



صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم

صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

درصد به کل دارایی ها	تغییرات طی دوره					۱۳۹۸/۱۲/۲۹					شرکت	
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	مبلغ فروش	تعداد خرید طی دوره	بهای تمام شده	تعداد خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده		تعداد
۱/۱۳٪	۱۸,۰۰۸,۲۴۸,۸۴۰	۱۳,۲۸۲,۱۸۹,۹۰۸	۱۰,۷۳۲	۱,۷۵۳,۰۰۰	-	-	۴,۲۹۴,۵۸۱,۳۲۴	۴۳۰,۰۰۰	۱۰,۶۶۹,۳۵۰,۵۷۵	۸,۹۸۷,۶۰۸,۵۸۴	۱,۳۲۲,۰۰۰	بانک ملت
-۱/۰۰٪	۷۶,۰۸۰,۲۲۴	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۷,۳۰۱	۱۰,۵۳۹	-	-	-	-	۴۸,۵۷۰,۲۸۳	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۱۰,۵۳۹	تامین سرمایه بانک ملت
-۱/۸۰٪	۱۳,۹۶۸,۶۱۶,۰۲۶	۸,۳۳۶,۸۹۶,۱۴۸	۱۲,۷۶۳	۱,۰۶۵,۰۰۰	-	-	۱,۱۴۶,۷۳۳,۴۵۸	۱۰۰,۰۰۰	۷,۸۷۰,۳۴۹,۵۳۵	۷,۱۹۰,۱۶۲,۶۹۰	۹۶۵,۰۰۰	توسعه صنایع بهشهر
-۱/۹۳٪	۱۵۰,۲۵,۹۷۹,۳۳۱	۷,۱۴۴,۵۱۲,۶۹۶	۶۰,۲۰۷	۲۵۶,۱۰۰	-	-	۱,۰۳۲,۷۰۱,۸۶۶	۲۰,۰۰۰	۱۰,۳۶۶,۳۷۰,۶۳۰	۶,۱۱۱,۸۱۰,۸۳۰	۲۳۶,۱۰۰	دارویی تامین
-۱/۰۰٪	-	-	-	-	۱,۸۲۵,۷۵۶	۵۰	-	-	۱,۷۹۱,۷۵۸	۷۰۱,۸۴۸	۵۰	ذوب روی اصفهان
-۱/۲۳٪	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۳۷	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۹,۰۲۷	۳۷۹,۴۶۲	-	-	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۳۷۹,۴۶۲	-	-	-	سرمایه گذاری تامین اجتماعی
-۱/۰۰٪	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۱۶,۰۳۳	۸۱۱	-	-	۹,۷۵۷,۶۹۰	۸۱۱	-	-	-	سرمایه گذاری صبا تامین
۱/۱۷٪	۱۸,۸۴۸,۵۳۰,۳۹۷	۱۰,۶۷۲,۵۷۵,۶۷۹	۷,۲۱۰	۲,۷۱۹,۱۵۹	۳,۴۷۴,۷۶۳,۳۱۱	۷۱۵,۰۰۰	-	-	۱۵,۲۶۹,۰۲۵۰,۱۳	۱۳,۴۷۸,۹۱۸,۳۲۲	۳,۴۳۴,۱۵۹	سرمایه گذاری غدیر
-۱/۰۱٪	۱۳۶,۲۰۶,۴۲۷	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۲۵,۱۰۵	۵۵۰	-	-	-	-	۸۸,۹۳۳,۸۵۷	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۵۵۰	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر
-۱/۰۰٪	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۳۱,۳۹۰,۴۶۷	۱,۳۳۸	۱,۳۳۸	-	-	-	-	۳۴,۵۲۳,۵۵۵	۳۱,۳۹۰,۴۶۷	۱,۳۳۸	سیمان سناوه
۱/۴۵٪	۲۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۶,۲۱۴,۳۰۵	۳,۸۲۴	-	-	-	-	۱۷,۱۶۶,۲۵۳,۳۹۲	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۳,۸۲۴	صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر
-۱/۰۰٪	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۲۵,۰۳۱	۱,۳۱۳	-	-	-	-	۲۸,۷۶۶,۸۸۶	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۱,۳۱۳	صنعتی دوده فام
-۱/۹۱٪	۱۴,۶۳۹,۹۹۸,۱۱۶	۸,۸۴۹,۳۴۱,۳۵۸	۱۲۶,۸۳۴	۱۱۸,۸۳۵	-	-	۱,۳۰۳,۱۲۶,۵۹۶	۱۱,۷۰۰	۱۰,۰۷۷,۵۲۰,۳۰۲	۷,۵۴۶,۳۱۴,۷۶۲	۱۰۷,۱۳۵	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
-۱/۹۳٪	۱۴,۸۹۷,۰۰۴,۱۱۹	۹,۹۵۸,۰۶۹,۳۵۹	۶,۱۹۷	۲,۴۸۰,۰۰۰	۴,۰۷۶,۶۰۷,۹۳۶	۹۰۰,۰۰۰	-	-	۱۵,۵۲۶,۹۴۱,۷۵۴	۱۳,۵۷۱,۸۸۴,۸۵۳	۳,۳۸۰,۰۰۰	فولاد مبارکه
-۱/۷۰٪	۱۱,۲۷۹,۶۲۰,۸۷۰	۸,۶۷۷,۱۵۲,۸۵۷	۲۴,۵۵۷	۴۷۸,۶۰۰	-	-	-	-	۴,۹۴۵,۶۴۲,۹۸۹	۵,۷۳۱,۵۰۹,۸۶۸	۳۱۶,۶۰۰	کشتیرانی ایران
-۱/۰۰٪	۳,۹۱۰,۸۶۸	۱,۱۲۳,۹۵۷	۷۹,۵۵۹	۳۸	-	-	-	-	۳,۹۴۹,۷۴۹	۱,۱۲۳,۹۵۷	۳۸	کلر پارس
-۱/۰۳٪	۴۵,۷۵۶,۰۵۵	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۸,۹۷۳	۵۶,۲۴۸	-	-	-	-	۳۰۶,۹۰۴,۶۹۷	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۵۶,۲۴۸	پتروشیمی تندگویان
-۱/۹۳٪	۱۴,۸۰۱,۶۰۰,۳۰۹	۸,۴۸۹,۸۲۸,۰۰۳	۱۱,۳۲۰	۱,۳۲۵,۲۳۶	۲,۹۲۰,۴۸۴,۸۷۲	۳۵۵,۰۰۰	-	-	۱۳,۷۴۳,۴۲۱,۵۵۴	۱۰,۷۶۴,۰۵۶,۰۹۷	۱,۶۸۰,۲۳۶	پتروشیمی خلیج فارس
-۱/۳۵٪	۴,۰۲۴,۲۶۳,۱۱۱	۳,۹۳۱,۸۱۲,۷۲۴	۵۹,۲۳۴	۷۰,۰۶۷	-	-	-	-	۳,۹۳۰,۶۷۰,۶۰۷	۱,۱۴۲,۱۱۷	۶۷	پدیده شیمی قرن
