



**صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم**

صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم

صورت وضعیت بورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۱- سرمایه گذاری ها

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

درصد به کل دارایی ها	۱۳۹۹/۰۲/۳۱					تغییرات طی دوره					۱۳۹۹/۰۱/۳۱					شرکت
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر سهم	تعداد	مبلغ فروش	تعداد فروش طی دوره	بهای تمام شده	تعداد خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد		
-۱۸۵٪	۲۶,۱۹۳,۳۸۱,۹۱۱	۱۴,۶۱۸,۳۲۰,۷۰۱	۸,۶۶۶	۲,۹۲۹,۱۵۹	۳,۰۱۷,۵۱۱,۲۴۶	۲۶۵,۰۰۰	۴,۹۸۵,۸۵۷,۹۹۶	۴۷۵,۰۰۰	۱۸,۸۴۸,۵۳۰,۳۷۹	۱۰,۶۷۲,۵۷۵,۶۷۹	۲,۷۱۹,۱۵۹	۱۸,۸۴۸,۵۳۰,۳۷۹	۱۰,۶۷۲,۵۷۵,۶۷۹	۲,۷۱۹,۱۵۹	سرمایه گذاری غدیر	
۱/۰-۸٪	۳۳,۳۱۸,۸۱۴,۱۸۷	۱۹,۸۱۸,۴۰۲,۹۸۷	۱۶,۳۸۸	۲,۰۵۱,۰۰۰	۴,۸۷۴,۰۸۷,۲۷۴	۳۰۰,۰۰۰	۹,۴۳۵,۰۵۳,۱۰۶	۵۹۹,۰۰۰	۱۸,۰۰۸,۴۴۸,۸۴۰	۱۳,۳۸۲,۱۸۹,۹۰۸	۱,۷۵۲,۰۰۰	۱۸,۰۰۸,۴۴۸,۸۴۰	۱۳,۳۸۲,۱۸۹,۹۰۸	۱,۷۵۲,۰۰۰	بانک ملت	
-۵۳٪	۱۶,۰۵۹,۷۴۴,۲۴۷	۸,۸۴۳,۰۵۹,۳۴۱	۹,۲۷۴	۱,۷۴۴,۰۰۰	۱۲,۱۱۶,۹۶۰,۹۲۲	۱,۳۵۷,۰۰۰	۴,۹۸۷,۴۹۶,۴۶۶	۵۲۱,۰۰۰	۱۴,۸۹۷,۰۰۴,۱۱۹	۹,۹۵۸,۰۶۹,۳۵۹	۲,۴۸۰,۰۰۰	۱۴,۸۹۷,۰۰۴,۱۱۹	۹,۹۵۸,۰۶۹,۳۵۹	۲,۴۸۰,۰۰۰	فولاد مبارکه	
-۷۲٪	۲۲,۱۱۹,۸۴۱,۰۷۷	۱۹,۶۴۴,۶۲۰,۳۰۱	۱۴,۱۲۸	۱,۵۷۰,۰۰۰	.	.	۱۹,۶۴۴,۶۲۰,۳۰۱	۱,۵۷۰,۰۰۰	.	.	.	.	.	.	گروه بهمن	
-۱۸۹٪	۲۷,۳۹۳,۱۸۳,۵۲۹	۱۵,۷۷۹,۹۹۴,۳۸۹	۱۸,۱۴۷	۱,۵۱۶,۰۰۰	.	.	۷,۴۴۳,۰۹۸,۱۴۱	۴۵۱,۰۰۰	۱۲,۹۶۸,۶۱۶,۰۲۶	۸,۳۳۶,۸۹۶,۱۴۸	۱,۰۶۵,۰۰۰	۱۲,۹۶۸,۶۱۶,۰۲۶	۸,۳۳۶,۸۹۶,۱۴۸	۱,۰۶۵,۰۰۰	توسعه صنایع بهشهر	
-۷۰٪	۲۱,۶۳۵,۸۷۵,۳۳۶	۱۲,۳۸۵,۵۷۶,۰۹۵	۱۵,۱۶۲	۱,۴۴۳,۳۳۶	۱,۹۹۹,۷۸۳,۴۴۵	۱۶۵,۰۰۰	۴,۹۵۲,۷۸۳,۶۸۵	۲۶۳,۰۰۰	۱۴,۸۰۱,۶۰۰,۳۰۹	۸,۴۸۹,۸۲۸,۰۰۳	۱,۳۲۵,۳۳۶	۱۴,۸۰۱,۶۰۰,۳۰۹	۸,۴۸۹,۸۲۸,۰۰۳	۱,۳۲۵,۳۳۶	پتروشیمی خلیج فارس	
-۵۶٪	۱۷,۲۶۷,۲۴۵,۹۹۹	۹,۸۳۰,۰۷۷,۵۰۶	۱۵,۳۵۳	۱,۱۳۲,۰۰۰	۹,۸۲۹,۸۸۶,۵۰۳	۶۰۰,۰۰۰	۴,۹۸۹,۳۱۶,۰۵۰	۳۲۷,۰۰۰	۱۳,۰۶۵,۷۱۰,۰۳۸	۱۰,۰۵۱,۱۴۹,۸۸۷	۱,۴۰۵,۰۰۰	۱۳,۰۶۵,۷۱۰,۰۳۸	۱۰,۰۵۱,۱۴۹,۸۸۷	۱,۴۰۵,۰۰۰	چادرمو	
-۵۸٪	۱۷,۷۷۷,۷۹۰,۶۹۶	۱۲,۶۵۷,۳۲۵,۴۹۲	۲۹,۴۸۱	۶۰۷,۶۰۰	.	.	۳,۹۸۰,۱۱۲,۶۴۵	۱۲۹,۰۰۰	۱۱,۲۷۹,۶۲۰,۸۷۰	۸,۶۷۷,۱۵۲,۸۵۷	۴۷۸,۶۰۰	۱۱,۲۷۹,۶۲۰,۸۷۰	۸,۶۷۷,۱۵۲,۸۵۷	۴۷۸,۶۰۰	کشتیرانی ایران	
-۱۹۹٪	۳۰,۵۱۰,۳۰۵,۸۱۳	۱۵,۰۴۸,۱۰۸,۴۱۵	۵۶,۹۷۶	۵۳۸,۹۵۰	.	.	۷,۹۰۳,۵۹۵,۷۱۹	۱۵۴,۸۰۰	۱۵,۰۲۵,۹۷۹,۳۲۱	۷,۱۴۴,۵۱۲,۶۹۶	۲۵۶,۱۰۰	۱۵,۰۲۵,۹۷۹,۳۲۱	۷,۱۴۴,۵۱۲,۶۹۶	۲۵۶,۱۰۰	دارویی تامین	
-۱۱۸٪	۵,۶۵۵,۰۵۳,۴۷۰	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۱۵,۰۸۱	۳۷۹,۴۶۲	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	.	.	.	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۲۷	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۳۷۹,۴۶۲	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۲۷	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۳۷۹,۴۶۲	سرمایه گذاری تامین اجتماعی	
-۳۸٪	۱۱,۸۳۲,۴۱۶,۹۳۵	۱۲,۷۷۱,۵۹۸,۵۷۱	۳۷,۵۲۶	۳۱۸,۰۰۰	.	.	۱۲,۷۷۱,۵۹۸,۵۷۱	۳۱۸,۰۰۰	.	.	.	.	.	.	انفورماتیک	
-۴۱٪	۱۲,۷۳۸,۶۹۰,۴۱۷	۱۳,۳۷۷,۳۲۱,۱۰۸	۶۱,۲۷۲	۲۰۹,۷۹۷	.	.	۹,۴۴۵,۵۰۸,۳۸۴	۱۳۹,۷۳۰	۴,۰۲۴,۲۶۳,۱۱۱	۳,۹۳۱,۸۱۲,۷۲۴	۷۰,۰۶۷	۴,۰۲۴,۲۶۳,۱۱۱	۳,۹۳۱,۸۱۲,۷۲۴	۷۰,۰۶۷	پدیده شبمی قرن	
-۰/۰۳٪	۶۲۵,۵۶۶,۶۵۷	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۱۱,۳۲۲	۵۶,۲۴۸	.	.	.	.	۴۸۵,۷۵۶,۰۵۵	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۵۶,۲۴۸	۴۸۵,۷۵۶,۰۵۵	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۵۶,۲۴۸	پتروشیمی تندگویان	
-۱۱۶٪	۴,۹۰۷,۹۷۴,۴۹۴	۴,۹۴۴,۱۴۵,۰۷۵	۹۷,۸۳۵	۵۰,۰۰۰	۴,۹۴۴,۱۴۵,۰۷۵	.	.	۵۰,۰۰۰	.	.	.	.	.	.	پارس دارو	
-۰/۰۰٪	۱۱۰,۰۱۰,۶۹۶۷	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۱۰,۶۳۶	۱۰,۵۳۹	.	.	.	.	۷۶,۰۰۸,۰۳۲۴	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۱۰,۵۳۹	۷۶,۰۰۸,۰۳۲۴	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۱۰,۵۳۹	تامین سرمایه بانک ملت	
-۰/۰۱٪	۱۷۱,۷۹۴,۷۵۶	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۳۲,۰۰۵	۵۵,۰۰۰	.	.	.	.	۱۲۶,۳۰۶,۴۲۷	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۵۵,۰۰۰	۱۲۶,۳۰۶,۴۲۷	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۵۵,۰۰۰	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر	
۱/۰-۸٪	۳۳,۳۷۷,۳۳۶,۹۹۲	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۸,۵۷۲,۰۰۸	۳,۸۲۴	.	.	.	.	۲۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۳,۸۲۴	۲۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۳,۸۲۴	صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر	
-۰/۰۰٪	۶۴,۶۴۹,۵۳۲	۳۱,۲۹۰,۴۶۷	۴۸,۳۷۸	۱,۳۲۸	.	.	.	.	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۳۱,۲۹۰,۴۶۷	۱,۳۲۸	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۳۱,۲۹۰,۴۶۷	۱,۳۲۸	سیمان ساوه	
-۰/۰۰٪	۴۰,۴۶۹,۳۸۸	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۲۹,۸۱۷	۱,۳۱۳	.	.	.	.	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۱,۳۱۳	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۱,۳۱۳	صنعتی دوده قام	
-۰/۰۰٪	۱۶,۹۵۸,۸۵۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۲۱,۱۴۶	۸۱۱	.	.	.	.	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۸۱۱	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۸۱۱	سرمایه گذاری صبا تامین	
-۰/۰۰٪	۳,۱۰۸,۱۵۷	۱,۱۲۴,۱۶۴	۳۸	۳۸	.	.	.	.	۲,۹۱۱,۰۷۵	۱,۱۲۴,۱۶۴	۳۸	۲,۹۱۱,۰۷۵	۱,۱۲۴,۱۶۴	۳۸	کلر پارس	
-۰/۰۰٪	۱۸۹,۷۹۱	۱۷۵,۳۳۸	۱۳,۰۳۴	۱۴	.	.	۱۷۵,۳۳۸	۱۴	.	.	.	.	.	.	شیرپاستوریزه پگاه گیلان	
-۰/۰۰٪	۵۶۱,۳۱۹	۵۶۵,۳۹۷	۴۰,۳۵۳	۱۴	.	.	۵۶۵,۳۹۷	۱۴	.	.	.	.	.	.	مجمع صنایع لاستیک یزد	
-۰/۰۰٪	.	.	.	.	۱۴,۷۱۱,۴۱۷,۶۰۹	۱۱۸,۸۳۵	.	.	۱۴,۶۳۹,۹۹۸,۱۱۶	۸,۸۴۹,۳۴۱,۳۵۸	۱۱۸,۸۳۵	۱۴,۶۳۹,۹۹۸,۱۱۶	۸,۸۴۹,۳۴۱,۳۵۸	۱۱۸,۸۳۵	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش	
۹/۱۲٪	۲۸۱,۸۴۰,۸۱۸,۳۰۲	۱۷۴,۵۳۳,۸۰۷,۳۹۳	-	۱۴,۵۴۸,۸۳۳	۴۵,۵۴۹,۶۴۶,۹۹۹	۲,۷۰۵,۸۳۵	۹۵,۴۸۳,۸۸۶,۷۶۴	۴,۹۹۷,۵۵۸	۱۶۵,۲۴۲,۲۷۴,۴۱۵	۱۰۴,۲۰۸,۰۴۵,۵۹۶	۱۲,۱۲۹,۰۶۰	۱۶۵,۲۴۲,۲۷۴,۴۱۵	۱۰۴,۲۰۸,۰۴۵,۵۹۶	۱۲,۱۲۹,۰۶۰	جمع	

**صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت بورتقوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱**

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

نام اوراق	دارای مجوز از سازمان بورس یا فرابورس	پدیرفته شده در بورس یا فرابورس	تاریخ انتشار اوراق	تاریخ سررسید	نرخ سود اسمی	نرخ سود مؤثر	اطلاعات اوراق بهادار یا درآمد ثابت			تغییرات طی دوره			۱۳۹۹/۰۱/۳۱		۱۳۹۹/۰۲/۳۱		درصد به کل دارایی ها
							تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی دوره	خرید طی دوره	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	فروش طی دوره	خرید طی دوره	
استادخرانه م ۱۰ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۱/۰۶	-	-	۲۵,۷۳۲	۱۹,۳۲۸,۳۹۰,۵۶۳	۱۷,۳۲۵,۰۵۷,۶۶۹	۱۵,۰۰۰	۱۱,۷۶۶,۲۶۷,۹۸۸	-	-	۴۰,۷۳۲	۳,۰۷۴,۶۳۸,۶۶۱	۲۹,۶۴۹,۹۸۴,۱۲۹	۰,۸۵٪
استادخرانه م ۱۲ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۱۱/۱۱	-	-	-	-	-	۶۷,۱۱۹	۵۲,۷۰۸,۳۲۷,۹۵۷	-	-	۷۱۴,۵۹۶	۵۲,۷۰۸,۳۲۷,۹۵۷	۴۷,۹۵۴,۲۷۵,۶۳۶	۱,۵۵٪
استادخرانه م ۱۲ بودجه ۹۷-۹۸	بلی	فرابورس	۱۳۹۷/۰۷/۱۸	۱۴۰۰/۰۵/۱۸	-	-	۱۱,۹۵۰	۸,۶۲۸,۱۳۹,۶۶۳	۱,۵۳۰	۱,۳۸۳,۸۰۶,۳۸۶	-	-	۱۳,۶۸۰	۷۶۰,۶۵۹	۱۰,۳۵۱,۸۲۴,۸۴۰	۰,۳۳٪	
استادخرانه م ۱۴ بودجه ۹۸-۹۹	بلی	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۳/۱۸	-	-	۱۱,۰۰۰	۷,۶۵۸,۱۵۳,۳۳۰	۵۹,۳۰۰	۴,۶۳۴,۳۶۸,۹۷۵	-	-	۶۸۳,۷۹۹	۵۱,۳۸۶,۸۰۳,۰۰۵	۴۸,۰۶۲,۳۵۶,۸۱۹	۱,۵۵٪	
استادخرانه م ۱۶ بودجه ۹۷-۹۸	بلی	فرابورس	۱۳۹۷/۰۹/۰۷	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	-	-	۱۳,۳۹۸	۱۰,۰۷۸,۳۳۶,۰۰۰	۱,۴۴۲	۱,۳۲۸,۷۱۴,۵۳۵	-	-	۱۴,۸۴۰	۱۱,۳۰۷,۰۵۰,۶۱۵	۱۱,۴۹۹,۰۹۳,۴۹۱	۰,۳۷٪	
استادخرانه م ۱۷ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۸/۲۲	۱۴۰۰/۱۱/۵/۱۲	-	-	-	-	-	۳۰,۶۱۱,۴۱۵,۳۸۵	-	-	۶۷۲,۳۵۷	۳۰,۶۱۱,۴۱۵,۳۸۵	۲۷,۸۲۰,۳۴۶,۱۳۵	۰,۹۰٪	
استادخرانه م ۱۸ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۸/۱۴	۱۴۰۰/۱۱/۰۶/۱۴	-	-	۵۵,۲۹۸	۳۷,۳۵۹,۳۹۰,۳۱۵	۱۳,۶۲۰	۸,۹۸۹,۹۲۵,۰۷۴	-	-	۶۸,۱۱۸	۲۶,۳۴۴,۳۱۵,۲۸۹	۲۶,۱۳۲,۶۶۸,۵۳۶	۱,۲۹٪	
استادخرانه م ۲۰ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۱۱/۰۶	۱۴۰۰/۰۲/۸/۰۶	-	-	-	-	-	۲۴۷,۲۷۳,۳۱۲,۶۵۷	۵۰,۹۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۹۴۰	۳۹۵,۴۵۹	۲۴۴,۱۳۵,۰۷۵,۰۵۷	۲۴۴,۳۴۹,۳۶۵,۶۶۹	۷,۹۰٪	
استادخرانه م ۲۱ بودجه ۹۷-۹۸	بلی	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۷/۲۸	-	-	۴۸,۶۲۱	۳۴,۳۳۸,۳۷۷,۸۶۶	-	-	-	-	۴۸,۶۲۱	۳۴,۰۶۹,۵۶۱,۳۰۸	۳۴,۱۴۱,۵۵۷,۱۶۲	۱,۱۷٪	
استادخرانه م ۲۲ بودجه ۹۷-۹۸	بلی	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۴/۲۸	-	-	۴۸,۶۲۵	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۴۷۰	-	-	-	-	۴۸,۶۲۵	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۴۷۰	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۴۷۰	۱,۲۵٪	
استادخرانه م ۲۳ بودجه ۹۷-۹۸	بلی	فرابورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۸/۲۴	-	-	۲۸,۹۱۳	۲۱,۷۳۱,۲۰۹,۴۹۴	۴۹,۱۲۰	۳,۹۸۴,۶۹۴,۹۹۶	-	-	۷۸,۰۳۳	۶۱,۵۷۱,۹۰۴,۶۹۰	۵۸,۲۴۴,۷۰۰,۸۲۵	۱,۸۸٪	
استادخرانه م ۲۵ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۴/۲۲	-	-	-	-	-	۲۱,۷۶۶,۳۸۰,۳۰۹	-	-	۲۶,۰۰۰	۲۱,۷۶۶,۳۸۰,۳۰۹	۲۰,۱۱۲,۰۸۶,۰۲۴	۰,۶۵٪	
استادخرانه م ۲۷ بودجه ۹۸-۹۹	خیر	فرابورس	۱۳۹۸/۰۳/۱۸	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	-	-	۱۳۴,۳۶۳	۱۰۰,۸۴۹,۶۸۸,۶۲۹	-	-	-	-	۱۳۴,۳۶۳	۱۰۰,۸۴۹,۶۸۸,۶۲۹	۱۰۰,۰۰۰,۹۱۴,۶۸۶	۳,۳۳٪	
سکه تمام پهار تعویلی ۱۰ روزه صادرات	خیر	بورس	۰۰۰۰/۰۰/۰۰۰	۱۳۹۹/۱۳/۲۰	-	-	۱,۹۰۰	۱۰۰,۱۶,۵۶۶,۹۷۵	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	-	-	-	۱,۹۰۰	۱۰۰,۱۶,۵۶۶,۹۷۵	۱۴,۴۷۳,۳۵۹,۰۶۰	۰,۴۷٪	
حکوک مراجعه سایپا ۱۱۳-۱۳۳-۱۳۶	بلی	بورس	۱۳۹۷/۱۲/۲۰	۱۴۰۰/۱۱/۲۱/۲۰	۱۶	-	-	-	-	۵۰,۰۰۰,۵۰۳,۳۱۳,۵۰۰	-	-	۵۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۵۰۳,۳۱۳,۵۰۰	۴۹,۹۹۹,۹۳۷,۵۰۰	۱,۶۴٪	
مراجعه گندم ۲ واجد شرایط خاص ۱۴۰۰	بلی	فرابورس	۱۳۹۶/۰۸/۲۰	۱۴۰۰/۰۸/۲۰	۱۷	-	۲۵,۰۰۰	۲۴,۶۰۳,۰۲۰,۶۲۵	۳,۹۰۰	۳,۸۱۴,۶۸۱,۶۶۱	-	-	۲۸,۹۰۰	۲۸,۰۷۴,۷۸۷,۹۹۱	۲۵,۶۶۵,۳۵۶,۹۵۵	۰,۸۳٪	
مشارکت دولت-باشیاریف خاص ۱۴۰۰	خیر	فرابورس	۱۳۹۶/۱۰/۲۶	۱۴۰۰/۱۰/۲۶	۱۷	-	۴۰,۰۰۰	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۳۶۰	-	-	-	-	۴۰,۰۰۰	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۳۶۰	۳۴,۷۱۲,۱۴۷,۳۸۳	۱,۱۲٪	
مشارکت لیزینگ ایران وشرق ۱۴۰۰	بلی	فرابورس	۱۳۹۶/۱۰/۲۵	۱۴۰۰/۱۰/۲۵	۱۸	-	۲۱,۳۳۳	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۳۸۷	-	-	-	-	۲۱,۳۳۳	۱۹,۰۰۰,۵۴۲,۵۲۳	۱۹,۳۶۶,۷۷۱,۴۴۲	۰,۶۳٪	
منفعت دولت ۵-ش-خاص سایپا ۱۰۰	بلی	فرابورس	۱۳۹۸/۰۸/۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۸/۱۸	۱۷,۹	-	۴۰,۰۰۰	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	-	-	-	-	۴۰,۰۰۰	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	۳۳۳,۸۴۴,۳۷۹,۷۵۵	۱,۰۸٪	
جمع							۸۶۰,۰۶۳	۷۷۱,۹۰۷,۷۳۳,۹۶۰	۷۱۳,۹۳۳,۷۷۱,۵۵۷	۷۲۷,۹۷۵	۵۱۳,۸۹۴,۴۶۶,۰۱۳	۵۰,۹۴۰	۱,۵۸۸,۹۴۴	۱,۳۸۱,۶۶۳,۹۷۲,۵۷۳	۱,۱۹۶,۵۲۳,۰۴۹,۳۳۳	۳,۸۷٪	

## صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

### صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

**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)**

۱۳۹۹/۰۲/۳۱						
نام اوراق بهادار	تعداد	آخرین معامله	قیمت تعدیل شده	درصد تعدیل	خالص ارزش فروش تعدیل شده	دلیل تعدیل
اسناد خزانه-م ۱۷ بودجه ۹۸-۱۰۵۱۲	۴۱,۳۹۱	۷۳۱,۴۰۰	۶۷۲,۲۵۷	-۸/۰۹٪	۲۷,۸۲۰,۳۴۶,۱۳۵	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۱۰۶۱۴	۶۸,۱۱۸	۷۲۱,۰۰۰	۶۷۷,۲۳۷	-۶/۰۷٪	۴۶,۱۲۳,۶۶۸,۵۳۶	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۴ بودجه ۹۸-۱۰۳۱۸	۷۰,۳۰۰	۷۴۵,۰۰۱	۶۸۳,۷۹۹	-۸/۲۳٪	۴۸,۰۶۲,۳۵۶,۸۱۹	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۲ بودجه ۹۸-۰۰۱۱۱۱	۶۷,۱۱۹	۷۸۴,۵۰۰	۷۱۴,۵۹۶	-۸/۹۱٪	۴۷,۹۵۴,۲۷۵,۶۳۶	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۰۰۱۰۰۶	۴۰,۷۳۲	۷۹۸,۰۰۰	۷۲۲,۷۳۲	-۹/۴۳٪	۲۹,۴۳۲,۹۸۴,۱۲۹	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۲۱ بودجه ۹۷-۰۰۷۲۸	۴۸,۶۲۱	۸۱۹,۳۰۱	۷۴۳,۴۶۷	-۹/۲۶٪	۳۶,۱۴۱,۵۵۷,۱۶۲	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۹۸-۰۰۷۱۹	۱۳۴,۲۶۳	۸۲۰,۹۲۳	۷۴۵,۰۱۰	-۹/۲۵٪	۱۰۰,۰۰۹,۱۴۷,۶۸۶	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۲۳ بودجه ۹۷-۰۰۸۲۴	۷۸,۰۳۳	۸۱۱,۰۰۲	۷۴۶,۵۲۳	-۷/۹۵٪	۵۸,۲۴۲,۸۷۰,۸۲۵	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۳ بودجه ۹۷-۰۰۵۱۸	۱۳,۴۸۰	۸۴۲,۳۳۲	۷۶۰,۶۵۹	-۹/۶۹٪	۱۰,۲۵۱,۸۲۴,۸۴۰	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۹۸-۰۰۴۲۲	۲۶,۰۰۰	۸۵۳,۷۰۰	۷۷۳,۶۸۲	-۹/۳۷٪	۲۰,۱۱۲,۰۸۶,۰۲۴	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۰۰۴۰۷	۱۴,۸۴۰	۸۵۵,۵۳۶	۷۷۵,۰۱۲	-۹/۴۱٪	۱۱,۴۹۹,۰۹۳,۴۹۱	تنزیل تا سررسید
اسناد خزانه-م ۲۲ بودجه ۹۷-۰۰۴۲۸	۴۸,۴۶۵	۸۵۵,۰۰۰	۷۹۵,۳۷۰	-۶/۹۷٪	۳۸,۵۴۰,۶۲۰,۲۹۶	تنزیل تا سررسید
منفعت دولت ۵-ش. خاص سایر ۰۸-۰۱۰۸	۴۰۰,۰۰۰	۹۲۳,۶۵۰	۸۳۴,۷۶۲	-۹/۶۲٪	۳۳۳,۸۴۴,۲۷۹,۷۵۵	تنزیل تا سررسید
مشارکت دولت-باشرايط خاص ۱۰-۱۴۰۰۱۰	۴۰,۰۰۰	۹۶۰,۰۰۰	۸۶۷,۹۶۱	-۹/۵۹٪	۳۴,۷۱۲,۱۴۷,۲۸۳	تنزیل تا سررسید
مراجعه گندم ۲-واجدشرائط خاص ۱۴۰۰	۲۸,۹۰۰	۹۷۰,۰۰۱	۸۸۷,۵۴۰	-۸/۵۰٪	۲۵,۶۴۵,۲۵۶,۹۵۵	تنزیل تا سررسید
مشارکت لیزیینگ ایران و شرق ۱۰-۱۴۰۰۱۰	۲۱,۳۲۳	۱,۰۰۱,۰۰۰	۹۰۸,۴۲۲	-۹/۲۵٪	۱۹,۳۶۶,۷۷۱,۴۴۲	تنزیل تا سررسید
جمع					۸۸۷,۷۵۹,۲۸۷,۰۱۴	

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفولی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۱/۳۱		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	۷۱۵,۰۲۷,۴۰۹,۳۴۱	۷۱۵,۰۲۷,۴۰۹,۳۴۱	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۷/۱۵	جاری	۰۱۰۰۳۲۴۶۴۷۰۰۲	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۱۲/۷۹٪	۳۹۵,۴۴۴,۹۵۳,۵۴۶	۱,۱۶۱,۲۴۲,۷۴۳,۲۰۷	۱,۵۵۶,۶۸۶,۶۹۶,۷۵۳	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۵/۹۰٪	۱۸۲,۴۶۸,۶۷۸,۳۶۸	۹۳,۲۴۲,۰۹۴,۷۹۹	۰	۲۷۵,۷۱۰,۷۷۳,۱۶۷	۲۰	۱۳۹۸/۰۶/۰۴	کوتاه مدت	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۰/۰۰٪	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۴	جاری	۲۰۱-۳۷۸۹۰۸-۶۰۱	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۰/۰۹٪	۲,۷۹۹,۸۶۱,۲۶۵	۰	۲,۷۹۹,۴۶۱,۲۶۵	۴۰۰,۰۰۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۱۰/۰۱	کوتاه مدت	۴۷۰-۹۸۸۴۰۶-۶۰۹	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۱/۶۲٪	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۱	بلند مدت	۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۳/۷۰٪	۱۱۴,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۱۴,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۳	بلند مدت	۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱	سپرده بانکی نزد بانک پارسیان
۰/۰۷٪	۲,۲۵۸,۶۵۶,۹۵۲	۱۳۰,۹۴۴,۲۶۲,۴۰۰	۵۰۶,۰۷۹,۸۰۸,۰۲	۸۲,۵۹۴,۹۳۸,۵۵۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۱۱/۱۶	کوتاه مدت	۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶	سپرده بانکی نزد بانک صادرات
۰/۲۲٪	۶,۶۹۰,۲۹۹,۳۱۷	۰	۲,۸۱۵,۷۰۲,۷۴۶	۳,۸۷۴,۵۹۶,۵۷۱	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۸/۰۷/۰۷	کوتاه مدت	۱۱۳,۹۹۶۷,۶۶۹۱۴۷,۱	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۰/۸۱٪	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۲۵,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۰۷/۲۸	بلند مدت	۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۱	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۱/۶۲٪	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۰۹/۳۰	بلند مدت	۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۲	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۲/۸۹٪	۸۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۸۹,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۰	۱۳۹۸/۱۰/۰۳	بلند مدت	۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۳	سپرده بانکی نزد بانک گردشگری
۰/۰۰٪	۳۳۸,۲۴۸	۱۵۱,۷۵۲	۴۹,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۹/۰۲/۲۹	جاری	۱۲۶-۱۱-۱۳۲۰۰۷۸-۱	سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین
۰/۰۰٪	۱۵۲,۰۰۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۳۸,۰۰۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۱۹,۰۰۰	۰	۱۰ ماه شمار	۱۳۹۹/۰۲/۲۴	کوتاه مدت	۱۲۶-۸۴۰-۱۳۲۰۰۷۸-۱	سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین
۸/۰۹٪	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۲۰	۱۳۹۹/۰۲/۲۵	بلند مدت	۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۱	سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین
۳/۲۳٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۸	۱۳۹۹/۰۲/۳۱	بلند مدت	۰۴۰۱۳۵۳۸۵۸۰۰۱	سپرده بانکی نزد بانک آینده
۰/۰۰٪	۱۳۸,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۱۲,۰۰۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۱۵,۰۰۰	۰	۸ ماه شمار	۱۳۹۹/۰۲/۲۵	کوتاه مدت	۱۰۰۸۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۳۷۴۹	سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه
۳/۲۳٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۸	۱۳۹۹/۰۲/۲۷	بلند مدت	۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۸۸۱۲	سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه
۰/۰۰٪	۸۱۸,۲۴۸	۱۰۰,۰۰۰,۱۸۱,۷۵۲	۱۰۰,۰۰۰,۱۰۰,۰۰۰	۰	۸ ماه شمار	۱۳۹۹/۰۲/۲۷	کوتاه مدت	۷۰۰۸۴۳۱۶۶۸۴۷	سپرده بانکی نزد بانک شهر
۳/۲۳٪	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۸	۱۳۹۹/۰۲/۲۸	بلند مدت	۷۰۰۸۴۳۲۲۹۲۴	سپرده بانکی نزد بانک شهر
۰/۰۰٪	۰	۱۲,۰۰۰	۱۲,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۹/۰۲/۲۸	جاری	۱۰۰۸-۱۱-۰۴۰-۷۰۷۰۷۴۰۷۷	سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه
۴۷/۵۰٪	۱,۴۶۸,۷۱۳,۸۹۵,۹۴۴	۲,۵۵۰,۴۵۶,۹۰۵,۲۵۱	۳,۳۲۷,۹۳۹,۰۹۲,۹۰۷	۶۹۱,۲۳۱,۷۰۸,۲۸۸					جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورتیم

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

۴-۱ - سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

۱۳۹۹/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره						۱۳۹۹/۰۱/۳۱			پذیرفته شده در بورس یا فرابورس	نرخ شکست	نرخ سود علی الحساب	تاریخ سررسید	گواهی سپرده بانکی
خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد					
				تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده								
۴/۳۰٪	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰	۰	۰	۱۳۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	-	۱۰	۱۸	۱۳۹۹/۱۱/۲۸	اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله ۲۴ بانک صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد
۴/۳۰٪	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰	۰	۰	۱۳۰,۰۰۰	۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰					جمع

## صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

## ۲- در آمد حاصل از سرمایه گذاری ها

درصد از کل دارایی ها	درصد از کل درآمدها	مبلغ	یادداشت	شرح
۴/۴۵٪	۶۷/۶۲٪	۱۳۷,۷۳۲,۳۸۳,۶۲۵	۱-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
-۰/۲۱٪	-۳/۱۶٪	۶,۴۴۳,۱۰۸,۶۰۶-	۲-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
۲/۳۴٪	۳۵/۴۹٪	۷۲,۲۸۵,۴۱۸,۳۸۲	۳-۲	درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده
۰/۰۰٪	۰/۰۵٪	۱۱۱,۷۸۸,۷۳۳	۴-۲	سایر درآمدها
۶/۵۹٪	۱۰۰٪	۲۰۳,۶۸۶,۴۸۲,۱۳۴		جمع

**صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱**

**درآمد سود سهام**

۱۳۹۹/۰۲/۳۱			طی دوره			اطلاعات مجمع			نام سهام
خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	
۵,۱۱۱,۹۴۰	(۱۵۷,۵۶۰)	۵,۲۶۹,۵۰۰	۵,۱۱۱,۹۴۰	(۱۵۷,۵۶۰)	۵,۲۶۹,۵۰۰	۵۰۰	۱۰,۵۳۹	۱۳۹۹/۰۲/۲۸	تامین سرمایه بانک ملت
۱,۰۴۷,۵۵۶,۸۹۱	(۱۵۴,۹۸۱,۰۱۹)	۱,۲۰۲,۵۳۷,۹۱۰	۱,۰۴۷,۵۵۶,۸۹۱	(۱۵۴,۹۸۱,۰۱۹)	۱,۲۰۲,۵۳۷,۹۱۰	۴۹۰	۲,۴۵۴,۱۵۹	۱۳۹۹/۰۲/۰۷	سرمایه گذاری غدیر
۲,۸۱۵,۲۹۳	(۲۳۹,۱۰۷)	۳,۰۵۴,۴۰۰	۲,۸۱۵,۲۹۳	(۲۳۹,۱۰۷)	۳,۰۵۴,۴۰۰	۲,۳۰۰	۱,۳۲۸	۱۳۹۹/۰۲/۲۰	سیمان ساوه
<b>۱,۰۵۵,۴۸۴,۱۲۴</b>	<b>(۱۵۵,۳۷۷,۶۸۶)</b>	<b>۱,۲۱۰,۸۶۱,۸۱۰</b>	<b>۱,۰۵۵,۴۸۴,۱۲۴</b>	<b>(۱۵۵,۳۷۷,۶۸۶)</b>	<b>۱,۲۱۰,۸۶۱,۸۱۰</b>				جمع



**صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱**

**سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی**

۱۳۹۹/۰۲/۳۱			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				
۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	.	۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	.	۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	۱۰	۱۳۹۹/۱۱/۲۸	۱۳۹۹/۰۳/۲۸	اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله ۲۴ بانک صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد
۱۹۴,۶۳۳,۷۳۸	(۲,۶۲۶,۵۳۴)	۱۹۷,۲۶۰,۲۷۲	۱۹۴,۶۳۳,۷۳۸	(۲,۶۲۶,۵۳۴)	۱۹۷,۲۶۰,۲۷۲	۱۸	۱۴۰۰/۰۲/۲۷	۱۳۹۹/۰۲/۲۷	بلند مدت-۱۱۱۱۷۸۸۱۳-۹۱۵-۶۰-۱۰۰۸-خاورمیانه
۲,۹۱۷,۱۷۷,۷۰۰	(۶۳۰,۵۱۲)	۲,۹۱۷,۸۰۸,۲۱۲	۴۲۲,۸۵۶,۰۷۰	(۱,۸۰۱,۴۶۴)	۴۲۴,۶۵۷,۵۳۴	۲۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۸	۱۳۹۹/۰۲/۲۸	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۱-گردشگری
۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۹	.	۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۹	۸۴۵,۹۳۷,۲۲۴	(۳,۲۷۷,۷۴۴)	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۲۰	۱۳۹۹/۰۹/۳۰	۱۳۹۹/۰۲/۳۰	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۲-گردشگری
۷,۲۵۵,۸۲۴,۹۳۰	(۲,۲۵۷,۲۳۴)	۷,۲۵۸,۰۸۲,۱۶۴	۱,۵۱۳,۸۲۴,۷۳۲	(۶,۴۴۹,۲۴۰)	۱,۵۲۰,۲۷۳,۹۷۲	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۳	۱۳۹۹/۰۲/۰۳	بلند مدت-۱۱۳.۱۱۹۷.۶۶۹۱۴۷.۳-گردشگری
۸۱۰,۶۵۸,۶۵۸	(۱۱,۲۵۹,۱۴۸)	۸۲۱,۹۱۷,۸۰۶	۸۱۰,۶۵۸,۶۵۸	(۱۱,۲۵۹,۱۴۸)	۸۲۱,۹۱۷,۸۰۶	۲۰	۱۴۰۰/۰۲/۲۵	۱۳۹۹/۰۲/۲۵	بلند مدت-۱-۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-ایران زمین
۹,۲۸۲,۴۹۱,۷۰۶	(۲,۸۸۷,۷۴۶)	۹,۲۸۵,۳۷۹,۴۵۲	۱,۹۳۶,۶۸۰,۸۰۳	(۸,۳۵۰,۷۰۴)	۱,۹۴۴,۹۳۱,۵۰۷	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۳	۱۳۹۹/۰۲/۰۳	بلند مدت-۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۶-پارسیان
۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۹	(۴۶۵,۳۷۸)	۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۹	۸۴۵,۴۷۱,۹۴۶	(۳,۸۴۳,۱۲۲)	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۲۰	۱۳۹۹/۱۰/۰۱	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	بلند مدت-۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶-پارسیان
۱۴۷,۸۷۲,۲۴۵	(۷۲,۹۵۹)	۱۴۷,۹۴۵,۲۰۴	۱۴۷,۸۴۷,۹۲۵	(۹۷,۲۷۹)	۱۴۷,۹۴۵,۲۰۴	۱۸	۱۴۰۰/۰۲/۲۸	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	بلند مدت-۷۰۸۴۳۲۲۹۲۴-شهر
۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	.	۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	.	۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	۱۶	۱۴۰۱/۱۲/۲۰	۱۳۹۹/۰۳/۲۰	صکوک مریحه سایپا۱۱۳-۱۱۳ماهه ٪۱۶
۳,۹۸۳,۲۴۷,۳۵۲	.	۳,۹۸۳,۲۴۷,۳۵۲	۱,۳۸۸,۳۰۸,۸۰۲	.	۱,۳۸۸,۳۰۸,۸۰۲	۱۰	-	۱۳۹۹/۰۲/۱۶	کوتاه مدت-۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶-صادرات
۵,۲۱۴,۶۹۰	.	۵,۲۱۴,۶۹۰	۵,۲۱۴,۶۹۰	.	۵,۲۱۴,۶۹۰	۱۰	-	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	کوتاه مدت-۹۰۶-۹۸۸۴۰۶-۴۷۰-پارسیان
۵۷۰,۴۵۷,۴۸۴	.	۵۷۰,۴۵۷,۴۸۴	۳۹۷,۶۹۰,۲۸۵	.	۳۹۷,۶۹۰,۲۸۵	۱۷	۱۴۰۰/۰۸/۲۰	۱۳۹۹/۰۸/۲۰	مرایحه گندم ۲-واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
۲,۷۰۷,۱۱۲,۳۴۷	.	۲,۷۰۷,۱۱۲,۳۴۷	۵۸۷,۵۶۹,۳۰۳	.	۵۸۷,۵۶۹,۳۰۳	۱۷	۱۴۰۰/۱۰/۲۶	۱۳۹۹/۰۴/۲۶	مشارکت دولت-باشرايط خاص ۱۴۰۰۱۰
۳۶۷,۵۵۷,۱۱۱	.	۳۶۷,۵۵۷,۱۱۱	۳۲۵,۹۷۹,۰۱۴	.	۳۲۵,۹۷۹,۰۱۴	۱۸	۱۴۰۰/۱۰/۲۵	۱۳۹۹/۰۳/۲۵	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
۷۴,۸۴۶,۳۷۳,۸۰۶	.	۷۴,۸۴۶,۳۷۳,۸۰۶	۶,۱۵۳,۷۵۱,۳۴۰	.	۶,۱۵۳,۷۵۱,۳۴۰	۱۷.۹	۱۴۰۱/۰۸/۱۸	۱۳۹۹/۰۸/۱۸	منفعت دولت ۵-ش-خاص سایر ۱۰۸
۸۶۸,۶۶۷,۳۹۸	.	۸۶۸,۶۶۷,۳۹۸	۶,۷۷۶	.	۶,۷۷۶	۱۰	-	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	کوتاه مدت-۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵-آینده
۳۸,۰۴۶,۴۱۱,۶۲۰	(۱۳,۸۰۵,۸۴۹)	۳۸,۰۶۰,۲۱۷,۴۶۹	۳۰,۷۵,۹۲۰,۶۵۲	(۱۴,۰۲۴,۹۹۰)	۳۰,۸۹,۹۴۵,۶۴۲	۲۰	-	۱۳۹۹/۰۲/۱۴	کوتاه مدت-۱۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹-آینده
۲۱,۴۵۶,۱۷۲	.	۲۱,۴۵۶,۱۷۲	۲۱,۴۵۶,۱۷۲	.	۲۱,۴۵۶,۱۷۲	۱۰	-	۱۳۹۹/۰۲/۰۱	کوتاه مدت-۱۱۳.۹۹۶۷.۶۶۹۱۴۷.۱-گردشگری
۲۹,۸۹۷	.	۲۹,۸۹۷	.	.	.	۱۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۲	۱۳۹۹/۰۶/۲۲	منفعت صبا آروند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
۱۵۰,۸۹۹,۳۶۸,۶۲۹	(۳۴,۰۰۵,۳۶۰)	۱۵۰,۹۳۳,۳۷۳,۹۸۹	۱۹,۲۷۴,۳۸۲,۷۹۲	(۵۱,۷۳۰,۲۲۵)	۱۹,۳۲۶,۱۱۳,۰۱۷				جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				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	
۴۹۸,۹۷۹,۲۱۷	۳,۹۵۵,۴۶۰,۹۰۲	۴,۴۵۴,۴۴۰,۱۱۹	۲۷۵,۰۰۰	.	.	.	.	ارتباطات سیار
.	۵,۰۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۹۴	.	۵,۰۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۹۴,۰۰۰,۰۰۰	۵,۰۹۴	اسناد خزانه-م ۲۰بوجه ۹۸-۲۰۸۰۶
۱,۲۴۹,۲۰۳,۵۲۷	۱۷,۲۳۷,۵۱۶,۵۹۰	۱۸,۴۸۶,۷۲۰,۱۱۷	۲,۶۹۳,۰۰۰	۲,۰۰۴,۳۵۹,۹۷۳	۲,۸۶۹,۷۲۷,۳۰۱	۴,۸۷۴,۰۸۷,۲۷۴	۳۰۰,۰۰۰	بانک ملت
۱,۱۳۸,۳۵۲	۶۸۷,۴۰۴	۱,۸۲۵,۷۵۶	۵۰	.	.	.	.	ذوب روی اصفهان
۲,۹۲۳,۴۰۰,۴۶۸	۱۴,۷۶۹,۵۲۵,۸۴۰	۱۷,۶۹۲,۹۳۶,۳۰۸	۴,۳۰۵,۸۴۱	۹۹۳,۳۶۰,۹۶۱	۱,۰۲۴,۱۵۰,۲۸۵	۲,۰۱۷,۵۱۱,۲۴۶	۲۶۵,۰۰۰	سرمایه گذاری غدیر
۷۹۰,۸۲۱,۲۰۸	۱۶,۹۹۹,۴۲۹,۱۳۰	۱۷,۷۹۰,۲۵۰,۳۳۸	۳,۴۲۲	.	.	.	.	سهام آشنا
۶,۰۳۵,۳۴۴,۱۷۵	۱۰,۱۷۴,۷۹۰,۹۴۵	۱۶,۲۱۰,۱۳۵,۱۲۰	۱۴۱,۲۴۱	۵,۹۶۱,۸۷۵,۰۵۶	۸,۷۴۹,۵۴۲,۵۵۳	۱۴,۷۱۱,۴۱۷,۶۰۹	۱۱۸,۸۳۵	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
۳۸۴,۲۵۸,۱۵۴	۱,۹۵۵,۷۳۸,۸۱۸	۲,۳۳۹,۹۹۶,۹۷۲	۴۳۰,۰۰۰	.	.	.	.	فولاد کاوه
۷,۹۲۳,۰۵۸,۱۷۶	۲۱,۷۸۳,۴۶۴,۲۳۴	۲۹,۷۰۶,۵۲۲,۴۱۰	۴,۸۸۵,۰۰۰	۶,۰۸۶,۸۲۸,۴۱۶	۶,۰۳۰,۱۳۲,۵۰۶	۱۲,۱۱۶,۹۶۰,۹۲۲	۱,۲۵۷,۰۰۰	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
۱,۶۲۷,۹۳۴,۰۸۰	۳,۲۹۲,۳۳۴,۲۳۷	۴,۹۲۰,۲۶۸,۳۱۷	۵۲۰,۰۰۰	۹۵۸,۵۷۰,۳۱۵	۱,۰۴۱,۲۱۳,۱۳۰	۱,۹۹۹,۷۸۳,۴۴۵	۱۶۵,۰۰۰	پتروشیمی خلیج فارس
۴,۷۷۱,۱۶۴,۹۲۹	۱۵,۰۱۹,۴۸۸,۳۳۱	۱۹,۷۹۰,۶۵۳,۱۶۰	۲,۲۰۰,۰۰۰	۴,۶۷۸,۳۱۱,۵۶۹	۵,۱۵۱,۵۷۴,۹۳۴	۹,۸۲۹,۸۸۶,۵۰۲	۶۰۰,۰۰۰	چادرملو
۱,۷۳۸,۰۴۸	۲,۰۵۱,۱۲۶	۳,۷۸۹,۱۷۴	۳۶۹	.	.	.	.	گروه توسعه مالی مهر آیندگان
۲۹,۲۱۴,۵۰۳,۵۸۵	۱۲۷,۰۰۵,۶۳۲,۱۳۴	۱۶۶,۲۶۵,۱۳۵,۷۱۹	۲۱,۰۰۹,۰۲۷	۲۰,۶۸۳,۳۰۶,۲۹۰	۲۹,۹۶۰,۳۴۰,۷۰۹	۵۰,۶۴۳,۶۴۶,۹۹۹	۲,۷۱۰,۹۲۹	جمع

