



قابل معامله دارا الگوریتم

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت بور تقوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| شرکت                             | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰ |                 |                 | تغییرات طی دوره |                           |                 |                               | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |                 |                 |            |
|----------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|---------------------------|-----------------|-------------------------------|----------------|-----------------|-----------------|------------|
|                                  | تعداد      | بهای تمام شده   | خالص ارزش فروش  | تعداد           | فروش طی دوره<br>مبلغ فروش | تعداد           | خرید طی دوره<br>بهای تمام شده | تعداد          | بهای تمام شده   | خالص ارزش فروش  |            |
| صندوق سرمایه گذاری مشترک خوارزمی | ۳,۱۹۰      | ۱۹۹,۹۴۷,۱۰۴,۳۹۸ | ۱۷۵,۲۷۳,۶۰۵,۷۶۰ | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۱۷۵,۲۷۳,۶۰۵,۷۶۰ | ۱۹۹,۹۴۷,۱۰۴,۳۹۸ | ۳,۱۹۰      |
| پارس دارو                        | ۸۵۰,۰۰۰    | ۱۰۶,۱۶۳,۱۹۶,۴۴۳ | ۹۲,۱۹۱,۶۷۶,۱۷۵  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۹۲,۱۹۱,۶۷۶,۱۷۵  | ۱۰۶,۱۶۳,۱۹۶,۴۴۳ | ۸۵۰,۰۰۰    |
| بانک ملت                         | ۵,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۹,۳۱۷,۴۰۲,۹۵۶  | ۲۴,۰۵۶,۰۱۰,۰۰۰  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۲۴,۰۵۶,۰۱۰,۰۰۰  | ۲۹,۳۱۷,۴۰۲,۹۵۶  | ۵,۰۰۰,۰۰۰  |
| بانک تجارت                       | ۵,۰۰۰,۰۰۰  | ۱۹,۸۶۰,۸۷۷,۷۷۴  | ۱۶,۶۵۰,۳۳۷,۵۰۰  | ۰               | ۰                         | ۳,۴۷۱,۹۰۱,۴۷۲   | ۱,۰۰۰,۰۰۰                     | ۰              | ۱۶,۶۵۰,۳۳۷,۵۰۰  | ۱۹,۸۶۰,۸۷۷,۷۷۴  | ۵,۰۰۰,۰۰۰  |
| فولاد مبارکه                     | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | ۱۹,۵۶۱,۸۲۵,۷۳۱  | ۲۰,۲۰۷,۰۴۸,۴۰۰  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۲۰,۲۰۷,۰۴۸,۴۰۰  | ۱۹,۵۶۱,۸۲۵,۷۳۱  | ۱,۴۰۰,۰۰۰  |
| سرمایه گذاری غدیر                | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | ۲۰,۰۷۲,۹۹۳,۸۷۸  | ۱۸,۱۰۵,۶۲۶,۷۰۰  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۱۸,۱۰۵,۶۲۶,۷۰۰  | ۲۰,۰۷۲,۹۹۳,۸۷۸  | ۱,۴۰۰,۰۰۰  |
| بانک خاورمیانه                   | ۰          | ۰               | ۰               | ۰               | ۰                         | ۹,۹۶۸,۴۶۶,۳۰۲   | ۹۸۶,۵۳۳                       | ۰              | ۰               | ۰               | ۰          |