-۱/۸۱٪	۱۳,۰۶۵,۷۱۰,۰۳۸	۱۰,۰۵۱,۱۴۹,۸۸۷	۹,۶۲۷	۱,۴۰۵,۰۰۰	-	-	-	-	۲,۴۸۱,۶۴۴,۲۹۷	۷,۵۱۵,۱۹۵,۳۶۶	۱,۰۶۵,۰۰۰	چادرملو
-۱/۰۰٪	۲۰۷	۲۰۷	۱۲,۴۸۶	-	۳,۷۸۹,۱۷۴	۳۶۹	-	-	۳,۷۸۴,۶۷۸	۲,۰۰۸,۱۳۰,۹	۳۶۹	گروه توسعه مالی مهر آیندگان
۱۰/۳۵٪	۱۶۵,۲۴۲,۴۷۲,۳۰۸	۱۰۴,۲۰۸,۰۴۵,۳۸۹	-	۱۲,۱۲۹,۰۶۰	۱۰,۴۷۷,۴۷۱,۰۴۹	۱,۹۷۰,۴۱۹	۲۰,۴۱۷,۳۳۰,۹۲	۱,۵۱۳,۹۷۳	۱۱۳,۶۳۸,۵۸۲,۷۶۷	۹۲,۴۸۷,۹۸۱,۳۸۸	۱۳,۵۸۵,۵۰۶	جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم

صورت وضعیت بورتقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

نام اوراق	دارای معجز از سازمان	بشرفته شده در بورس یا فرابورس	تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	نرخ سود اسمی	نرخ سود مؤثر	اطلاعات اوراق بهادار یا درآمد ثابت		۱۳۹۸/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۱/۳۱				
							مقدار	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	مقدار	بهای تمام شده	فروش طی دوره	خرید طی دوره	مقدار	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	بهای تمام شده
استادخرانه م ۱۰ بوجه ۹۸-۰۰۱۰۶	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۱/۰۶	-	-	۲۵,۷۲۲	-	۲۵,۷۲۲	-	-	۲۵,۷۲۲	۶۹۷,۵۰۰	۱۹,۲۲۸,۳۹۰,۵۶۳	۱۷,۳۲۵,۰۵۷,۶۴۹	۱/۱۱٪	
استادخرانه م ۱۳ بوجه ۹۷-۰۰۵۱۸	بله	فرابورس	۱۳۹۷/۰۷/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	-	-	-	۸,۴۱۳,۶۵۰,۵۷۸	۸,۷۸۸,۱۳۹,۶۶۳	۱۱,۹۵۰	-	-	۷۲۳,۳۰۵	۸,۷۸۸,۱۳۹,۶۶۳	۸,۶۲۵,۲۸۶,۸۸۰	۰/۵۳٪	
استادخرانه م ۱۴ بوجه ۹۸-۰۱۰۳۱۸	بله	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۳۱/۸	-	-	۱۱,۰۰۰	-	-	-	-	-	۷,۶۵۸,۱۵۳,۳۳۰	۷,۶۵۸,۱۵۳,۳۳۰	۶,۸۳۴,۸۶۸,۵۷۲	۰/۴۳٪	
استادخرانه م ۱۶ بوجه ۹۷-۰۰۴۰۷	بله	فرابورس	۱۳۹۷/۰۹/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	-	-	-	۹,۸۶۱,۳۳۳,۳۰۹	۱۰,۰۰۷,۳۳۶,۰۸۰	۱۳,۳۹۸	-	-	۱۳,۳۹۸	۱۰,۰۰۷,۳۳۶,۰۸۰	۹,۹۸۹,۰۰۰,۵۲۰	۰/۶۳٪	
استادخرانه م ۱۸ بوجه ۹۸-۰۱۰۶۱۴	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۸/۱۴	۱۴۰۰/۰۶/۱۴	-	-	۵۵,۴۹۸	-	-	-	-	-	۶۰۵,۷۰۰	۳۷,۳۵۳,۳۹۰,۳۱۵	۳۳,۵۹۰,۷۶۷,۶۲۵	۲/۰۸٪	
استادخرانه م ۲۱ بوجه ۹۷-۰۰۰۷۲۸	بله	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۷/۲۸	-	-	۸,۵۲۵	۳۰,۲۱۰,۰۶۴,۸۵۲	۲۹,۵۱۴,۴۹۶,۸۷۱	۴۰,۰۹۶	-	-	۹۸,۶۲۱	۳۶,۰۹۵,۶۱۰,۳۰۸	۳۶,۰۲۸,۳۷۷,۸۶۶	۲/۱۲٪	
استادخرانه م ۲۲ بوجه ۹۷-۰۰۰۴۲۸	بله	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	-	-	۵۰,۰۵۹	۳۱,۵۸۵,۳۳۳,۳۱۹	۳۳,۲۱۷,۳۱۹,۰۳۵	۲۳,۴۰۶	-	-	۹۸,۶۲۵	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۲۷۰	۳۵,۲۱۰,۴۱۴,۰۰۸	۲/۲۰٪	
استادخرانه م ۳۳ بوجه ۹۷-۰۰۰۸۲۴	بله	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۸/۲۴	-	-	۱۸,۵۶۰	۷,۶۴۵,۳۳۰,۱۲۱	۷,۵۲۶,۹۹۱,۸۳۵	۱۰,۳۵۳	-	-	۲۸,۹۱۳	۲۱,۷۲۱,۳۰۹,۴۹۴	۱۹,۹۲۸,۳۶۹,۳۲۸	۱/۲۴٪	
استادخرانه م ۳۸ بوجه ۹۸-۰۰۰۷۱۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	-	-	۵۰,۷۶۲	۵۷,۴۵۲,۰۱۲,۱۱۰	۶۱,۵۹۳,۹۵۶,۰۶۶	۸۳,۵۰۱	-	-	۱۳۲,۶۲۳	۳۹,۷۵۵,۷۲۳,۵۶۳	۴۴,۹۲۵,۷۹۱,۰۳۳	۵/۸۵٪	
سکه تمام بهار تحولی (روزه ساترات	خیر	بیوس	۰۰۰/۰۰/۰۰	۱۳۹۹/۱۲/۳۰	-	-	-	۱۱,۹۶۸,۵۱۰,۶۲۷	۱۰,۰۰۱,۶۵۷,۹۷۵	۱,۹۰۰	-	-	۱,۹۰۰	-	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	۰/۷۴٪
مراجعه گندم ۲- واجد شرایط خاص ۱۴۰۰	بله	فرابورس	۱۳۹۹/۰۸/۲۰	۱۴۰۰/۰۸/۲۰	۱۷	-	۲۵,۰۰۰	-	-	-	-	-	۲۵,۰۰۰	۲۴,۲۶۰,۳۰۶,۳۵۰	۲۰,۰۰۰,۹۸۲,۱۳۷۵	۱/۳۰٪	
مشارکت دولت-بهارشایب خاص ۱۴۰۰	خیر	فرابورس	۱۳۹۹/۱۰/۲۶	۱۴۰۰/۱۰/۲۶	۱۷	-	-	۳۳,۹۶۶,۳۲۶,۴۶۷	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰	۴۰,۰۰۰	-	-	۴۰,۰۰۰	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰	۳۳,۰۹۶,۱۴۷,۸۸۴	۲/۰۵٪	