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

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				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	
۱۱,۵۷۵,۰۶۱,۳۱۰	۱۴,۶۱۸,۳۲۰,۷۰۱	۲۶,۱۹۳,۳۸۱,۹۱۱	۲,۹۲۹,۱۵۹	۳,۳۹۹,۱۰۶,۴۹۲	۲۲,۷۹۴,۲۷۵,۴۱۹	۲۶,۱۹۳,۳۸۱,۹۱۱	۲,۹۲۹,۱۵۹	سرمایه گذاری غدیر
۱۳,۵۰۰,۴۱۱,۲۰۰	۱۹,۸۱۸,۴۰۲,۹۸۷	۳۳,۳۱۸,۸۱۴,۱۸۷	۲,۰۵۱,۰۰۰	۸,۷۷۴,۱۵۲,۳۶۸	۲۴,۵۴۴,۶۶۱,۹۱۹	۳۳,۳۱۸,۸۱۴,۱۸۷	۲,۰۵۱,۰۰۰	بانک ملت
۷,۲۱۶,۶۸۵,۰۰۶	۸,۸۴۳,۰۵۹,۳۴۱	۱۶,۰۵۹,۷۴۴,۳۴۷	۱,۷۴۴,۰۰۰	۲,۳۷۷,۷۵۰,۳۴۶	۱۳,۷۸۱,۹۹۴,۰۰۱	۱۶,۰۵۹,۷۴۴,۳۴۷	۱,۷۴۴,۰۰۰	فولاد مبارکه
۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	۱۹,۶۴۴,۶۲۰,۳۰۱	۲۲,۱۱۹,۸۴۱,۰۷۷	۱,۵۷۰,۰۰۰	۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	۱۹,۶۴۴,۶۲۰,۳۰۱	۲۲,۱۱۹,۸۴۱,۰۷۷	۱,۵۷۰,۰۰۰	گروه بهمن
۱۱,۶۱۳,۱۸۹,۳۴۰	۱۵,۷۷۹,۹۹۴,۲۸۹	۲۷,۳۹۳,۱۸۳,۵۲۹	۱,۵۱۶,۰۰۰	۶,۹۸۱,۴۶۹,۳۶۲	۲۰,۴۱۱,۷۱۴,۱۶۷	۲۷,۳۹۳,۱۸۳,۵۲۹	۱,۵۱۶,۰۰۰	توسعه صنایع بهشهر
۹,۲۵۰,۲۹۹,۳۴۱	۱۲,۳۸۵,۵۷۶,۰۹۵	۲۱,۶۳۵,۸۷۵,۳۳۶	۱,۴۲۳,۲۳۶	۲,۹۳۸,۵۲۶,۹۳۵	۱۸,۶۹۷,۳۴۸,۴۰۱	۲۱,۶۳۵,۸۷۵,۳۳۶	۱,۴۲۳,۲۳۶	پتروشیمی خلیج فارس
۷,۴۳۶,۹۴۷,۰۹۳	۹,۸۳۰,۰۷۷,۵۰۶	۱۷,۲۶۷,۰۲۴,۵۹۹	۱,۱۳۲,۰۰۰	۴,۴۲۲,۳۸۶,۹۴۲	۱۲,۸۴۴,۶۳۷,۶۵۷	۱۷,۲۶۷,۰۲۴,۵۹۹	۱,۱۳۲,۰۰۰	چادرملو
۵,۱۴۰,۴۶۵,۲۰۴	۱۲,۶۵۷,۳۳۵,۴۹۲	۱۷,۷۹۷,۷۹۰,۶۹۶	۶۰۷,۶۰۰	۲,۵۳۷,۹۹۷,۱۹۱	۱۵,۲۵۹,۷۹۳,۵۰۵	۱۷,۷۹۷,۷۹۰,۶۹۶	۶۰۷,۶۰۰	کشتیرانی ایران
۱۵,۴۶۲,۱۹۶,۷۶۸	۱۵,۰۴۸,۱۰۸,۴۱۵	۳۰,۵۱۰,۳۰۵,۱۸۳	۵۳۸,۹۵۰	۷,۵۸۰,۷۳۰,۲۳۳	۲۲,۹۲۹,۵۷۴,۹۵۰	۳۰,۵۱۰,۳۰۵,۱۸۳	۵۳۸,۹۵۰	دارویی تامین
(۶۶,۱۵۵,۷۲۰,۲۴۵)	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۳۳,۸۴۴,۲۷۹,۷۵۵	۴۰۰,۰۰۰	(۳۴,۳۶۳,۳۷۶,۰۱۵)	۳۶۸,۲۰۷,۶۵۵,۷۷۰	۳۳۳,۸۴۴,۲۷۹,۷۵۵	۴۰۰,۰۰۰	منفعت دولت ۵-ش-خاص سایر ۱۰۸
۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۲۴۴,۱۳۵,۰۷۵,۰۵۷	۲۴۴,۳۴۹,۳۶۵,۶۴۹	۳۹۵,۴۵۹	۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۲۴۴,۱۳۵,۰۷۵,۰۵۷	۲۴۴,۳۴۹,۳۶۵,۶۴۹	۳۹۵,۴۵۹	اسناد خزانه م-۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶
۲,۳۸۲,۶۷۹,۲۰۵	۳,۲۷۲,۳۷۴,۳۶۵	۵,۶۵۵,۰۵۳,۴۷۰	۳۷۹,۴۶۲	۲,۱۴۸,۰۶۴,۴۳۳	۳,۵۰۶,۹۸۹,۰۳۷	۵,۶۵۵,۰۵۳,۴۷۰	۳۷۹,۴۶۲	سرمایه گذاری تامین اجتماعی
(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	۱۲,۷۷۱,۵۹۸,۵۷۱	۱۱,۸۳۲,۴۱۶,۹۳۵	۳۱۸,۰۰۰	(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	۱۲,۷۷۱,۵۹۸,۵۷۱	۱۱,۸۳۲,۴۱۶,۹۳۵	۳۱۸,۰۰۰	انفورماتیک
(۶۳۸,۶۳۰,۶۹۱)	۱۲,۳۷۷,۳۲۱,۱۰۸	۱۲,۷۳۸,۶۹۰,۴۱۷	۲۰۹,۷۹۷	(۷۳۱,۰۸۱,۰۷۸)	۱۳,۴۶۹,۷۷۱,۴۹۵	۱۲,۷۳۸,۶۹۰,۴۱۷	۲۰۹,۷۹۷	پدیده شیمی قرن
(۸۴۰,۵۴۰,۹۴۳)	۱۰۰,۸۴۹,۶۸۸,۶۲۹	۱۰۰,۰۰۹,۱۴۷,۶۸۶	۱۳۴,۲۶۳	۵,۵۸۳,۳۵۶,۶۵۳	۹۴,۴۲۵,۷۹۱,۰۳۳	۱۰۰,۰۰۹,۱۴۷,۶۸۶	۱۳۴,۲۶۳	اسناد خزانه م-۷ بودجه ۹۸-۰۰۷۱۹
(۳,۳۲۹,۰۳۳,۶۶۵)	۶۱,۵۷۱,۹۰۴,۴۹۰	۵۸,۲۴۲,۸۷۰,۸۲۵	۷۸۰,۳۳	(۱,۵۲۶,۱۹۴,۱۰۹)	۵۹,۷۶۹,۰۶۴,۹۳۴	۵۸,۲۴۲,۸۷۰,۸۲۵	۷۸۰,۳۳	اسناد خزانه م-۲۳ بودجه ۹۷-۰۰۸۲۴
(۳,۲۲۳,۷۲۳,۴۶۶)	۵۱,۲۸۶,۰۸۰,۳۰۵	۴۸,۰۶۲,۳۵۶,۸۱۹	۷۰,۳۰۰	(۲,۵۰۰,۴۳۸,۷۲۸)	۵۰,۵۶۲,۷۹۵,۵۴۷	۴۸,۰۶۲,۳۵۶,۸۱۹	۷۰,۳۰۰	اسناد خزانه م-۱۴ بودجه ۹۸-۱۰۳۱۸
(۲۲۰,۶۴۶,۷۵۳)	۴۶,۳۴۴,۳۱۵,۲۸۹	۴۶,۱۲۳,۶۶۸,۵۳۶	۶۸,۱۱۸	۳,۵۴۲,۹۷۵,۸۳۷	۴۲,۵۸۰,۶۹۲,۶۹۹	۴۶,۱۲۳,۶۶۸,۵۳۶	۶۸,۱۱۸	اسناد خزانه م-۱۸ بودجه ۹۸-۱۰۶۱۴
(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۵۲,۷۰۸,۳۲۷,۹۵۷	۴۷,۹۵۴,۲۷۵,۶۳۶	۶۷,۱۱۹	(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۵۲,۷۰۸,۳۲۷,۹۵۷	۴۷,۹۵۴,۲۷۵,۶۳۶	۶۷,۱۱۹	اسناد خزانه م-۱۲ بودجه ۹۸-۰۰۱۱۱
۳۷۸,۵۳۰,۰۱۴	۲۴۷,۰۱۶,۶۴۳	۶۲۵,۵۴۶,۶۵۷	۵۶,۲۴۸	۱۳۹,۷۹۰,۶۰۲	۴۸۵,۷۵۶,۰۵۵	۶۲۵,۵۴۶,۶۵۷	۵۶,۲۴۸	پتروشیمی تندگویان
(۱۴,۳۷۵,۰۰۰)	۵۰,۰۰۵,۳۱۲,۵۰۰	۴۹,۹۹۰,۹۳۷,۵۰۰	۵۰,۰۰۰	(۱۴,۳۷۵,۰۰۰)	۵۰,۰۰۵,۳۱۲,۵۰۰	۴۹,۹۹۰,۹۳۷,۵۰۰	۵۰,۰۰۰	صکوک مریجه سانیا ۱۱۲-۳ ماهه ۱۶٪
(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	۴,۹۴۴,۱۴۵,۰۷۵	۴,۹۰۷,۹۷۴,۴۹۴	۵۰,۰۰۰	(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	۴,۹۴۴,۱۴۵,۰۷۵	۴,۹۰۷,۹۷۴,۴۹۴	۵۰,۰۰۰	پارس دارو
۷۱,۹۹۵,۸۵۴	۳۶,۰۶۹,۵۶۱,۳۰۸	۳۶,۱۴۱,۵۵۷,۱۶۲	۴۸,۶۲۱	۱,۹۰۳,۱۷۹,۲۹۶	۳۴,۲۳۸,۳۷۷,۸۶۶	۳۶,۱۴۱,۵۵۷,۱۶۲	۴۸,۶۲۱	اسناد خزانه م-۲۱ بودجه ۹۷-۰۰۷۲۸
۱,۲۲۳,۷۷۹,۸۲۶	۳۷,۳۱۶,۸۴۰,۴۷۰	۳۸,۵۴۰,۶۲۰,۲۹۶	۴۸,۴۶۵	۳,۱۳۰,۲۰۵,۸۸۸	۳۵,۴۱۰,۴۱۴,۴۰۸	۳۸,۵۴۰,۶۲۰,۲۹۶	۴۸,۴۶۵	اسناد خزانه م-۲۲ بودجه ۹۷-۰۰۴۲۸