| ملی کشت و صنعت و دامپروری پارس   | ۰          | ۰               | ۰               | ۰               | ۰                         | ۱۰,۰۰۴,۷۷۹,۳۳۱  | ۸۵,۰۰۰                        | ۰              | ۰               | ۰               | ۰          |
| پاما                             | ۰          | ۰               | ۰               | ۰               | ۰                         | ۹,۸۸۵,۴۱۴,۱۵۲   | ۴۰۰,۰۰۰                       | ۰              | ۰               | ۰               | ۰          |
| مدیریت سرمایه گذاری کوثر بهمن    | ۲۶,۵۴۴     | ۳۸۴,۶۶۶,۲۸۸     | ۴۶۶,۶۳۷,۵۲۸     | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۴۶۶,۶۳۷,۵۲۸     | ۳۸۴,۶۶۶,۲۸۸     | ۲۶,۵۴۴     |
| سپیدار سیستم آسیا                | ۰          | ۰               | ۰               | ۰               | ۰                         | ۷۲,۱۹۵,۴۹۳      | ۱,۸۱۳                         | ۰              | ۰               | ۰               | ۰          |
| رایان هم افزا                    | ۱,۴۲۱      | ۳۵,۵۵۳,۷۷۱      | ۵۴,۶۷۵,۳۹۶      | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۵۴,۶۷۵,۳۹۶      | ۳۵,۵۵۳,۷۷۱      | ۱,۴۲۱      |
| صنایع چوب خزر کاسپین             | ۶۳۳        | ۱۵,۸۳۳,۳۵۲      | ۱۷,۷۲۲,۹۹۵      | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۱۷,۷۲۲,۹۹۵      | ۱۵,۸۳۳,۳۵۲      | ۶۳۳        |
| صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر    | ۳,۸۲۴      | ۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶  | ۵۰,۴۹۰,۵۶۶,۴۰۰  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۵۰,۴۹۰,۵۶۶,۴۰۰  | ۱۱,۱۱۸,۴۶۷,۳۷۶  | ۳,۸۲۴      |
| مواد اولیه داروپخش               | ۸۹۰,۵۶۱    | ۴۷,۶۵۸,۵۵۱,۵۶۱  | ۴۴,۹۶۲,۴۶۵,۲۱۱  | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۴۴,۹۶۲,۴۶۵,۲۱۱  | ۴۷,۶۵۸,۵۵۱,۵۶۱  | ۸۹۰,۵۶۱    |
| پتروشیمی بوعلی سینا              | ۱۵,۶۵۸     | ۶۴۹,۰۶۶,۴۲۵     | ۸۶۴,۱۵۹,۶۳۴     | ۰               | ۰                         | ۰               | ۰                             | ۰              | ۸۶۴,۱۵۹,۶۳۴     | ۶۴۹,۰۶۶,۴۲۵     | ۱۵,۶۵۸     |
| جمع                              | ۱۴,۵۹۱,۸۲۱ | ۴۵۴,۷۸۵,۵۳۹,۹۵۳ | ۴۴۳,۳۴۰,۵۳۱,۶۹۹ | ۲,۴۷۳,۳۴۶       | ۳۳,۴۰۲,۷۵۶,۷۵۰            | ۹۱۰,۰۴۳         | ۳۳,۴۰۲,۷۵۶,۷۵۰                | ۲,۴۷۳,۳۴۶      | ۴۴۳,۳۴۰,۵۳۱,۶۹۹ | ۴۵۴,۷۸۵,۵۳۹,۹۵۳ | ۱۴,۵۹۱,۸۲۱ |
|                                  | ۵/۶۸%      | ۳۰۳,۱۸۳,۴۵۰,۶۳۳ | ۴۲۸,۷۶۲,۲۱۱,۳۴۱ | ۴۴,۵۱۳,۲۸۹      | ۱۶,۱۵۵,۱۳۴                | ۱۰۲,۳۷۹,۸۳۵,۲۷۵ | ۹۱۰,۰۴۳                       | ۳۳,۴۰۲,۷۵۶,۷۵۰ | ۲,۴۷۳,۳۴۶       | ۴۴۳,۳۴۰,۵۳۱,۶۹۹ | ۱۴,۵۹۱,۸۲۱ |