مشارکت گزینسنگ ایران وشرق ۱۴۰۰	بله	فرابورس	۱۳۹۹/۱۰/۲۵	۱۴۰۰/۱۰/۲۵	۱۸	-	۲۱,۳۲۳	-	-	-	-	-	۲۱,۳۲۳	۲۰,۰۰۵,۴۲۰,۵۲۳	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۲۸۷	۱/۱۶٪	
منفعت دولت-ش-ش-خالص سایر۰۱۰۸	بله	فرابورس	۱۳۹۸/۰۸/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۸/۱۸	۱۷,۹	-	-	۳۶۷,۱۹۶,۷۸۹,۱۸۰	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۰۰,۰۰۰	-	-	۴۰۰,۰۰۰	۳۶۸,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۸,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۲/۸۳٪	
جمع							۲۲۱,۶۵۹	۵۵۸,۲۹۹,۶۰۰,۳۷۳	۵۹۸,۳۸۶,۵۶۶,۹۸۵	۶۴۴,۶۰۴	-	-	۸۶۶,۰۶۲	۱۷۳,۵۲۱,۱۹۶,۷۷۵	۷۱۳,۴۴۴,۷۷۱,۵۵۷	۴۴/۲۷٪	

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت یور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۲/۲۹		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	.	.	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۰۷/۱۵	جاری	۰۱۰۰۳۲۴۶۴۷۰۰۲	سپرده بانکی نزد بانک آینده
-۰/۰۰٪	۱,۰۰۰,۰۰۰	۳,۵۲۴,۶۸۴,۰۵۸	۳,۵۲۴,۶۸۰,۱۰۷	۱,۰۷۵,۹۵۱	۲۰	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۱۷/۰۹٪	۲۷۵,۷۱۰,۷۷۳,۱۶۷	۱۴۷,۴۴۸,۲۷۹,۴۵۴	۲۱۸,۲۹۹,۳۸۹,۸۸۹	۲۰۴,۸۵۹,۶۶۲,۷۳۲	۲۰	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی نزد بانک آینده
-۰/۰۰٪	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۳۹۸/۱۰/۰۴	جاری	۲۰۱-۳۷۸۹۰۸-۶۰۱	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
-۰/۰۰٪	۴۰۰,۰۰۰	۲,۶۱۳,۹۷۲,۶۰۳	۲,۶۱۳,۹۷۲,۶۰۳	۴۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۱	کوتاه مدت	۴۷۰-۹۸۸۴۰۶-۶۰۹	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۳/۱۰٪	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۱	بلند مدت	۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۷/۱۰٪	۱۱۴,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۱۱۴,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۱۰/۰۳	بلند مدت	۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۵/۱۳٪	۸۲,۵۹۴,۹۳۸,۵۵۰	.	۱,۲۷۹,۸۷۰,۰۵۸	۸۱,۳۱۵,۰۶۸,۴۹۲	.	۱۳۹۸/۱۱/۱۶	کوتاه مدت	۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶	سپرده بانکی نزد بانک صادرات
-۰/۳۴٪	۳,۸۷۴,۵۹۶,۵۷۱	.	۲,۶۶۸,۷۶۷,۱۲۱	۱,۲۰۵,۸۲۹,۴۵۰	.	۱۳۹۸/۰۷/۰۷	کوتاه مدت	۱.۶۶۹۱۴۷.۹۹۶۷.۱۱۳	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۱/۵۵٪	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۳۹۸/۰۷/۲۸	بلند مدت	۱.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۳/۱۰٪	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۰۹/۳۰	بلند مدت	۲.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۵/۵۵٪	۸۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۸۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۳۹۸/۱۰/۰۳	بلند مدت	۳.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۴۲/۸۶٪	۶۹۱,۲۳۱,۷۰۸,۲۸۸	۱۵۳,۵۸۶,۹۳۶,۱۱۵	۲۲۸,۳۸۶,۶۰۷,۷۷۸	۶۱۶,۴۲۲,۰۳۶,۶۲۵					جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱

تعداد	آخرین معامله	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل	نام اوراق بهادار
۵۵,۴۹۸	۶۷۳,۰۰۰	۶۰۵,۷۰۰	-۱۰/۰۰٪	۳۳,۵۹۰,۷۶۷,۶۲۵	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۰۱۰۶۱۴
۱۱,۰۰۰	۷۰۱,۰۰۰	۶۳۰,۹۰۰	-۱۰/۰۰٪	۶,۹۳۴,۸۶۸,۵۷۳	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۱۴ بودجه ۹۸-۰۱۰۳۱۸
۲۸,۹۱۳	۷۶۶,۳۹۲	۶۸۹,۷۵۳	-۱۰/۰۰٪	۱۹,۹۲۸,۳۶۹,۹۳۸	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۲۳ بودجه ۹۷-۰۰۰۸۲۴
