



صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۱- سرمایه گذاری ها
۱-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره						۱۳۹۸/۰۷/۳۰				
درصد به کل دارایی ها	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				
۰	۰	۰	۰	۰	۷,۶۴۸,۴۱۳,۹۳۹	۲,۵۰۰,۰۰۰	۷,۵۳۷,۳۱۱,۳۹۵	۲,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	پتروشیمی تامین
۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۷,۶۴۸,۴۱۳,۹۳۹	۲,۵۰۰,۰۰۰	۷,۵۳۷,۳۱۱,۳۹۵	۲,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۱-۲- سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۷/۳۰		اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت										
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ سود مؤثر	نرخ سود اسمی	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار اوراق	بذیرفته شده در بورس یا فرابورس	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده										
۴۵.۰۹٪	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۰۹,۷۶۴	۴۰۰,۰۰۰	۰	۰	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۱۷.۹	۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۱۳۹۸/۰۸/۱۸	فرابورس	بلی	متنعت دولت ۵-ش-خاص سایر ۰۱۰۸
۰.۰۰٪	۰	۰	۰	۰	۹,۵۱۳,۶۸۱	۱۰	۹,۵۲۶,۹۰۱	۱۰	۰	۰	۰	۰	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۷/۱۲/۲۲	فرابورس	بلی	متنعت صبا آروند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۴۵.۰۹٪	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۰۹,۷۶۴	۴۰۰,۰۰۰	۹,۵۱۳,۶۸۱	۱۰	۴۰۰,۰۰۰,۹۵۲۶,۹۰۱	۴۰۰,۰۱۰	۰	۰	۰	۰	۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

اوراق بهاداری که ارزش آنها در تاریخ گزارش تعدیل شده

(بر اساس دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه گذاری)

۱۳۹۸/۰۸/۳۰

دلیل تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	درصد تعدیل	قیمت تعدیل شده	قیمت پایانی	تعداد	نام اوراق بهادار
تنزیل تا سررسید	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	-۹.۰۲٪	۹۰۹,۷۶۴	۱,۰۰۰,۰۰۰	۴۰۰,۰۰۰	منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۰۱۰۸
	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰					جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگور بتم

صورت وضعیت بورتقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۷/۳۰		مشخصات حساب بانکی			
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود علی الحساب(درصد)	تاریخ افتتاح حساب	نوع سپرده	شماره حساب	سپرده های بانکی
۰.۰۰٪	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۰۵,۸۹۲,۰۸۸,۰۵۰	۴۰۵,۸۹۲,۰۸۸,۰۵۰	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۱۵	جاری	۰۱۰۰۳۲۶۶۴۷۰۰۲	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۰.۱۰٪	۸۱۹,۹۰۸,۹۹۲	۴۰۵,۹۰۱,۸۵۶,۵۹۳	۴۰۵,۸۹۶,۶۸۴,۴۴۸	۸۲۵,۰۸۱,۱۳۷	۲۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۵۰.۸۸٪	۴۱۰,۲۵۶,۶۶۵,۶۳۰	۴۲۸,۴۲۷,۲۸۲,۸۱۸	۶۷۸,۶۳۷,۷۷۳,۰۸۶	۱۶۰,۰۴۶,۱۷۵,۳۶۲	۲۰	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۰.۰۵٪	۴۱۱,۴۳۸,۹۰۳	.	۴۱۰,۹۵۸,۹۰۳	۴۸۰,۰۰۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۰۷/۰۷	کوتاه مدت	۱۱۳,۹۹۶۷,۶۶۹۱۴۷.۱	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۳.۱۰٪	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۰۷/۲۸	بلند مدت	۱۱۳,۹۹۶۷,۶۶۹۱۴۷.۱	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۵۴.۱۳٪	۴۳۶,۵۱۸,۰۱۳,۵۲۵	۱,۲۴۰,۲۲۱,۲۲۷,۴۶۱	۱,۴۹۰,۸۳۷,۵۰۴,۴۸۷	۱۸۵,۹۰۱,۷۳۶,۴۹۹					جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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 و حق تقدم سهام	۱-۲	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱.۱۹٪	۰.۰۲٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲-۲	۲,۹۹۸,۰۲۹,۹۲۰	۱۹.۲۱٪	۰.۳۷٪
درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده	۳-۲	۱۲,۴۱۸,۱۵۶,۲۹۰	۷۹.۵۷٪	۱.۵۴٪
سایر درآمدها	۴-۲	۳,۸۵۳,۷۶۷	۰.۰۲٪	۰.۰۰٪
جمع		۱۵,۶۰۶,۴۴۸,۵۸۲	۱۰۰٪	۱.۹۴٪

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورنیتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت و سپرده بانکی