**قابل معامله دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت پورتنفوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| نام اوراق                        | دارای مجوز از | پذیرفته شده در بورس یا | اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت |                    |              |              | تغییرات طی دوره |                   |                |              | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰ |       |                | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ |                    |               |                |                      |
|----------------------------------|---------------|------------------------|------------------------------------|--------------------|--------------|--------------|-----------------|-------------------|----------------|--------------|------------|-------|----------------|------------|--------------------|---------------|----------------|----------------------|
|                                  |               |                        | تاریخ سررسید اوراق                 | تاریخ انتشار اوراق | نرخ سود اسمی | نرخ سود مؤثر | تعداد           | بهای تمام شده     | خالص ارزش فروش | فروش طی دوره |            | تعداد | بهای تمام شده  | تعداد      | قیمت بازار هر ورقه | بهای تمام شده | خالص ارزش فروش | درصد به کل دارایی ها |
|                                  |               |                        |                                    |                    |              |              |                 |                   |                | تعداد        | مبلغ فروش  |       |                |            |                    |               |                |                      |
| مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۱۰۵        | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۴/۲۴                         | ۱۴۰/۱۰/۵۱۲۴        | ۱۶           | ۰            | ۵۶۷,۰۰۰         | ۵۴۸,۷۶۴,۵۷۲,۴۳۴   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۹۹۷,۷۲۷        | ۵۶۷,۰۰۰    | ۵۶۶,۹۸۰,۱۷۸,۵۰۹    | ۱۰/۶۳٪        |                |                      |
| مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۰۰۶        | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۵/۰۷                         | ۱۴۰/۰۶/۰۷          | ۱۵           | ۰            | ۴۱۱,۰۰۰         | ۳۹۸,۹۹۸,۸۰۰,۰۰۰   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۱,۰۲۴,۴۳۰      | ۴۱۱,۰۰۰    | ۴۵۰,۳۵۶,۳۷۴,۴۶۶    | ۸/۴۴٪         |                |                      |
| منفعت دولت ۵-ش خاص سایر ۰۱۰۸     | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۸/۰۸/۱۸                         | ۱۴۰/۱۰/۸۱۸         | ۱۷,۹         | ۰            | ۴۰۰,۰۰۰         | ۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۸۸۹,۶۲۶        | ۴۰۰,۰۰۰    | ۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰    | ۷/۵۳٪         |                |                      |
| مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۰۱۰۶       | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۵/۰۷                         | ۱۴۰/۱۰/۶۰۷         | ۱۶           | ۰            | ۲۴۵,۷۰۰         | ۲۳۳,۵۶۰,۲۵۰,۵۹۸   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۱,۰۵۶,۲۵۰      | ۲۴۵,۷۰۰    | ۲۳۳,۵۶۰,۲۵۰,۵۹۸    | ۵/۳۷٪         |                |                      |
| مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۰۰۰۹       | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۶/۱۲                         | ۱۴۰/۰۹/۱۲          | ۱۵           | ۰            | ۲۰۹,۲۰۰         | ۲۰۲,۳۰۸,۹۵۲,۰۰۰   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۱,۰۴۶,۰۰۰      | ۲۰۹,۲۰۰    | ۲۰۲,۳۰۸,۹۵۲,۰۰۰    | ۴/۳۲٪         |                |                      |
| مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۰۱۰۷       | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۵/۲۱                         | ۱۴۰/۱۰/۷۰۲         | ۱۶           | ۰            | ۱۵۷,۰۰۰         | ۱۴۹,۰۸۳,۶۴۵,۳۳۵   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۹۶۸,۷۳۴        | ۱۵۷,۰۰۰    | ۱۴۹,۰۸۳,۶۴۵,۳۳۵    | ۳/۰۹٪         |                |                      |
| مراجعه کرمان موتور ۳۰۶           | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۹/۰۳/۰۶                         | ۱۴۰/۲/۳/۰۶         | ۱۸           | ۰            | ۱۴۵,۰۰۰         | ۱۴۹,۷۷۲,۱۰۸,۳۷۵   | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۱,۰۰۰,۰۰۰      | ۱۴۵,۰۰۰    | ۱۴۹,۷۷۲,۱۰۸,۳۷۵    | ۲/۷۸٪         |                |                      |
| مشارکت دولت-بانشرايط خاص ۱۴۰۰۱۰  | خیر           | فراپورس                | ۱۳۹۶/۱۰/۲۶                         | ۱۴۰/۱۰/۲۶          | ۱۷           | ۰            | ۴۰,۰۰۰          | ۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰    | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۹۹۷,۰۵۳        | ۴۰,۰۰۰     | ۳۷,۶۵۰,۷۵۰,۴۶۰     | ۰/۷۵٪         |                |                      |
| سکه تمام بهار تحویل اروژه صادرات | خیر           | بورس                   | ۱۳۹۹/۱۳/۳۰                         | ۰۰۰/۰/۰۰           | ۰            | ۰            | ۱۹۰,۰۰۰         | ۱۰۰,۱۶,۵۷۶,۹۷۵    | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۱,۰۱۵,۸۶۶      | ۱۹۰,۰۰۰    | ۱۰۰,۱۶,۵۷۶,۹۷۵     | ۰/۳۶٪         |                |                      |
| مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۰۱۰ | بلی           | فراپورس                | ۱۳۹۶/۱۰/۲۵                         | ۱۴۰/۱۰/۲۵          | ۱۸           | ۰            | ۲۱,۳۴۱          | ۲۰,۹۲۳,۴۲۲,۴۳۵    | ۰              | ۰            | ۰          | ۰     | ۲۱,۳۳۸,۷۳۳,۵۲۳ | ۲۱,۳۴۱     | ۰                  | ۰/۰۰٪         |                |                      |
| جمع                              |               |                        |                                    |                    |              |              | ۲,۲۱۵,۲۴۱       | ۲,۱۵۱,۰۷۹,۰۷۸,۶۱۲ |                |              |            |       | ۲,۱۹۳,۹۰۰      | ۲,۲۱۵,۲۴۱  | ۲,۳۰۸,۸۷۹,۲۱۲,۳۷۲  | ۴۳/۲۷٪        |                |                      |