۲۵,۷۳۲	۷۷۵,۰۰۰	۶۹۷,۵۰۰	-۱۰/۰۰٪	۱۷,۹۳۵,۰۵۷,۶۴۹	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۰۰۱۰۰۶
۱۳۴,۲۶۳	۷۸۲,۰۰۰	۷۰۳,۸۰۰	-۱۰/۰۰٪	۹۴,۴۲۵,۷۹۱,۰۳۳	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۹۸-۰۰۰۷۱۹
۴۸,۶۲۱	۷۸۳,۰۰۰	۷۰۴,۷۰۰	-۱۰/۰۰٪	۳۴,۲۳۸,۳۷۷,۸۶۶	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۲۱ بودجه ۹۷-۰۰۰۷۲۸
۱۱,۹۵۰	۸۰۲,۵۶۱	۷۲۲,۳۰۵	-۱۰/۰۰٪	۸,۶۲۵,۲۸۶,۸۸۰	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۱۳ بودجه ۹۷-۰۰۰۵۱۸
۴۸,۴۶۵	۸۱۲,۴۱۰	۷۳۱,۱۶۹	-۱۰/۰۰٪	۳۵,۴۱۰,۴۱۴,۴۰۸	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۲۲ بودجه ۹۷-۰۰۰۴۲۸
۱۳,۳۹۸	۸۲۹,۰۰۰	۷۴۶,۱۰۰	-۱۰/۰۰٪	۹,۹۸۹,۰۰۰,۵۲۰	تنزیل تا سررسید	اسناد خزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۰۰۰۴۰۷
۴۰,۰۰۰	۹۲۰,۰۰۴	۸۲۸,۰۰۴	-۱۰/۰۰٪	۳۳,۰۹۶,۱۴۷,۸۸۴	تنزیل تا سررسید	مشارکت دولت-باشرايط خاص ۱۴۰۰۱۰
۲۵,۰۰۰	۹۳۰,۰۰۰	۸۳۷,۰۰۰	-۱۰/۰۰٪	۲۰,۹۰۹,۸۲۹,۳۷۵	تنزیل تا سررسید	مراجعه گندم-۲ واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
۲۱,۳۲۳	۹۷۴,۰۰۰	۸۷۶,۶۰۰	-۱۰/۰۰٪	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۲۸۷	تنزیل تا سررسید	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
۴۰۰,۰۰۰	۹۲۳,۶۵۰	۹۲۱,۱۸۷	-۰/۲۷٪	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	تنزیل تا سررسید	منفعت دولت-ش-خاص سایر ۰۱۰۸
جمع						۷۰۱,۹۶۹,۷۵۷,۸۰۸

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

درصد از کل دارایی ها	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت	شرح
۴/۳۱٪	۴۸/۵۴٪	۶۹,۵۶۵,۶۳۳,۴۳۵	۱-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۰/۸۱٪	۹/۱۱٪	۱۳,۰۶۲,۵۴۰,۹۷۹	۲-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۳/۷۶٪	۴۲/۲۷٪	۶۰,۵۸۰,۷۲۰,۲۶۹	۳-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰/۰۱٪	۰/۰۷٪	۹۹,۸۵۹,۲۱۴	۴-۲	سایر درآمدها
۸/۸۹٪	۱۰۰٪	۱۴۳,۳۰۸,۷۵۳,۸۹۷		جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

سود اوراق بهادار یا در آمد ثابت و سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۱/۳۱			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				
۲,۴۹۲,۵۲۰,۱۶۶	(۶۳۰,۵۱۲)	۲,۴۹۳,۱۵۰,۶۷۸	۴۲۲,۶۶۰,۹۱۱	(۱,۹۹۶,۶۲۲)	۴۲۴,۶۵۷,۵۳۳	۲۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۸	۱۳۹۹/۰۱/۲۸	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۱-گردشگری
۳,۲۸۷,۶۷۱,۲۳۱	.	۳,۲۸۷,۶۷۱,۲۳۱	۸۴۵,۹۳۷,۳۲۴	(۳,۳۷۷,۷۴۴)	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۲۰	۱۳۹۹/۰۹/۳۰	۱۳۹۹/۰۱/۳۰	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۲-گردشگری
۵,۷۳۵,۵۵۰,۹۵۸	(۲,۲۵۷,۲۳۴)	۵,۷۳۷,۸۰۸,۱۹۲	۱,۵۱۳,۸۲۴,۷۳۰	(۶,۴۴۹,۲۴۰)	۱,۵۲۰,۲۷۳,۹۷۰	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۳	۱۳۹۹/۰۱/۰۳	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۳-گردشگری
۷,۳۳۷,۶۶۰,۱۹۹	(۲,۸۸۷,۷۴۶)	۷,۳۴۰,۵۴۷,۹۴۵	۱,۹۳۶,۶۸۰,۸۰۳	(۸,۲۵۰,۷۰۴)	۱,۹۴۴,۹۳۱,۵۰۷	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۳	۱۳۹۹/۰۱/۰۳	بلند مدت-۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱-پارسیان
۳,۲۸۷,۲۰۵,۸۴۶	(۴۶۵,۳۷۸)	۳,۲۸۷,۶۷۱,۲۲۴	۸۴۵,۴۷۱,۹۴۶	(۳,۸۴۳,۱۲۲)	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۱	۱۳۹۹/۰۱/۰۱	بلند مدت-۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶-پارسیان
۲,۵۹۴,۹۳۸,۵۵۰	.	۲,۵۹۴,۹۳۸,۵۵۰	۱,۲۷۹,۸۷۰,۰۵۸	.	۱,۲۷۹,۸۷۰,۰۵۸	۲۰ ماه شمار	-	۱۳۹۹/۰۱/۱۶	کوتاه مدت-۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶-صادرات
۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	.	۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	.	۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	۱۷	۱۴۰۰/۰۸/۲۰	۱۳۹۹/۰۲/۲۰	مراجعه گندم ۲-واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
۲,۱۱۹,۵۴۳,۰۴۴	.	۲,۱۱۹,۵۴۳,۰۴۴	۵۷۰,۷۵۳,۸۰۳	.	۵۷۰,۷۵۳,۸۰۳	۱۷	۱۴۰۰/۱۰/۲۶	۱۳۹۹/۰۴/۲۶	مشارکت دولت-باشریط خاص ۱۴۰۰
۴۱,۵۷۸,۰۹۷	.	۴۱,۵۷۸,۰۹۷	۴۱,۵۷۸,۰۹۷	.	۴۱,۵۷۸,۰۹۷	۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۲۵	۱۳۹۹/۰۲/۲۵	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰
۶۸,۶۹۲,۶۲۲,۴۶۶	.	۶۸,۶۹۲,۶۲۲,۴۶۶	۶,۴۲۴,۶۷۷,۸۰۸	.	۶,۴۲۴,۶۷۷,۸۰۸	۱۷.۹	۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۱۳۹۹/۰۲/۱۸	منفعت دولت ۵-ش خاص سایر ۰۱۰۸
۸۶۸,۶۶۰,۶۲۲	.	۸۶۸,۶۶۰,۶۲۲	۸,۰۰۰	.	۸,۰۰۰	۱۰ ماه شمار	-	۱۳۹۹/۰۱/۰۱	کوتاه مدت-۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵-آینده
۳۴,۹۴۹,۳۷۹,۸۵۴	(۲۰,۸۹۱,۹۷۳)	۳۴,۹۷۰,۲۷۱,۸۲۷	۵,۳۵۵,۵۰۱,۴۵۱	(۲۶,۲۱۰,۸۹۱)	۵,۳۸۱,۷۱۲,۳۴۲	۲۰	-	۱۳۹۹/۰۱/۱۴	کوتاه مدت-۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹-آینده
۲۹,۸۹۷	.	۲۹,۸۹۷	.	.	.	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۹/۰۶/۲۲	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۳۱,۵۸۰,۱۲۸,۱۲۹	(۲۷,۱۳۲,۸۴۳)	۱۳۱,۶۰۷,۲۶۰,۹۷۲	۱۹,۴۰۹,۷۳۲,۱۳۰	(۵۰,۱۲۸,۳۲۳)	۱۹,۴۵۹,۸۶۰,۴۵۳				جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورنتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				طی دوره				
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	خالص ارزش فروش	تعداد	شرح
۴۹۸,۹۷۹,۲۱۷	۳,۹۵۵,۴۶۰,۹۰۲	۴,۴۵۴,۴۴۰,۱۱۹	۲۷۵,۰۰۰	ارتباطات سیار
(۷۵۵,۱۵۶,۴۴۶)	۱۴,۳۶۷,۷۸۹,۲۸۹	۱۳,۶۱۲,۶۳۲,۸۴۳	۲,۳۹۳,۰۰۰	بانک ملت
۱,۱۳۸,۳۵۲	۶۸۷,۴۰۴	۱,۸۲۵,۷۵۶	۵۰	۱,۱۳۸,۳۵۲	۶۸۷,۴۰۴	۱,۸۲۵,۷۵۶	۵۰	ذوب روی اصفهان
۱,۹۳۰,۰۳۹,۵۰۷	۱۳,۷۴۵,۳۸۵,۵۵۵	۱۵,۶۷۵,۴۲۵,۰۶۲	۴,۰۴۰,۸۴۱	۶۹۵,۹۱۳,۳۰۲	۲,۷۷۸,۸۵۰,۰۰۹	۳,۴۷۴,۷۶۳,۳۱۱	۷۱۵,۰۰۰	سرمایه گذاری غدیر
۷۹۰,۸۲۱,۲۰۸	۱۶,۹۹۹,۴۲۹,۱۳۰	۱۷,۷۹۰,۲۵۰,۳۳۸	۳,۴۲۲	سهام آشنا
۷۳,۴۶۹,۱۱۹	۱,۴۲۵,۲۴۸,۳۹۲	۱,۴۹۸,۷۱۷,۵۱۱	۲۲,۴۰۶	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
۳۸۴,۲۵۸,۱۵۴	۱,۹۵۵,۷۳۸,۸۱۸	۲,۳۳۹,۹۹۶,۹۷۲	۴۳۰,۰۰۰	فولاد کاوه
۱,۸۳۶,۲۲۹,۷۶۰	۱۵,۷۵۳,۳۳۱,۷۲۸	۱۷,۵۸۹,۵۶۱,۴۸۸	۳,۶۲۸,۰۰۰	۴۹۵,۰۴۶,۸۷۰	۳,۵۸۱,۵۶۱,۰۶۶	۴,۰۷۶,۶۰۷,۹۳۶	۹۰۰,۰۰۰	فولاد مبارکه
۲۲۳,۹۱۴,۶۷۷	۱,۴۸۱,۵۹۱,۱۸۷	۱,۷۰۵,۵۰۵,۸۶۴	۲۰۰,۰۰۰	کشتیرانی ایران
۲,۲۵۰,۹۳۸,۲۴۴	۱۰,۰۲۴,۵۶۲,۴۴۲	۱۲,۲۷۵,۵۰۰,۶۸۶	۱,۹۳۰,۰۰۰	مخابرات
۳۴۶,۲۰۹,۰۴۶	۱,۹۶۴,۶۰۲,۵۹۳	۲,۳۱۰,۸۱۱,۶۳۹	۳۴۵,۰۰۰	ملی مس
(۷,۳۲۱)	۹,۵۲۰,۰۰۲	۹,۵۱۲,۶۸۱	۱۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
.	۵,۸۲۳,۸۵۳,۱۱۹	۵,۸۲۳,۸۵۳,۱۱۹	۵۷۵,۰۰۰	پارند-مشارکت ETF
۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۷,۴۶۲,۰۰۵,۳۳۴	۷,۶۴۸,۴۱۳,۹۳۹	۲,۵۰۰,۰۰۰	پتروشیمی تامین
۶۶۹,۳۶۳,۷۶۵	۲,۲۵۱,۱۲۱,۱۰۷	۲,۹۲۰,۴۸۴,۸۷۲	۳۵۵,۰۰۰	۶۶۹,۳۶۳,۷۶۵	۲,۲۵۱,۱۲۱,۱۰۷	۲,۹۲۰,۴۸۴,۸۷۲	۳۵۵,۰۰۰	پتروشیمی خلیج فارس
۹۲,۸۵۳,۳۶۰	۹,۸۶۷,۹۱۳,۲۹۷	۹,۹۶۰,۷۶۶,۶۵۷	۱,۶۰۰,۰۰۰	چادرملو
۱,۷۳۸,۰۴۸	۲,۰۵۱,۱۲۶	۳,۷۸۹,۱۷۴	۳۶۹	۱,۷۳۸,۰۴۸	۲,۰۵۱,۱۲۶	۳,۷۸۹,۱۷۴	۳۶۹	گروه توسعه مالی مهر آیندگان
.	.	.	.	(۱,۷۰۳,۳۶۹)	۱,۷۰۳,۵۷۶	۲۰۷	.	گروه توسعه مالی مهر آیندگان
.	.	.	.	(۱,۰۸۹,۹۱۰)	۱,۰۸۹,۹۱۰	.	.	ذوب روی اصفهان
۸,۵۳۱,۱۹۷,۲۹۵	۱۰۷,۰۹۰,۲۹۱,۴۲۵	۱۱۵,۶۲۱,۴۸۸,۷۲۰	۱۸,۲۹۸,۰۹۸	۱,۸۶۰,۴۰۷,۰۵۸	۸,۶۱۷,۰۶۴,۱۹۸	۱۰,۴۷۷,۴۷۱,۲۵۶	۱,۹۷۰,۴۱۹	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 الگور بتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				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	