۱۳۹۸/۰۸/۳۰			طی دوره			نرخ سود علی الحساب(درصد)	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	شرح
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود				
۴۳۸,۳۵۶,۱۶۳	.	۴۳۸,۳۵۶,۱۶۳	۴۰۹,۰۲۹,۸۳۶	(۱,۹۲۹,۰۶۷)	۴۱۰,۹۵۸,۹۰۳	۲۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۸	۱۳۹۸/۰۸/۲۸	بلند مدت-۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۱-گردشگری
.	.	.	(۶,۲۵۲)	(۱۰۳)	(۶,۱۴۹)	۱۰	-	-	کوتاه مدت-۱۱۳,۹۹۶۷,۶۶۹۱۴۷,۱-گردشگری
۸۶۱,۹۰۰,۶۱۵	.	۸۶۱,۹۰۰,۶۱۵	۶,۶۸۴,۴۴۸	.	۶,۶۸۴,۴۴۸	۲۰	-	۱۳۹۸/۰۸/۱۴	کوتاه مدت-۲۰۲۳۵۰۹۱۵۰۰۵-آینده
۱۱,۱۱۷,۸۹۹,۵۱۲	.	۱۱,۱۱۷,۸۹۹,۵۱۲	۶,۵۵۶,۱۵۷,۸۶۵	(۴۳,۲۳۹,۴۸۷)	۶,۵۹۹,۳۹۷,۳۵۲	۲۰	-	۱۳۹۸/۰۸/۱۳	کوتاه مدت-۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹-آینده
۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	.	۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	.	۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	۱۷.۹	۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۱۳۹۹/۰۲/۱۸	منفعت دولت ۵-شخص خاص سایر ۰۱۰۸
۲۹,۸۹۷	.	۲۹,۸۹۷	۲۹,۸۹۷	.	۲۹,۸۹۷	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۸/۱۲/۲۲	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۵۱,۷۷۴,۴۲۵,۰۹۱	.	۵۱,۷۷۴,۴۲۵,۰۹۱	۴۶,۳۲۸,۱۳۴,۶۹۸	(۴۵,۱۶۸,۶۵۷)	۴۶,۳۷۳,۳۰۳,۳۵۵				جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوربتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۳۹۸/۰۸/۳۰				طی دوره				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	
(۷,۳۲۱)	۹,۵۲۰,۰۰۲	۹,۵۱۲,۶۸۱	۱۰	(۷,۳۲۱)	۹,۵۲۰,۰۰۲	۹,۵۱۲,۶۸۱	۱۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۷,۴۶۲,۰۰۵,۳۳۴	۷,۶۴۸,۴۱۳,۹۳۹	۲,۵۰۰,۰۰۰	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۷,۴۶۲,۰۰۵,۳۳۴	۷,۶۴۸,۴۱۳,۹۳۹	۲,۵۰۰,۰۰۰	پتروشیمی تامین
۱۸۶,۴۰۱,۲۸۴	۷,۴۷۱,۵۲۵,۳۳۶	۷,۶۵۷,۹۲۶,۶۲۰	۲,۵۰۰,۰۱۰	۱۸۶,۴۰۱,۲۸۴	۷,۴۷۱,۵۲۵,۳۳۶	۷,۶۵۷,۹۲۶,۶۲۰	۲,۵۰۰,۰۱۰	جمع

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورنتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۳۹۸/۰۸/۳۰				طی دوره				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	
(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰	منفعت دولت ۵-شخص سایر ۰۱۰۸
(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۳,۶۴۱,۷۶۸,۴۴۰	۴۰۰,۰۰۰	جمع

ارزش دفتری برابر است با میانگین موزون خالص ارزش فروش هر سهم/ورقه در ابتدای دوره با خرید طی دوره ضربدر تعداد در پایان دوره

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰					طی دوره					
درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمد ها	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	سهام
۱.۱۹٪	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۰	۰	۱.۱۹٪	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۰	۰	س. نفت و گاز و پتروشیمی تامین
۱.۱۹٪	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۰	۰	۱.۱۹٪	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۰	۰	جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیو

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰				طی دوره				سهام
جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
۲,۹۹۸,۰۰۷,۳۴۴	-	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	۲,۹۹۸,۰۰۷,۳۴۴	-	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۳۹,۳۵۶,۲۳۸,۹۰۴	منفعت دولت ۵-ش-خاص سایر ۰۱۰۸
۲۲,۵۷۶	(۷,۳۲۱)	.	۲۹,۸۹۷	۲۲,۵۷۶	(۷,۳۲۱)	.	۲۹,۸۹۷	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۲,۹۹۸,۰۲۹,۹۲۰	(۷,۳۲۱)	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۳۹,۳۵۶,۲۶۸,۸۰۱	۲,۹۹۸,۰۲۹,۹۲۰	(۷,۳۲۱)	(۳۶,۳۵۸,۲۳۱,۵۶۰)	۳۹,۳۵۶,۲۶۸,۸۰۱	جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

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

۱۳۹۸/۰۸/۳۰		طی دوره		نام سپرده بانکی	
درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	شماره حساب	نام سپرده
۳.۵۳٪	۴۳۸,۳۵۶,۱۶۳	۵.۸۶٪	۴۱۰,۹۵۸,۹۰۳	۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۱	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۶.۹۴٪	۸۶۱,۹۰۰,۶۱۵	۰.۱۰٪	۶,۶۸۴,۴۴۸	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
۸۹.۵۳٪	۱۱,۱۱۷,۸۹۹,۵۱۲	۹۴.۰۵٪	۶,۵۹۹,۳۹۷,۳۵۲	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
۰.۰۰٪	۰	۰.۰۰٪	(۶,۱۴۹)	۱۱۳.۹۹۶۷.۶۶۹۱۴۷.۱	سپرده بانکی کوتاه مدت - گردشگری
۱۰۰.۰۰٪	۱۲,۴۱۸,۱۵۶,۲۹۰	۱۰۰.۰۰٪	۷,۰۱۷,۰۳۴,۵۵۴		جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

۱۳۹۸/۰۸/۳۰	طی دوره	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	تعدیل کارمزد کارگزاری
۳,۸۵۳,۷۶۷	۳,۸۵۳,۷۶۷	
۳,۸۵۳,۷۶۷	۳,۸۵۳,۷۶۷	جمع