قابل معامله دارا الگوریتیم  
صورت وضعیت پورتفوی  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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)

۱۳۹۹/۱۰/۳۰

| دلیل تعدیل        | خالص ارزش فروش تعدیل شده | درصد تعدیل | قیمت تعدیل شده | قیمت پایانی | تعداد   | نام اوراق بهادار             |
|-------------------|--------------------------|------------|----------------|-------------|---------|------------------------------|
| نگهداری تا سررسید | ۳۵۵,۷۸۵,۹۰۲,۱۱۵          | -۸/۳۸٪     | ۸۸۹,۶۲۶        | ۹۷۱,۰۰۰     | ۴۰۰,۰۰۰ | منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۰۱۰۸ |
|                   | ۳۵۵,۷۸۵,۹۰۲,۱۱۵          |            |                |             |         | جمع                          |

**قابل معامله دارا الگورتی**  
**صورت وضعیت پور تفوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰           |                 | تغییرات طی دوره |                 | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰      |                    | مشخصات حساب بانکی |           |                   | سپرده های بانکی                 |
|----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|--------------------|-------------------|-----------|-------------------|---------------------------------|
| درصد به کل دارایی ها | مبلغ            | کاهش            | افزایش          | مبلغ            | نرخ سود علی الحساب | تاریخ افتتاح حساب | نوع سپرده | شماره حساب        |                                 |
| ۰/۰۰٪                | ۳۳۸,۲۴۸         | .               | .               | ۳۳۸,۲۴۸         | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۲/۲۹        | جاری      | ۱۲۶-۱۱-۱۳۲۰۰۷۸-۱  | سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین |
| ۰/۰۰٪                | ۷۵۰,۰۰۰         | ۷,۳۹۷,۵۱۸,۴۹۳   | ۷,۳۹۷,۲۶۸,۴۹۳   | ۱,۰۰۰,۰۰۰       | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۲/۲۴        | کوتاه مدت | ۱۲۶-۸۴۰-۱۳۲۰۰۷۸-۱ | سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین |
| ۴/۶۹٪                | ۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .               | ۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۲/۲۵        | بلند مدت  | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۱ | سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین |
| ۰/۹۴٪                | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .               | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۳/۰۱        | بلند مدت  | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۲ | سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین |
| ۲/۸۱٪                | ۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .               | ۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۵/۰۶        | بلند مدت  | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۳ | سپرده بانکی نزد بانک ایران زمین |
| ۰/۰۰٪                | ۱۰۰,۰۰۰         | ۱۴۷,۵۴۰,۰۰۰     | ۱۴۷,۵۴۰,۰۰۰     | ۱۰۰,۰۰۰         | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۹/۱۷        | پس انداز  | ۰۳۰۱۹۱۸۹۵۹۰۰۳     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۳/۱۳٪                | ۱۶۶,۹۳۷,۳۹۲,۵۳۴ | ۱۱۴,۰۹۹,۸۱۸,۸۷۵ | ۱۶۸,۲۰۲,۷۶۱,۳۱۰ | ۱۱۲,۸۳۴,۴۵۰,۰۹۹ | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۵/۱۱        | کوتاه مدت | ۰۲۰۲۵۶۵۱۸۷۰۰۴     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۰/۰۰٪                | ۱,۰۰۴,۸۲۱       | ۲,۶۹۲,۱۶۹,۰۲۵   | ۲,۶۹۲,۱۶۵,۶۴۹   | ۱,۰۰۸,۱۹۷       | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۷/۱۹        | کوتاه مدت | ۰۲۰۳۵۹۳۰۲۳۰۰۴     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۳/۴۲٪                | ۱۸۲,۴۶۸,۶۷۸,۳۶۸ | .               | .               | ۱۸۲,۴۶۸,۶۷۸,۳۶۸ | ۱۸                 | ۱۳۹۸/۰۶/۰۴        | کوتاه مدت | ۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۱/۶۹٪                | ۹۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .               | ۹۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۷/۱۶        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۵۲۷۵۱۰۰۵      | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۰/۹۴٪                | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .               | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۰۷        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۵۶۵۲۷۴۰۰۷     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۰/۹۴٪                | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .               | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۰۷        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۵۶۵۳۰۴۰۰۸     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |
| ۰/۹۴٪                | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .               | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۰۷        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۵۶۵۳۳۴۰۰۱     | سپرده بانکی نزد بانک آینده      |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت پور تفوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰           |                 | تغییرات طی دوره |               | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰      |                    | مشخصات حساب بانکی |           |                       |                                |
|----------------------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|--------------------|-------------------|-----------|-----------------------|--------------------------------|
| درصد به کل دارایی ها | مبلغ            | کاهش            | افزایش        | مبلغ            | نرخ سود علی الحساب | تاریخ افتتاح حساب | نوع سپرده | شماره حساب            | سپرده های بانکی                |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۱۹        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۶۰۹۱۷۲۰۰۴         | سپرده بانکی نزد بانک آینده     |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۱۹        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۶۰۹۱۷۸۰۰۳         | سپرده بانکی نزد بانک آینده     |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۸/۱۹        | بلند مدت  | ۰۴۰۱۶۰۹۱۸۴۰۰۵         | سپرده بانکی نزد بانک آینده     |
| ۰/۰۰٪                | ۸۰,۰۰۰          | ۴۲۰,۰۰۰         | .             | ۵۰۰,۰۰۰         | .                  | ۱۳۹۹/۰۹/۲۹        | کوتاه مدت | ۱,۱۴۵۶۱۱۸۶,۸۱۰۰,۳۹۰   | سپرده بانکی نزد بانک پاسارگاد  |
| ۰/۰۰٪                | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰      | ۴۲۰,۰۰۰         | ۴۲۰,۰۰۰       | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰      | .                  | ۱۳۹۹/۰۲/۲۸        | جاری      | ۱۰۰۸-۱۱-۰۴-۷۰۷۰۷۴۰۷۷  | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۰/۱۶٪                | ۸,۳۶۱,۲۴۸,۷۵۴   | ۴۲۰,۰۰۰         | ۸,۳۶۰,۶۶۰,۵۵۸ | ۱,۰۰۸,۱۹۶       | .                  | ۱۳۹۹/۰۲/۲۵        | کوتاه مدت | ۱۰۰۸۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۳۷۴۹    | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۹/۰۹        | بلند مدت  | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۶ | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۹/۰۹        | بلند مدت  | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۷ | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۱/۸۷٪                | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۹/۰۹        | بلند مدت  | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۸ | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۲/۳۵٪                | ۱۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۱۲۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۹/۱۰        | بلند مدت  | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۹ | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۱/۶۹٪                | ۹۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | .               | .             | ۹۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰  | ۲۰                 | ۱۳۹۹/۰۹/۲۲        | بلند مدت  | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۸۴ | سپرده بانکی نزد بانک خاورمیانه |
| ۰/۰۰٪                | ۴۹,۱۳۴,۰۰۰      | ۸۶۶,۰۰۰         | .             | ۵۰,۰۰۰,۰۰۰      | .                  | ۱۳۹۹/۰۷/۱۴        | جاری      | ۰۱۰۵۲۶۶۲۸۱۰۰۲         | سپرده بانکی نزد بانک دی        |
| ۳/۷۵٪                | ۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | .               | .             | ۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۸                 | ۱۳۹۹/۰۷/۱۵        | بلند مدت  | ۰۴۰۵۲۶۸۷۵۰۰۰۸         | سپرده بانکی نزد بانک دی        |