صندوق سرمایه گذاری دارا الگورنتم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				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	
(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۳۰,۶۱۱,۴۱۵,۲۸۵	۲۷,۸۲۰,۳۴۶,۱۳۵	۴۱,۳۹۱	(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۳۰,۶۱۱,۴۱۵,۲۸۵	۲۷,۸۲۰,۳۴۶,۱۳۵	۴۱,۳۹۱	اسناد خزانه-م ۱۷ بودجه ۹۸-۱۰۵۱۲
(۱,۵۴۱,۶۵۴,۳۳۲)	۳۰,۹۷۴,۶۳۸,۴۶۱	۲۹,۴۳۲,۹۸۴,۱۲۹	۴۰,۷۳۲	(۲۴۸,۳۲۱,۴۱۸)	۲۹,۶۸۱,۳۰۵,۵۴۷	۲۹,۴۳۲,۹۸۴,۱۲۹	۴۰,۷۳۲	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۱۰۰۰۶
(۲,۹۳۸,۶۰۳,۱۷۷)	۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰	۳۴,۷۱۲,۱۴۷,۲۸۳	۴۰,۰۰۰	۱,۶۱۵,۹۹۹,۳۹۹	۳۳,۰۹۶,۱۴۷,۸۸۴	۳۴,۷۱۲,۱۴۷,۲۸۳	۴۰,۰۰۰	مشارکت دولت-بشرایط خاص ۱۴۰۰۱۰
(۲,۴۲۹,۵۳۰,۹۳۶)	۲۸,۰۷۴,۷۸۷,۸۹۱	۲۵,۶۴۵,۲۵۶,۹۵۵	۲۸,۹۰۰	۹۲۰,۹۴۵,۹۳۹	۲۴,۷۲۴,۳۱۱,۰۱۶	۲۵,۶۴۵,۲۵۶,۹۵۵	۲۸,۹۰۰	مرابحه گندم-۲ واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۲۱,۷۶۴,۲۸۰,۳۰۹	۲۰,۱۱۲,۰۸۶,۰۲۴	۲۶,۰۰۰	(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۲۱,۷۶۴,۲۸۰,۳۰۹	۲۰,۱۱۲,۰۸۶,۰۲۴	۲۶,۰۰۰	اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۹۸-۰۰۴۳۲
(۱,۵۳۸,۶۴۹,۰۸۱)	۲۰,۹۰۵,۴۲۰,۵۲۳	۱۹,۳۶۶,۷۷۱,۴۴۲	۲۱,۳۳۳	۶۸۸,۵۸۱,۱۵۵	۱۸,۶۷۸,۱۹۰,۲۸۷	۱۹,۳۶۶,۷۷۱,۴۴۲	۲۱,۳۳۳	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
۱۹۲,۰۴۲,۸۷۶	۱۱,۳۰۷,۰۵۰,۶۱۵	۱۱,۴۹۹,۰۹۳,۴۹۱	۱۴,۸۴۰	۲۸۱,۳۷۸,۴۳۶	۱۱,۳۱۷,۷۱۵,۰۵۵	۱۱,۴۹۹,۰۹۳,۴۹۱	۱۴,۸۴۰	اسناد خزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۰۰۴۰۷
۱۷۹,۸۷۸,۷۹۱	۱۰,۰۷۱,۹۴۶,۰۴۹	۱۰,۲۵۱,۸۲۴,۸۴۰	۱۳,۴۸۰	۳۳۲,۷۳۱,۵۷۴	۹,۹۰۹,۰۹۳,۲۶۶	۱۰,۲۵۱,۸۲۴,۸۴۰	۱۳,۴۸۰	اسناد خزانه-م ۱۳ بودجه ۹۷-۰۰۵۱۸
۷۴,۱۷۶,۱۹۲	۳۵,۹۳۰,۷۷۵	۱۱۰,۱۰۶,۹۶۷	۱۰,۵۳۹	۳۴,۰۲۶,۷۴۲	۷۶,۰۸۰,۲۲۴	۱۱۰,۱۰۶,۹۶۷	۱۰,۵۳۹	تامین سرمایه بانک ملت
۹۹,۴۳۷,۰۴۴	۷۲,۳۵۷,۷۱۲	۱۷۱,۷۹۴,۷۵۶	۵,۵۰۰	۳۵,۴۸۸,۳۳۹	۱۳۶,۳۰۶,۴۲۷	۱۷۱,۷۹۴,۷۵۶	۵,۵۰۰	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر
۲۲,۲۵۸,۸۶۹,۳۱۶	۱۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶	۳۳,۳۷۷,۳۳۶,۵۹۲	۳,۸۲۴	۹,۹۹۵,۸۰۹,۸۰۸	۳۳,۳۸۱,۵۲۶,۷۸۴	۳۳,۳۷۷,۳۳۶,۵۹۲	۳,۸۲۴	صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر
۴,۴۵۶,۸۸۲,۰۸۵	۱۰۰,۱۶۵,۷۶۹,۹۷۵	۱۴,۴۷۳,۴۵۹,۰۶۰	۱,۹۰۰	۲,۴۹۹,۴۴۵,۳۱۰	۱۱,۹۷۴,۰۱۳,۷۵۰	۱۴,۴۷۳,۴۵۹,۰۶۰	۱,۹۰۰	سکه تمام بهار تحولی از روزه صادرات
۳۳,۳۵۹,۰۶۵	۳۱,۲۹۰,۴۶۷	۶۴,۶۴۹,۵۳۲	۱,۳۲۸	۱۷,۹۹۶,۶۶۳	۴۶,۶۵۲,۸۶۹	۶۴,۶۴۹,۵۳۲	۱,۳۲۸	سیمان ساوه
۱۴,۲۷۱,۷۱۰	۲۶,۱۹۷,۶۷۸	۴۰,۴۶۹,۳۸۸	۱,۳۱۳	۶,۸۵۶,۶۶۳	۳۳,۶۱۲,۷۲۵	۴۰,۴۶۹,۳۸۸	۱,۳۱۳	صنعتی دوده فام
۷,۲۰۱,۱۶۵	۹,۷۵۷,۶۹۰	۱۶,۹۵۸,۸۵۵	۸۱۱	۴,۰۹۰,۹۰۰	۱۲,۸۶۷,۹۵۵	۱۶,۹۵۸,۸۵۵	۸۱۱	سرمایه گذاری صبا نامین
۱,۹۸۳,۹۹۳	۱,۱۲۳,۹۵۷	۳,۱۰۷,۹۵۰	۳۸	۱۹۷,۰۸۲	۲,۹۱۱,۰۷۵	۳,۱۰۸,۱۵۷	۳۸	کلر پارس
۱۴,۵۵۳	۱۷۵,۴۴۵	۱۸۹,۹۹۸	۱۴	۱۴,۵۵۳	۱۷۵,۲۳۸	۱۸۹,۷۹۱	۱۴	شیرپاستوریزه نگاه گیلان
(۴۰,۷۸)	۵۶۵,۳۹۷	۵۶۱,۳۱۹	۱۴	(۴۰,۷۸)	۵۶۵,۳۹۷	۵۶۱,۳۱۹	۱۴	مجتمع صنایع لاستیک یزد
-	-	-	-	(۵,۷۹۰,۶۵۶,۷۵۸)	۵,۷۹۰,۶۵۶,۷۵۸	-	-	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
۲۲,۲۱۶,۰۸۷,۵۵۹	۱,۴۵۶,۱۹۷,۷۷۹,۹۶۶	۱,۴۷۸,۴۱۳,۸۶۷,۵۲۵	۱۶,۱۳۷,۷۷۷	۱۹,۱۴۵,۶۵۱,۱۴۳	۱,۴۵۹,۲۶۸,۲۱۶,۳۸۲	۱,۴۷۸,۴۱۳,۸۶۷,۵۲۵	۱۶,۱۳۷,۷۷۷	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 الگوریتم  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۲/۳۱					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
۷/۲۴٪	۱۴,۷۴۹,۶۱۴,۷۲۷	۱,۲۴۹,۲۰۳,۵۲۷	۱۳,۵۰۰,۴۱۱,۲۰۰	-	۵/۲۹٪	۱۰,۷۷۸,۵۱۲,۲۴۱	۲,۰۰۴,۳۵۹,۹۷۳	۸,۷۷۴,۱۵۲,۲۶۸	-	بانک ملت
-۰/۰۲٪	(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	.	(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	.	-۰/۰۲٪	(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	.	(۳۶,۱۷۰,۵۸۱)	.	پارس دارو
-۰/۱۹٪	۳۷۸,۵۳۰,۰۱۴	.	۳۷۸,۵۳۰,۰۱۴	.	-۰/۰۷٪	۱۳۹,۷۹۰,۶۰۲	.	۱۳۹,۷۹۰,۶۰۲	.	پتروشیمی تندگوین