(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۱۹,۹۲۸,۳۹۰,۵۶۳	۱۷,۹۲۵,۰۵۷,۶۴۹	۲۵,۷۳۲	(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۱۹,۹۲۸,۳۹۰,۵۶۳	۱۷,۹۲۵,۰۵۷,۶۴۹	۲۵,۷۳۲	اسنادخرانه-م-۱۰بودجه-۹۸-۱۰۰۶
(۱۶۲,۸۵۲,۷۸۳)	۸,۷۸۸,۱۳۹,۶۶۳	۸,۶۲۵,۲۸۶,۸۸۰	۱۱,۹۵۰	۲۱۱,۶۳۶,۳۰۲	۸,۴۱۳,۶۵۰,۵۷۸	۸,۶۲۵,۲۸۶,۸۸۰	۱۱,۹۵۰	اسنادخرانه-م-۱۳بودجه-۹۷-۵۱۸۰۰۰
(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۷,۶۵۸,۱۵۳,۳۳۰	۶,۹۳۴,۸۶۸,۵۷۲	۱۱,۰۰۰	(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۷,۶۵۸,۱۵۳,۳۳۰	۶,۹۳۴,۸۶۸,۵۷۲	۱۱,۰۰۰	اسنادخرانه-م-۱۴بودجه-۹۸-۱۰۳۱۸۰۰۰
(۸۹,۳۳۵,۵۶۰)	۱۰۰,۷۸,۳۳۶,۰۸۰	۹,۹۸۹,۰۰۰,۵۲۰	۱۳,۳۹۸	۱۲۷,۶۵۷,۳۱۱	۹,۸۶۱,۳۴۳,۲۰۹	۹,۹۸۹,۰۰۰,۵۲۰	۱۳,۳۹۸	اسنادخرانه-م-۱۶بودجه-۹۷-۰۴۰۷۰۰۰
(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۳۷,۳۵۴,۳۹۰,۲۱۵	۳۳,۵۹۰,۷۶۷,۶۲۵	۵۵,۴۹۸	(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۳۷,۳۵۴,۳۹۰,۲۱۵	۳۳,۵۹۰,۷۶۷,۶۲۵	۵۵,۴۹۸	اسنادخرانه-م-۱۸بودجه-۹۸-۱۰۶۱۴۰۰۰
(۱,۸۳۱,۱۸۳,۴۴۲)	۳۶,۰۶۹,۵۶۱,۳۰۸	۳۴,۲۳۸,۳۷۷,۸۶۶	۴۸,۶۲۱	(۲,۵۲۶,۷۵۱,۴۲۳)	۳۶,۷۶۵,۱۲۹,۲۸۹	۳۴,۲۳۸,۳۷۷,۸۶۶	۴۸,۶۲۱	اسنادخرانه-م-۲۱بودجه-۹۷-۰۰۷۲۸۰۰۰
(۱,۹۰۶,۴۲۶,۰۶۲)	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۴۷۰	۳۵,۴۱۰,۴۱۴,۴۰۸	۴۸,۴۶۵	(۲۷۴,۴۴۰,۲۴۶)	۳۵,۶۸۴,۸۵۴,۶۵۴	۳۵,۴۱۰,۴۱۴,۴۰۸	۴۸,۴۶۵	اسنادخرانه-م-۲۲بودجه-۹۷-۰۰۴۲۸۰۰۰
(۱,۸۰۲,۸۳۹,۵۵۶)	۲۱,۷۳۱,۲۰۹,۶۴۴	۱۹,۹۲۸,۳۶۹,۹۳۸	۲۸,۹۱۳	(۱,۹۳۱,۱۶۷,۸۴۲)	۲۱,۸۴۹,۵۳۷,۷۸۰	۱۹,۹۲۸,۳۶۹,۹۳۸	۲۸,۹۱۳	اسنادخرانه-م-۲۳بودجه-۹۷-۰۰۸۲۴۰۰۰
(۶,۴۲۳,۸۹۷,۵۹۶)	۱۰۰,۸۴۹,۸۸۸,۶۲۹	۹۴,۴۲۵,۷۹۱,۰۳۳	۱۳۴,۲۶۳	(۲,۳۸۱,۹۵۳,۶۴۰)	۹۶,۷۰۷,۷۴۴,۶۷۳	۹۴,۴۲۵,۷۹۱,۰۳۳	۱۳۴,۲۶۳	اسنادخرانه-م-۷بودجه-۹۸-۰۰۰۷۱۹۰۰۰
۴,۷۲۶,۳۵۸,۹۳۲	۱۳,۲۸۲,۱۸۹,۹۰۸	۱۸,۰۰۸,۴۴۸,۸۴۰	۱,۷۵۲,۰۰۰	۳۰,۴۴۶,۶۱۶,۹۴۱	۱۴,۹۶۳,۸۳۱,۸۹۹	۱۸,۰۰۸,۴۴۸,۸۴۰	۱,۷۵۲,۰۰۰	بانک ملت
۴۰,۱۴۹,۴۴۹	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۷۶,۰۸۰,۳۲۴	۱۰,۵۳۹	۲۷,۵۰۹,۹۴۱	۴۸,۵۷۰,۲۸۳	۷۶,۰۸۰,۳۲۴	۱۰,۵۳۹	تامین سرمایه بانک ملت
۴,۶۳۱,۷۱۹,۸۷۸	۸,۳۳۶,۸۹۶,۱۴۸	۱۲,۹۶۸,۶۱۶,۰۲۶	۱,۰۶۵,۰۰۰	۳,۹۵۱,۶۳۳,۰۳۳	۹۰,۱۶,۹۸۲,۹۹۳	۱۲,۹۶۸,۶۱۶,۰۲۶	۱,۰۶۵,۰۰۰	توسعه صنایع بهشهر
۷,۸۸۱,۴۶۶,۵۳۵	۷,۱۴۴,۵۱۲,۶۹۶	۱۵,۰۲۵,۹۷۹,۳۳۱	۲۵۶,۱۰۰	۳,۶۲۶,۹۰۶,۷۳۵	۱۱,۳۹۹,۰۷۲,۴۹۶	۱۵,۰۲۵,۹۷۹,۳۳۱	۲۵۶,۱۰۰	دارویی تامین
۲۳۴,۶۱۴,۷۷۲	۳,۲۷۲,۳۷۴,۲۶۵	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۳۷	۳۷۹,۴۶۲	۲۳۴,۶۱۴,۷۷۲	۳,۲۷۲,۳۷۴,۲۶۵	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۳۷	۳۷۹,۴۶۲	سرمایه گذاری تامین اجتماعی
۳,۱۱۰,۲۶۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۸۱۱	۳,۱۱۰,۲۶۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۸۱۱	سرمایه گذاری صبا تامین
۸,۱۷۵,۹۵۴,۷۱۸	۱۰,۶۷۲,۵۷۵,۶۷۹	۱۸,۸۴۸,۵۳۰,۳۹۷	۲,۷۱۹,۱۵۹	۶,۳۸۵,۸۳۷,۹۳۷	۱۲,۴۶۲,۶۹۲,۴۶۰	۱۸,۸۴۸,۵۳۰,۳۹۷	۲,۷۱۹,۱۵۹	سرمایه گذاری غدیر
۶۳,۹۴۸,۷۱۵	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۱۳۶,۳۰۶,۴۲۷	۵۵۰۰	۴۷,۳۷۲,۵۷۰	۸۸,۹۳۳,۸۵۷	۱۳۶,۳۰۶,۴۲۷	۵۵۰۰	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر
۱,۹۵۷,۴۳۶,۷۷۵	۱۰۰,۱۶,۵۷۶,۹۷۵	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	۱,۹۰۰	۵۵۰۳,۱۱۳	۱۱,۹۶۸,۵۱۰,۶۳۷	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	۱,۹۰۰	سکه تمام بهار تحولی اروزه صادرات
۱۵,۳۶۲,۴۰۲	۳۱,۲۹۰,۴۶۷	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۱,۳۲۸	۱۲,۱۱۰,۳۱۴	۳۴,۵۴۲,۵۵۵	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۱,۳۲۸	سیمان ساوه