**قابل معامله دارا الگورنتم**  
**صورت وضعیت پور تفوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

۳-۱- سرمایه گذاری در سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰           |                   | تغییرات طی دوره |                 | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰        |                    | مشخصات حساب بانکی |           |                   |                               |
|----------------------|-------------------|-----------------|-----------------|-------------------|--------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------------------|
| درصد به کل دارایی ها | مبلغ              | کاهش            | افزایش          | مبلغ              | نرخ سود علی الحساب | تاریخ افتتاح حساب | نوع سپرده | شماره حساب        | سپرده های بانکی               |
| ۰/۰۰٪                | ۷۵۰,۰۰۰           | ۱,۹۱۸,۲۸۷,۷۵۴   | ۱,۹۱۸,۰۳۷,۷۵۴   | ۱,۰۰۰,۰۰۰         | ۰                  | ۱۳۹۸/۱۱/۱۶        | کوتاه مدت | ۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶     | سپرده بانکی نزد بانک صادرات   |
| ۰/۰۰٪                | ۸۳,۲۷۹            | ۴۲۰,۰۰۰         | ۰               | ۵۰۳,۲۷۹           | ۰                  | ۱۳۹۹/۰۵/۱۶        | کوتاه مدت | ۰۲۰۱۱۲۷۰۵۶۶۰۱     | سپرده بانکی نزد بانک کارآفرین |
| ۰/۰۰٪                | ۷۵۰,۰۰۰           | ۸,۱۳۷,۲۳۶,۳۰۰   | ۸,۱۳۶,۹۸۶,۳۰۰   | ۱,۰۰۰,۰۰۰         | ۰                  | ۱۳۹۸/۰۷/۰۷        | کوتاه مدت | ۱,۶۶۹۱۴۷,۹۹۶۷,۱۱۳ | سپرده بانکی نزد بانک گردشگری  |
| ۵/۶۲٪                | ۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰   | ۰               | ۰               | ۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰   | ۱۸                 | ۱۳۹۹/۰۵/۰۲        | بلند مدت  | ۱۱۳-۱۲۰۲-۶۶۹۱۴۷-۱ | سپرده بانکی نزد بانک گردشگری  |
| ۴/۶۹٪                | ۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰   | ۰               | ۰               | ۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰   | ۱۸                 | ۱۳۹۹/۰۷/۱۴        | بلند مدت  | ۱-۶۶۹۱۴۷-۲۱۱-۱۱۳  | سپرده بانکی نزد بانک گردشگری  |
| ۰/۰۰٪                | ۳۰,۰۰۰            | ۳۰,۰۰۰          | ۶۰,۰۰۰          | ۰                 | ۰                  | ۱۳۹۹/۱۰/۲۰        | جاری      | ۰۱۰۰۷۳۷۰۱۴۰۰۶     | سپرده بانکی نزد بانک آینده    |
| ۴۸/۸۸٪               | ۲,۶۰۷,۸۷۰,۳۴۰,۰۰۴ | ۱۳۴,۳۹۵,۱۴۶,۴۴۷ | ۱۹۶,۸۵۵,۹۰۰,۰۶۴ | ۲,۵۴۵,۴۰۹,۵۸۶,۳۸۷ |                    |                   |           |                   | جمع                           |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت پور تقوی**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