-۰/۳۱٪	(۶۳۸,۶۳۰,۶۹۱)	.	(۶۳۸,۶۳۰,۶۹۱)	.	-۰/۳۶٪	(۷۳۱,۰۸۱,۰۷۸)	.	(۷۳۱,۰۸۱,۰۷۸)	.	پدیده شیمی قرن
-۰/۰۴٪	۷۹,۴۴۵,۶۹۲	.	۷۴,۱۷۶,۱۹۲	۵,۲۶۹,۵۰۰	-۰/۰۲٪	۳۹,۲۹۶,۲۴۳	.	۳۴,۰۲۶,۷۴۳	۵,۲۶۹,۵۰۰	تامین سرمایه بانک ملت
۵/۷۰٪	۱۱,۶۱۳,۱۸۹,۲۴۰	.	۱۱,۶۱۳,۱۸۹,۲۴۰	.	۳/۴۳٪	۶,۹۸۱,۴۶۹,۳۶۲	.	۶,۹۸۱,۴۶۹,۳۶۲	.	توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)
-۰/۴۶٪	(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	.	(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	.	-۰/۴۶٪	(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	.	(۹۳۹,۱۸۱,۶۳۶)	.	خدمات انفورماتیک
۱/۱۷٪	۲,۳۸۲,۶۷۹,۲۰۵	.	۲,۳۸۲,۶۷۹,۲۰۵	.	۱/۰۵٪	۲,۱۴۸,۰۶۴,۴۳۳	.	۲,۱۴۸,۰۶۴,۴۳۳	.	سرمایه گذاری تامین اجتماعی
۷/۵۹٪	۱۵,۴۶۲,۱۹۶,۷۶۸	.	۱۵,۴۶۲,۱۹۶,۷۶۸	.	۳/۷۲٪	۷,۵۸۰,۷۳۰,۲۳۳	.	۷,۵۸۰,۷۳۰,۲۳۳	.	سرمایه گذاری دارویی تامین
-۰/۰۰٪	۷,۲۰۱,۱۶۵	.	۷,۲۰۱,۱۶۵	.	-۰/۰۰٪	۴,۰۹۰,۹۰۰	.	۴,۰۹۰,۹۰۰	.	سرمایه گذاری صبا تامین
۷/۷۱٪	۱۵,۷۰۰,۹۹۹,۵۸۸	۲,۹۲۳,۴۰۰,۴۶۸	۱۱,۷۷۵,۰۶۱,۲۱۰	۱,۲۰۲,۵۳۷,۹۱۰	۲/۷۵٪	۵,۵۹۵,۰۰۵,۳۶۳	۹۹۳,۳۶۰,۹۶۱	۳,۳۹۹,۱۰۶,۴۹۲	۱,۲۰۲,۵۳۷,۹۱۰	سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)
-۰/۰۵٪	۹۹,۴۳۷,۰۴۴	.	۹۹,۴۳۷,۰۴۴	.	-۰/۰۲٪	۳۵,۴۸۸,۳۲۹	.	۳۵,۴۸۸,۳۲۹	.	سرمایه گذاری کشاورزی کوثر
-۰/۰۲٪	۳۶,۴۱۳,۴۶۵	.	۳۳,۳۵۹,۰۶۵	۳,۰۵۴,۴۰۰	-۰/۰۱٪	۲۱,۰۵۱,۰۶۳	.	۱۷,۹۹۶,۶۶۳	۳,۰۵۴,۴۰۰	سیمان ساوه
-۰/۰۰٪	۱۴,۵۵۳	.	۱۴,۵۵۳	.	-۰/۰۰٪	۱۴,۵۵۳	.	۱۴,۵۵۳	.	شیرپاستوریزه پگاه گیلان
۵/۳۴٪	۱۰,۸۷۸,۲۳۳,۳۲۱	۱,۶۲۷,۹۳۴,۰۸۰	۹,۲۵۰,۲۹۹,۲۴۱	.	۱/۹۱٪	۳,۸۹۷,۰۹۷,۲۵۰	۹۵۸,۵۷۰,۳۱۵	۲,۹۳۸,۵۲۶,۹۳۵	.	صنایع پتروشیمی خلیج فارس
۱۰/۹۳٪	۲۲,۲۵۸,۸۶۹,۲۱۶	.	۲۲,۲۵۸,۸۶۹,۲۱۶	.	۴/۹۱٪	۹,۹۹۵,۸۰۹,۸۰۸	.	۹,۹۹۵,۸۰۹,۸۰۸	.	صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر
-۰/۰۱٪	۱۴,۲۷۱,۷۱۰	.	۱۴,۲۷۱,۷۱۰	.	-۰/۰۰٪	۶,۸۵۶,۶۶۳	.	۶,۸۵۶,۶۶۳	.	صنعتی دوده فام
۲/۹۶٪	۶,۰۳۵,۳۴۴,۱۷۵	۶,۰۳۵,۳۴۴,۱۷۵	.	.	-۰/۰۸٪	۱۷۱,۲۱۸,۲۹۸	۵,۹۶۱,۸۷۵,۰۵۶	(۵,۷۹۰,۶۵۶,۷۵۸)	.	فروشگاههای زنجیره ای افق کوروش
۷/۴۳٪	۱۵,۱۳۹,۷۴۳,۱۸۲	۷,۹۲۳,۰۵۸,۱۷۶	۷,۲۱۶,۶۸۵,۰۰۶	.	۴/۱۱٪	۸,۳۶۴,۵۷۸,۶۶۲	۶,۰۸۶,۸۲۸,۴۱۶	۲,۲۷۷,۷۵۰,۲۴۶	.	فولاد مبارکه اصفهان
۲/۶۳٪	۵,۳۶۴,۳۷۹,۸۸۱	۲۲۳,۹۱۴,۶۷۷	۵,۱۴۰,۴۶۵,۲۰۴	.	۱/۳۵٪	۲,۵۳۷,۹۹۷,۱۹۱	.	۲,۵۳۷,۹۹۷,۱۹۱	.	کشتیرانی جمهوری اسلامی ایران
-۰/۰۰٪	۱,۹۸۳,۹۹۳	.	۱,۹۸۳,۹۹۳	.	-۰/۰۰٪	۱۹۷,۰۸۲	.	۱۹۷,۰۸۲	.	کلر پارس
۱/۲۳٪	۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	.	۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	.	۱/۲۲٪	۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	.	۲,۴۷۵,۲۲۰,۷۷۶	.	گروه بهمن
-۰/۰۰٪	(۴۰,۷۸)	.	(۴۰,۷۸)	.	-۰/۰۰٪	(۴۰,۷۸)	.	(۴۰,۷۸)	.	مجتمع صنایع لاستیک یزد
۵/۹۹٪	۱۲,۲۰۸,۱۱۲,۰۲۲	۴,۷۷۱,۱۶۴,۹۲۹	۷,۴۳۶,۹۴۷,۰۹۳	.	۴/۴۷٪	۹,۱۰۰,۶۹۸,۵۱۱	۴,۶۷۸,۳۱۱,۵۶۹	۴,۴۲۲,۳۸۶,۹۴۲	.	معدنی و صنعتی چادر ملو
-۰/۰۰٪	۱,۱۳۸,۳۵۲	۱,۱۳۸,۳۵۲	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	ذوب روی اصفهان
-۰/۰۹٪	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	۱۸۶,۴۰۸,۶۰۵	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	س. نفت و گاز و پتروشیمی تامین
-۰/۳۹٪	۷۹۰,۸۲۱,۲۰۸	۷۹۰,۸۲۱,۲۰۸	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	سهام آشنا
-۰/۳۴٪	۴۹۸,۹۷۹,۲۱۷	۴۹۸,۹۷۹,۲۱۷	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	شرکت ارتباطات سیار ایران
۱/۱۱٪	۲,۲۵۰,۹۳۸,۲۴۴	۲,۲۵۰,۹۳۸,۲۴۴	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	شرکت مخابرات ایران
-۰/۱۹٪	۳۸۴,۲۵۸,۱۵۴	۳۸۴,۲۵۸,۱۵۴	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	فولاد کاوه جنوب کیش
-۰/۰۰٪	۱,۷۳۸,۰۴۸	۱,۷۳۸,۰۴۸	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	گروه توسعه مالی مهر آیدگان
-۰/۱۷٪	۳۴۶,۲۰۹,۰۴۶	۳۴۶,۲۰۹,۰۴۶	.	.	-۰/۰۰٪	.	.	.	.	ملی صنایع مس ایران
۶۷/۶۲٪	۱۳۷,۳۳۲,۳۸۳,۶۲۵	۲۹,۲۱۴,۵۱۰,۹۰۶	۱۰۷,۱۱۷,۸۷۲,۷۱۹	۱,۲۱۰,۸۶۱,۸۱۰	۳۳/۴۷٪	۶۸,۱۶۶,۷۵۰,۱۹۰	۲۰,۶۸۳,۳۰۶,۲۹۰	۴۶,۲۷۲,۵۸۲,۰۹۰	۱,۲۱۰,۸۶۱,۸۱۰	جمع