۱۲,۳۶۳,۰۵۹,۴۰۸	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۲۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۳,۸۲۴	۶,۲۱۵,۲۷۳,۳۹۲	۱۷,۱۶۶,۳۵۳,۳۹۲	۲۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۳,۸۲۴	صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر
۷,۴۱۵,۰۴۷	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۱,۳۱۳	۴,۸۴۵,۸۳۹	۲۸,۷۶۶,۸۸۶	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۱,۳۱۳	صنعتی دوده فام
۵,۷۹۰,۶۵۶,۷۵۸	۸,۸۴۹,۳۴۱,۳۵۸	۱۴,۶۳۹,۹۹۸,۱۱۶	۱۱۸,۸۳۵	۳,۳۵۹,۳۴۱,۳۱۸	۱۱,۳۸۰,۶۵۶,۸۹۸	۱۴,۶۳۹,۹۹۸,۱۱۶	۱۱۸,۸۳۵	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
۴,۹۳۸,۹۳۴,۷۶۰	۹,۹۵۸,۰۶۹,۳۵۹	۱۴,۸۹۷,۰۰۴,۱۱۹	۲,۴۸۰,۰۰۰	۲,۹۸۳,۸۷۷,۸۵۹	۱۱,۹۱۳,۱۲۶,۳۶۰	۱۴,۸۹۷,۰۰۴,۱۱۹	۲,۴۸۰,۰۰۰	فولاد مبارکه

۲,۶۰۲,۴۶۸,۰۱۳	۸,۶۷۷,۱۵۲,۸۵۷	۱۱,۲۷۹,۶۲۰,۸۷۰	۴۷۸,۶۰۰	۳,۴۱۸,۷۱۸,۷۱۵	۷,۸۶۰,۹۰۲,۱۵۵	۱۱,۲۷۹,۶۲۰,۸۷۰	۴۷۸,۶۰۰	کشتیرانی ایران
۱,۷۸۶,۹۱۱	۱,۱۲۳,۹۵۷	۲,۹۱۰,۸۶۸	۳۸	(۳۸,۸۷۱)	۲,۹۴۹,۷۳۹	۲,۹۱۰,۸۶۸	۳۸	کلر پارس
(۳,۳۵۰,۴۷۶,۸۷۵)	۲۴,۲۶۰,۳۰۶,۲۵۰	۲۰,۹۰۹,۸۲۹,۳۷۵	۲۵,۰۰۰	(۳,۳۵۰,۴۷۶,۸۷۵)	۲۴,۲۶۰,۳۰۶,۲۵۰	۲۰,۹۰۹,۸۲۹,۳۷۵	۲۵,۰۰۰	مراجعه گندم ۲- واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
(۴,۵۵۴,۶۰۲,۵۷۶)	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰	۳۲,۰۹۶,۱۴۷,۸۸۴	۴۰,۰۰۰	(۸۷۰,۲۸۸,۵۸۳)	۳۳,۹۶۶,۴۳۶,۴۶۷	۳۳,۰۹۶,۱۴۷,۸۸۴	۴۰,۰۰۰	مشارکت دولت-باشراط خاص ۱۴۰۰۱۰
(۲,۲۲۷,۲۳۰,۲۳۶)	۲۰,۹۰۵,۴۲۰,۵۲۳	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۲۸۷	۲۱,۳۲۳	(۲,۲۲۷,۲۳۰,۲۳۶)	۲۰,۹۰۵,۴۲۰,۵۲۳	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۲۸۷	۲۱,۳۲۳	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
(۳۱,۷۹۲,۳۴۴,۲۳۰)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	۴۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۱۰۸,۶۶,۵۹۰	۳۶۷,۱۹۶,۷۸۹,۱۸۰	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	۴۰۰,۰۰۰	منفعت دولت ۵-ش-خاص سایر ۱۰۸
۲۳۸,۷۳۹,۴۱۲	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۴۸۵,۷۵۶,۰۵۵	۵۶,۲۴۸	۱۷۸,۸۵۱,۳۵۸	۳۰۶,۹۰۴,۶۹۷	۴۸۵,۷۵۶,۰۵۵	۵۶,۲۴۸	پتروشیمی تندگوینان
۶,۳۱۱,۷۷۲,۳۰۶	۸,۴۸۹,۸۲۸,۰۰۳	۱۴,۸۰۱,۶۰۰,۳۰۹	۱,۳۲۵,۲۳۶	۳,۳۳۲,۳۹۶,۸۴۹	۱۱,۴۶۹,۲۰۳,۴۶۰	۱۴,۸۰۱,۶۰۰,۳۰۹	۱,۳۲۵,۲۳۶	پتروشیمی خلیج فارس
۹۲,۴۵۰,۳۸۷	۲,۹۳۱,۸۱۲,۷۲۴	۴۰,۲۴,۲۶۳,۱۱۱	۷۰,۰۶۷	۹۰,۷۷۱,۵۰۷	۳,۹۳۳,۴۹۱,۶۰۴	۴۰,۲۴,۲۶۳,۱۱۱	۷۰,۰۶۷	بدیده شیعی قرن
۳۰۱۴,۵۶۰,۱۵۱	۱۰۰,۵۱,۱۴۹,۸۸۷	۱۳,۰۶۵,۷۱۰,۰۳۸	۱,۴۰۵,۰۰۰	۳۰,۶۸,۸۷۰,۳۴۵	۹,۹۹۶,۸۳۹,۶۹۳	۱۳,۰۶۵,۷۱۰,۰۳۸	۱,۴۰۵,۰۰۰	چادرملو
۳۰۷۰,۴۳۶,۴۱۶	۸۷۶,۱۱۵,۸۰۹,۱۴۲	۸۷۹,۱۸۶,۳۴۵,۵۵۸	۱۲,۹۹۵,۱۲۳	۲۲,۰۰۹,۷۳۴,۹۲۸	۸۵۷,۱۷۶,۵۱۰,۶۳۰	۸۷۹,۱۸۶,۳۴۵,۵۵۸	۱۲,۹۹۵,۱۲۳	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 الگورتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				طی دوره				سهام
جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
۳۶,۹۰۰,۲۷۸,۲۳۶	۰	(۳۱,۷۹۲,۳۴۴,۲۳۰)	۶۸,۶۹۲,۶۲۲,۴۶۶	۷,۴۳۵,۵۴۴,۳۹۸	۰	۱,۰۱۰,۸۶۶,۵۹۰	۶,۴۲۴,۶۷۷,۸۰۸	منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۰۱۰۸
(۲,۴۳۵,۰۵۹,۵۳۲)	۰	(۴,۵۵۴,۶۰۲,۵۷۶)	۲,۱۱۹,۵۴۳,۰۴۴	(۲۹۹,۵۳۴,۷۸۰)	۰	(۸۷۰,۲۸۸,۵۸۳)	۵۷۰,۷۵۳,۸۰۳	مشارکت دولت-باشرايط خاص ۱۴۰۰۱۰
(۳,۱۷۷,۷۰۹,۶۷۶)	۰	(۳,۳۵۰,۴۷۶,۸۷۵)	۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	(۳,۱۷۷,۷۰۹,۶۷۶)	۰	(۳,۳۵۰,۴۷۶,۸۷۵)	۱۷۲,۷۶۷,۱۹۹	مراجعه گندم ۲-واجدشرايط خاص ۱۴۰۰
