۴۵۷,۹۲۹,۸۴۶)  | ۱,۷۴۱,۳۱۰,۰۸۸,۹۷۹  | ۲۵,۹۴۴,۷۷۰  | صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت |
| ۳,۵۱۸,۴۶۴                                    | (۱,۰۸۷,۹۶۹,۱۶۸)      | ۱,۰۹۱,۴۸۷,۶۳۲      | ۵۶,۷۲۰      | ۳,۵۱۸,۴۶۴               | (۱,۰۸۷,۹۶۹,۱۶۸)      | ۱,۰۹۱,۴۸۷,۶۳۲      | ۵۶,۷۲۰      | صندوق تداوم اطمینان تمدن-ثابت |
| ۲۶۷,۱۲۲,۶۰۷                                  | (۳۵۴,۲۰۶,۴۰۱,۱۸۰)    | ۳۵۴,۴۷۳,۵۲۳,۷۸۷    | ۲۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۶۷,۱۲۲,۶۰۷             | (۳۵۴,۲۰۶,۴۰۱,۱۸۰)    | ۳۵۴,۴۷۳,۵۲۳,۷۸۷    | ۲۰,۰۰۰,۰۰۰  | صندوق س توسعه فولاد- ثابت     |
| ۴۱,۱۳۹,۶۰۹,۸۲۹                               | (۷,۸۶۷,۰۹۴,۲۸۱,۱۲۹)  | ۷,۹۰۸,۲۳۳,۸۹۰,۹۵۸  | ۴۲۴,۵۴۴,۳۷۵ | ۴۱,۱۳۹,۶۰۹,۸۲۹          | (۷,۸۶۷,۰۹۴,۲۸۱,۱۲۹)  | ۷,۹۰۸,۲۳۳,۸۹۰,۹۵۸  | ۴۲۴,۵۴۴,۳۷۵ | صندوق س. دارا الگوریتم-د      |
| ۳,۳۹۲,۹۹۱,۰۸۴                                | (۸,۴۴۳,۱۰۹,۷۱۶)      | ۱۱,۸۳۶,۱۰۰,۸۰۰     | ۱,۲۶۴,۱۸۳   | ۳,۳۹۲,۹۹۱,۰۸۴           | (۸,۴۴۳,۱۰۹,۷۱۶)      | ۱۱,۸۳۶,۱۰۰,۸۰۰     | ۱,۲۶۴,۱۸۳   | صندوق س.بخشی فرا الگوریتم-ب   |
| ۸۹۱,۴۴۹,۰۸۸                                  | (۱۰,۹۴۴,۶۵۱,۷۱۲)     | ۱۱,۸۳۶,۱۰۰,۸۰۰     | ۱,۱۹۵,۴۵۳   | ۸۹۱,۴۴۹,۰۸۸             | (۱۰,۹۴۴,۶۵۱,۷۱۲)     | ۱۱,۸۳۶,۱۰۰,۸۰۰     | ۱,۱۹۵,۴۵۳   | صندوق س.مانا الگوریتم-سهام    |
| ۶۳,۹۸۰,۷۹۸,۳۷۸                               | (۱۰,۱۶۳,۱۳۴,۰۶۷,۶۹۷) | ۱۰,۲۲۷,۱۱۴,۸۶۶,۰۷۵ | ۵۵۰,۲۷۳,۵۰۱ | ۶۳,۹۸۰,۷۹۸,۳۷۸          | (۱۰,۱۶۳,۱۳۴,۰۶۷,۶۹۷) | ۱۰,۲۲۷,۱۱۴,۸۶۶,۰۷۵ | ۵۵۰,۲۷۳,۵۰۱ | جمع                           |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |                  |                |                |                    | طی مهر ماه ۱۴۰۴ |                  |                |      |                    |
|----------------------------------------------|------------------|----------------|----------------|--------------------|-----------------|------------------|----------------|------|--------------------|
| جمع                                          |                  |                |                |                    | جمع             |                  |                |      |                    |
| درآمد سود صندوق                              | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | مبلغ           | درصد از کل درآمدها | درآمد سود صندوق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | مبلغ | درصد از کل درآمدها |
| صندوق س. دارا الگوریتم-د                     | ۵۰۱۱,۴۳۹,۲۹۲     | ۴۱,۱۳۹,۶۰۹,۸۲۹ | ۴۶,۱۵۱,۰۴۹,۱۲۱ | ۴۸۷                | ۵۰۱۱,۴۳۹,۲۹۲    | ۴۱,۱۳۹,۶۰۹,۸۲۹   | ۴۶,۱۵۱,۰۴۹,۱۲۱ | ۴۸۷  | ۴۸۷                |
| صندوق تداوم اطمینان تمدن-ثابت                | ۱۳,۹۹۶,۸۵۳,۰۳۰   | ۳,۵۱۸,۴۶۴      | ۱۴,۰۰۰,۳۷۱,۴۹۴ | ۱۴۸                | ۱۳,۹۹۶,۸۵۳,۰۳۰  | ۳,۵۱۸,۴۶۴        | ۱۴,۰۰۰,۳۷۱,۴۹۴ | ۱۴۸  | ۱۴۸                |
| صندوق ارمغان فیروزه آسیا-ثابت                | ۵,۵۵۲,۶۶۹,۲۹۶    | ۴,۸۵۲,۱۵۹,۱۳۳  | ۱۰,۴۰۴,۸۲۸,۴۲۸ | ۱۱۰                | ۵,۵۵۲,۶۶۹,۲۹۶   | ۴,۸۵۲,۱۵۹,۱۳۳    | ۱۰,۴۰۴,۸۲۸,۴۲۸ | ۱۱۰  | ۱۱۰                |
| صندوق س.بخشی فرا الگوریتم-ا.ب                | ۲,۶۲۸,۶۳۰,۴۰۱    | ۳,۳۹۲,۹۹۱,۰۸۴  | ۶,۰۲۱,۶۲۱,۴۸۵  | ۰۶۴                | ۲,۶۲۸,۶۳۰,۴۰۱   | ۳,۳۹۲,۹۹۱,۰۸۴    | ۶,۰۲۱,۶۲۱,۴۸۵  | ۰۶۴  | ۰۶۴                |
| صندوق س.مانا الگوریتم-سپاهم                  | ۱,۴۵۶,۵۳۱,۱۲۸    | ۸۹۱,۴۴۹,۰۸۸    | ۲,۳۴۷,۹۸۰,۲۱۶  | ۰۲۵                | ۱,۴۵۶,۵۳۱,۱۲۸   | ۸۹۱,۴۴۹,۰۸۸      | ۲,۳۴۷,۹۸۰,۲۱۶  | ۰۲۵  | ۰۲۵                |
| جمع                                          | ۲۸,۶۴۶,۱۲۳,۱۴۴   | ۵۰,۵۴۶,۸۵۰,۲۰۵ | ۷۹,۱۹۲,۹۷۳,۳۴۹ | ۸۳۵                | ۲۸,۶۴۶,۱۲۳,۳۵۲  | ۵۰,۵۴۶,۸۵۰,۲۰۵   | ۷۹,۱۹۲,۹۷۳,۳۵۲ | ۸۳۵  | ۸۳۵                |

## صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

### صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۳- درآمد حاصل از سرمایه-گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت:

از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴

طی مهر ماه ۱۴۰۴

| عنوان                            | درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش | جمع            | درآمد سود اوراق | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش | جمع            |
|----------------------------------|-----------------|------------------|------------|----------------|-----------------|------------------|------------|----------------|
| مربحه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱      | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸   | ۰                | ۰          | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸  | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸   | ۰                | ۰          | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸  |
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪ | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲   | ۰                | ۰          | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲  | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲   | ۰                | ۰          | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲  |
| جمع                              | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰  | ۰                | ۰          | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰ | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰  | ۰                | ۰          | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۳-۱ سود اوراق

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |               |                   | طی مهر ماه ۱۴۰۴ |             |                |                |             |                |
|----------------------------------------------|---------------|-------------------|-----------------|-------------|----------------|----------------|-------------|----------------|
| شرح                                          | تاریخ سر رسید | نرخ سود<br>(درصد) | درآمد سود       | هزینه تنزیل | خالص درآمد     | درآمد سود      | هزینه تنزیل | خالص درآمد     |
|                                              |               |                   | ریال            | ریال        | ریال           | ریال           | ریال        | ریال           |
| مراجعه ت.صنعتی مشفق ۱۴۰۵۰۹۲۱                 | ۱۴۰۵/۰۹/۲۱    | ۱۸                | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸   | ۰           | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸  | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸  | ۰           | ۶,۳۵۸,۷۲۱,۴۶۸  |
| صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪             | ۱۴۰۴/۱۱/۱۸    | ۲۰                | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲   | ۰           | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲  | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲  | ۰           | ۸,۰۵۱,۳۹۷,۹۵۲  |
|                                              |               |                   | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰  | -           | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰ | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰ | -           | ۱۴,۴۱۰,۱۱۹,۴۲۰ |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۴-درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده:

| نام سپرده بانکی           | طی مهر ماه ۱۴۰۴               | از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |
|---------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------|
| نام سپرده                 | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده | سود سپرده بانکی و گواهی سپرده                |
| سپرده های نزد بانک صادرات | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                    | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                                   |
| جمع                       | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                    | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                                   |

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۱-۴-۲ سود سپرده بانکی

| از ابتدای سال مالی تا پایان مهر ماه سال ۱۴۰۴ |             |            | طی مهر ماه ۱۴۰۴ |             |            | شرح                       |
|----------------------------------------------|-------------|------------|-----------------|-------------|------------|---------------------------|
| خالص درآمد                                   | هزینه تنزیل | درآمد سود  | خالص درآمد      | هزینه تنزیل | درآمد سود  |                           |
| ریال                                         | ریال        | ریال       | ریال            | ریال        | ریال       | سپرده های نزد بانک صادرات |
| ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                                   | ۰           | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲ | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲      | ۰           | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲ |                           |
| ۱۳,۸۷۳,۹۹۲                                   | -           | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲ | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲      | -           | ۱۳,۸۷۳,۹۹۲ |                           |

صندوق سرمایه‌گذاری بازارگردانی کوشا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای دوره یک ماهه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۴۰۴

۲-۵-سایر درآمدها:

| از ابتدای سال مالی تا پایان<br>مهر ماه سال ۱۴۰۴ | طی مهر ماه ۱۴۰۴ |                    |
|-------------------------------------------------|-----------------|--------------------|
| مبلغ                                            | مبلغ            | سایر درآمدها       |
| ریال                                            | ریال            |                    |
| ۲۱,۲۲۵,۷۲۷,۶۹۸                                  | ۲۱,۲۲۵,۷۲۷,۶۹۸  | کارمزد بازارگردانی |
| ۳,۶۷۷,۳۰۱,۶۰۴                                   | ۳,۶۷۷,۳۰۱,۶۰۴   | سایر درآمدها       |
| ۲۴,۹۰۳,۰۲۹,۳۰۲                                  | ۲۴,۹۰۳,۰۲۹,۳۰۲  | جمع                |