**صندوق سرمایه گذاری دارا الگورنتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱**

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

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				طی دوره				
جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	سهام
(۱,۵۴۱,۶۵۴,۳۳۲)	۰	(۱,۵۴۱,۶۵۴,۳۳۲)	۰	(۲۴۸,۳۲۱,۴۱۸)	۰	(۲۴۸,۳۲۱,۴۱۸)	۰	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۰۰۱۰۰۶
(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۰	(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۰	(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۰	(۴,۷۵۴,۰۵۲,۳۲۱)	۰	اسناد خزانه-م ۱۲ بودجه ۹۸-۰۰۱۱۱۱
۱۷۹,۸۷۸,۷۹۱	۰	۱۷۹,۸۷۸,۷۹۱	۰	۳۴۲,۷۳۱,۵۷۴	۰	۳۴۲,۷۳۱,۵۷۴	۰	اسناد خزانه-م ۱۳ بودجه ۹۷-۰۰۰۵۱۸
(۳,۲۲۳,۷۲۳,۴۸۶)	۰	(۳,۲۲۳,۷۲۳,۴۸۶)	۰	(۲,۵۰۰,۴۳۸,۷۲۸)	۰	(۲,۵۰۰,۴۳۸,۷۲۸)	۰	اسناد خزانه-م ۱۴ بودجه ۹۸-۰۱۰۳۱۸
۱۹۲,۰۴۲,۸۷۶	۰	۱۹۲,۰۴۲,۸۷۶	۰	۲۸۱,۳۷۸,۴۳۶	۰	۲۸۱,۳۷۸,۴۳۶	۰	اسناد خزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۰۰۰۴۰۷
(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۰	(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۰	(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۰	(۲,۷۹۱,۰۶۹,۱۵۰)	۰	اسناد خزانه-م ۱۷ بودجه ۹۸-۰۱۰۵۱۲
(۲۲۰,۶۴۶,۷۵۳)	۰	(۲۲۰,۶۴۶,۷۵۳)	۰	۳,۵۴۲,۹۷۵,۸۳۷	۰	۳,۵۴۲,۹۷۵,۸۳۷	۰	اسناد خزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۰۱۰۶۱۴
۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۰	۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۰	۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۰	۲۱۴,۲۹۰,۵۹۲	۰	اسناد خزانه-م ۲۰ بودجه ۹۸-۰۲۰۸۰۶
۷۱,۹۹۵,۸۵۴	۰	۷۱,۹۹۵,۸۵۴	۰	۱,۹۰۳,۱۷۹,۲۹۶	۰	۱,۹۰۳,۱۷۹,۲۹۶	۰	اسناد خزانه-م ۲۱ بودجه ۹۷-۰۰۰۷۲۸
۱,۲۲۳,۷۷۹,۸۲۶	۰	۱,۲۲۳,۷۷۹,۸۲۶	۰	۳,۱۳۰,۲۰۵,۸۸۸	۰	۳,۱۳۰,۲۰۵,۸۸۸	۰	اسناد خزانه-م ۲۲ بودجه ۹۷-۰۰۰۴۲۸
(۳,۳۲۹,۰۳۳,۶۶۵)	۰	(۳,۳۲۹,۰۳۳,۶۶۵)	۰	(۱,۵۲۶,۱۹۴,۱۰۹)	۰	(۱,۵۲۶,۱۹۴,۱۰۹)	۰	اسناد خزانه-م ۲۳ بودجه ۹۷-۰۰۰۸۲۴
(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۰	(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۰	(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۰	(۱,۶۵۲,۱۹۴,۲۸۵)	۰	اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۹۸-۰۰۰۴۲۲
(۸۴۰,۵۴۰,۹۴۳)	۰	(۸۴۰,۵۴۰,۹۴۳)	۰	۵,۵۸۳,۳۵۶,۶۵۳	۰	۵,۵۸۳,۳۵۶,۶۵۳	۰	اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۹۸-۰۰۰۷۱۹
۴,۴۵۶,۸۸۲,۰۸۵	۰	۴,۴۵۶,۸۸۲,۰۸۵	۰	۲,۴۹۹,۴۴۵,۳۱۰	۰	۲,۴۹۹,۴۴۵,۳۱۰	۰	سکه تمام بهار تحویل اروزه صادرات
۱۴۲,۰۴۹,۹۶۲	۰	(۱۴,۳۷۵,۰۰۰)	۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	۱۴۲,۰۴۹,۹۶۲	۰	(۱۴,۳۷۵,۰۰۰)	۱۵۶,۴۲۴,۹۶۲	صکوک مرابحه سایبیا ۱۱۲-۳ ماهه ۱۶٪
(۱۳۳,۵۴۲)	۰	(۱۳۳,۵۴۲)	۰	(۱۳۳,۵۴۲)	۰	(۱۳۳,۵۴۲)	۰	مرابحه سلامت عواجد شرایط خاص ۱۴۰۰
(۱,۸۵۹,۰۷۳,۴۵۲)	۰	(۲,۴۲۹,۵۳۰,۹۳۶)	۵۷۰,۴۵۷,۴۸۴	۱,۳۱۸,۶۳۶,۲۲۴	۰	۹۲۰,۹۴۵,۹۳۹	۳۹۷,۶۹۰,۲۸۵	مرابحه گندم ۲- واجد شرایط خاص ۱۴۰۰
(۳۳۱,۴۹۰,۸۳۰)	۰	(۲,۹۳۸,۶۰۳,۱۷۷)	۲,۷۰۷,۱۱۲,۳۴۷	۲,۲۰۳,۵۶۸,۷۰۲	۰	۱,۶۱۵,۹۹۹,۳۹۹	۵۸۷,۵۶۹,۳۰۳	مشارکت دولت-باشا شرایط خاص ۱۴۰۰۱۰
(۱,۱۷۱,۰۹۱,۹۷۰)	۰	(۱,۵۳۸,۶۴۹,۰۸۱)	۳۶۷,۵۵۷,۱۱۱	۱,۰۱۴,۵۶۰,۱۶۹	۰	۶۸۸,۵۸۱,۱۵۵	۳۲۵,۹۷۹,۰۱۴	مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰
۸,۶۹۰,۶۵۳,۵۶۱	۰	(۶۶,۱۵۵,۷۲۰,۲۴۵)	۷۴,۸۴۶,۳۷۳,۸۰۶	(۲۸,۲۰۹,۶۲۴,۶۷۵)	۰	(۳۴,۴۶۳,۳۷۶,۰۱۵)	۶,۱۵۳,۷۵۱,۳۴۰	منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۱۰۸۰
۲۲,۵۷۶	(۷,۳۲۱)	۰	۲۹,۸۹۷	۰	۰	۰	۰	منفعت صبا ارونند سپهر ۱۴۰۰۱۲۲۲
(۶,۴۴۳,۱۰۸,۶۰۶)	(۷,۳۲۱)	(۸۵,۰۹۱,۰۵۶,۸۹۲)	۷۸,۶۴۷,۹۵۵,۶۰۷	۱۹,۵۰۵,۶۴۹,۵۸۵-	۰	(۲۷,۱۲۷,۰۶۴,۴۸۹)	۷,۶۲۱,۴۱۴,۹۰۴	جمع

## صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

### صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

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

۱۳۹۹/۰۲/۳۱		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
۰/۶۱٪	۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	۳/۷۹٪	۴۴۴,۱۴۹,۶۰۰	-	اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله ۲۴ بانک صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد
۱/۱۴٪	۸۲۱,۹۱۷,۸۰۶	۷/۰۲٪	۸۲۱,۹۱۷,۸۰۶	۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۱	سپرده بانکی بلند مدت - ایران زمین
۵/۷۲٪	۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۲	۷/۲۶٪	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶	سپرده بانکی بلند مدت - پارسیان
۱۲/۸۵٪	۹,۲۸۵,۴۷۹,۴۵۲	۱۶/۶۲٪	۱,۹۴۴,۹۳۱,۵۰۷	۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱	سپرده بانکی بلند مدت - پارسیان
-۰/۲۷٪	۱۹۷,۲۶۰,۲۷۲	۱/۶۹٪	۱۹۷,۲۶۰,۲۷۲	۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۸۸۱۳	سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه
-۰/۲۰٪	۱۴۷,۹۴۵,۲۰۴	۱/۲۶٪	۱۴۷,۹۴۵,۲۰۴	۷۰۰۸۴۳۲۲۹۲۴	سپرده بانکی بلند مدت - شهر
۴/۰۴٪	۲,۹۱۷,۸۰۸,۲۱۲	۳/۶۳٪	۴۲۴,۶۵۷,۵۳۴	۱.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۵/۷۲٪	۴,۱۳۶,۹۸۶,۲۹۹	۷/۲۶٪	۸۴۹,۳۱۵,۰۶۸	۲.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۱۰/۰۴٪	۷,۲۵۸,۰۸۲,۱۶۴	۱۲/۹۹٪	۱,۵۲۰,۲۷۳,۹۷۲	۳.۶۶۹۱۴۷.۱۱۹۷.۱۱۳	سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری
۱/۲۰٪	۸۶۸,۶۶۷,۳۹۸	۰/۰۰٪	۶,۷۷۶	۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
۵۲/۶۵٪	۳۸,۰۶۰,۲۱۷,۴۶۹	۲۶/۴۰٪	۳,۰۸۹,۹۴۵,۶۴۲	۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹	سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده
-۰/۰۱٪	۵,۲۱۴,۶۹۰	۰/۰۴٪	۵,۲۱۴,۶۹۰	۴۷۰-۹۸۸۴۰۶-۶۰۹	سپرده بانکی کوتاه مدت - پارسیان
۵/۵۱٪	۳,۹۸۳,۲۴۷,۳۵۲	۱۱/۸۶٪	۱,۳۸۸,۳۰۸,۸۰۲	۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶	سپرده بانکی کوتاه مدت - صادرات
-۰/۰۳٪	۲۱,۴۵۶,۱۷۲	-۰/۱۸٪	۲۱,۴۵۶,۱۷۲	۱.۶۶۹۱۴۷.۹۹۶۷.۱۱۳	سپرده بانکی کوتاه مدت - گردشگری
۱۰۰٪	۷۲,۲۸۵,۴۱۸,۳۸۲	۱۰۰٪	۱۱,۷۰۴,۶۹۸,۱۱۳		جمع

صندوق سرمایه گذاری دارا الگوریتیم

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

**۲-۴- سایر درآمدها:**

۱۳۹۹/۰۲/۳۱	طی دوره	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۷۵,۸۶۶,۶۵۰	۱۱,۹۶۴,۰۶۷	تعدیل کارمزدکارگزاری آینده نگرخوارزمی
۳۴۰,۸۸۶	۳۴,۵۴۸-	تعدیل کارمزدبانک پاسارگاد
۳۵,۵۸۱,۱۹۷	۰	سایر درآمدها
<u>۱۱۱,۷۸۸,۷۳۳</u>	<u>۱۱,۹۲۹,۵۱۹</u>	<b>جمع</b>