(۳,۱۸۵,۶۵۲,۱۳۹)	۰	(۲,۲۲۷,۲۳۰,۲۳۶)	۴۱,۵۷۸,۰۹۷	(۳,۱۸۵,۶۵۲,۱۳۹)	۰	(۲,۲۲۷,۲۳۰,۲۳۶)	۴۱,۵۷۸,۰۹۷	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۰	(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۰	(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۰	(۱,۲۹۳,۳۳۲,۹۱۴)	۰	اسنادخزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۰۶-۰۱۰۰
(۱۶۲,۸۵۲,۷۸۳)	۰	(۱۶۲,۸۵۲,۷۸۳)	۰	۲۱۱,۶۳۶,۳۰۲	۰	۲۱۱,۶۳۶,۳۰۲	۰	اسنادخزانه-م ۱۳ بودجه ۹۸-۵۱۸-۰۰
(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۰	(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۰	(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۰	(۷۲۳,۲۸۴,۷۵۸)	۰	اسنادخزانه-م ۱۴ بودجه ۹۸-۳۱۸-۰۱
(۸۹,۳۳۵,۵۶۰)	۰	(۸۹,۳۳۵,۵۶۰)	۰	۱۲۷,۶۵۷,۳۱۱	۰	۱۲۷,۶۵۷,۳۱۱	۰	اسنادخزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۴۰۷-۰۰
(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۰	(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۰	(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۰	(۳,۷۶۳,۶۲۲,۵۹۰)	۰	اسنادخزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۱۴-۰۱۰۶
(۱,۸۳۱,۱۸۳,۴۴۲)	۰	(۱,۸۳۱,۱۸۳,۴۴۲)	۰	(۲,۵۲۶,۷۵۱,۴۲۳)	۰	(۲,۵۲۶,۷۵۱,۴۲۳)	۰	اسنادخزانه-م ۲۱ بودجه ۹۷-۷۲۸-۰۰
(۱,۹۰۶,۴۲۶,۰۶۲)	۰	(۱,۹۰۶,۴۲۶,۰۶۲)	۰	(۲۷۴,۴۴۰,۲۴۶)	۰	(۲۷۴,۴۴۰,۲۴۶)	۰	اسنادخزانه-م ۲۲ بودجه ۹۷-۴۲۸-۰۰
(۱,۸۰۲,۸۳۹,۵۵۶)	۰	(۱,۸۰۲,۸۳۹,۵۵۶)	۰	(۱,۹۲۱,۱۶۷,۸۴۲)	۰	(۱,۹۲۱,۱۶۷,۸۴۲)	۰	اسنادخزانه-م ۲۳ بودجه ۹۷-۸۲۴-۰۰
(۶,۴۲۳,۸۹۷,۵۹۶)	۰	(۶,۴۲۳,۸۹۷,۵۹۶)	۰	(۲,۲۸۱,۹۵۳,۶۴۰)	۰	(۲,۲۸۱,۹۵۳,۶۴۰)	۰	اسنادخزانه-م ۷ بودجه ۹۸-۷۱۹-۰۰
۱,۹۵۷,۴۳۶,۷۷۵	۰	۱,۹۵۷,۴۳۶,۷۷۵	۰	۵۵۰۳,۱۱۳	۰	۵۵۰۳,۱۱۳	۰	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه صادرات
۲۲,۵۷۶	(۷,۳۲۱)	۰	۲۹,۸۹۷	۰	۰	۰	۰	منفعت صبا ا روند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۳,۰۶۳,۵۴۰,۹۷۹	(۷,۳۲۱)	(۵۷,۹۶۳,۹۹۲,۴۰۳)	۷۱,۰۲۶,۵۴۰,۷۰۳	(۱۰,۶۶۷,۱۰۸,۸۸۴)	۰	(۱۷,۸۷۶,۸۸۵,۷۹۱)	۷,۲۰۹,۷۷۶,۹۰۷	جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۱/۳۱		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
۵/۴۳٪	۳,۲۸۷,۶۷۱,۲۲۴	۶/۹۳٪	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶	سپرده بانکی بلند مدت - پارسیان
۱۲/۱۲٪	۷,۳۴۰,۵۴۷,۹۴۵	۱۵/۸۸٪	۱,۹۴۴,۹۳۱,۵۰۷	۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱	سپرده بانکی بلند مدت - پارسیان
۴/۱۲٪	۲,۴۹۳,۱۵۰,۶۷۸	۳/۴۷٪	۴۲۴,۶۵۷,۵۳۳	۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۱	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۵/۴۳٪	۳,۲۸۷,۶۷۱,۲۳۱	۶/۹۳٪	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۲	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۹/۴۷٪	۵,۷۳۷,۸۰۸,۱۹۲	۱۲/۴۱٪	۱,۵۲۰,۲۷۳,۹۷۰	۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۳	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۱/۴۳٪	۸۶۸,۶۶۰,۶۲۲	۰/۰٪	۸,۰۰۰	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
۵۷/۷۳٪	۳۴,۹۷۰,۲۷۱,۸۲۷	۴۳/۹۳٪	۵,۳۸۱,۷۱۲,۳۴۲	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
۴/۲۸٪	۲,۵۹۴,۹۳۸,۵۵۰	۱۰/۴۵٪	۱,۲۷۹,۸۷۰,۰۵۸	۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶	سپرده بانکی کوتاه مدت - صادرات
۱۰۰٪	۶۰,۵۸۰,۷۲۰,۲۶۹	۱۰۰٪	۱۲,۲۵۰,۰۸۳,۵۴۶		جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

۲-۴- سایر درآمدها:

<u>۱۳۹۹/۰۱/۳۱</u>	<u>طی دوره</u>	
<u>مبلغ</u>	<u>مبلغ</u>	<u>سایر درآمدها</u>
۶۳,۹۰۲,۵۸۳	۸,۹۱۵,۳۲۳	آینده نگر خوارزمی
۳۷۵,۴۳۴	۳۱۶,۰۴۰	بانک پاسارگاد
۳۵,۵۸۱,۱۹۷	۱۷,۸۸۱,۷۶۳	سایر درآمدها
<u>۹۹,۸۵۹,۲۱۴</u>	<u>۲۷,۱۱۳,۱۲۶</u>	<u>جمع</u>