قابل معامله دارا الگوریتیم  
 ۴-۱ - سرمایه گذاری در گواهی سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰           |                 |                 |         | تغییرات طی دوره           |       |                               |       | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰      |                 |         | گواهی سپرده بانکی | تاریخ سررسید | نرخ سود<br>علی | نرخ<br>شکست | پذیرفته شده در<br>پورس یا  | گواهی سپرده بانکی |
|----------------------|-----------------|-----------------|---------|---------------------------|-------|-------------------------------|-------|-----------------|-----------------|---------|-------------------|--------------|----------------|-------------|--|-------------------|
| درصد به<br>کل دارایی | خالص ارزش فروش  | بهای تمام شده   | تعداد   | فروش طی دوره<br>مبلغ فروش | تعداد | خرید طی دوره<br>بهای تمام شده | تعداد | خالص ارزش فروش  | بهای تمام شده   | تعداد   |                   |              |                |             |  |                   |
| ۲/۴۳٪                | ۱۲۹,۶۳۴,۹۱۶,۵۳۲ | ۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۳۰,۰۰۰ | ۰                         | ۰     | ۰                             | ۰     | ۱۲۹,۰۱۶,۱۵۳,۳۹۳ | ۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۳۰,۰۰۰ |                   | ۱۸           | ۱۰             | ۱۳۹۹/۱۱/۲۸  | اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله<br>۲۴ بانگ صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد |                   |
| ۲/۴۳٪                | ۱۲۹,۶۳۴,۹۱۶,۵۳۲ | ۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۳۰,۰۰۰ | ۰                         | ۰     | ۰                             | ۰     | ۱۲۹,۰۱۶,۱۵۳,۳۹۳ | ۱۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰ | ۱۳۰,۰۰۰ |                   |              |                |             | جمع  |                   |



قابل معامله دارا الگوریتیم  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

| درصد از کل دارایی ها | درصد از کل درآمدها | مبلغ            | یادداشت | شرح  |
|----------------------|--------------------|-----------------|---------|--|
| -۱/۶۳٪               | -۱۶/۷۷٪            | ۸۶,۷۸۰,۸۴۲,۲۳۷- | ۱-۲     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام        |
| ۶/۶۴٪                | ۶۸/۴۶٪             | ۳۵۴,۲۷۴,۵۱۴,۳۸۰ | ۲-۲     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت |
| ۴/۶۸٪                | ۴۸/۳۰٪             | ۲۴۹,۹۳۸,۴۶۸,۳۱۹ | ۳-۲     | درآمد حاصل از سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده  |
| ۰/۰۰٪                | ۰/۰۱٪              | ۵۸,۱۵۷,۱۱۹      | ۴-۲     | سایر درآمدها   |
| ۹/۷۰٪                | ۱۰۰/۰۰٪            | ۵۱۷,۴۹۰,۲۹۷,۵۸۱ |         | جمع  |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

درآمد سود سهام

| نام سهام                      | اطلاعات مجمع     |                                |                     | طی دوره            |             |                     | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰         |             |                     |
|-------------------------------|------------------|--------------------------------|---------------------|--------------------|-------------|---------------------|--------------------|-------------|---------------------|
|                               | 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 |
| بانک ملت                      | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱       | ۶۹۰,۰۰۰                        | ۲۶                  | .                  | .           | .                   | ۱۷,۹۴۲,۸۵۰         | .           | ۱۷,۹۴۲,۸۵۰          |
| تهیه توزیع غذای دنا آفرین فدک | ۱۳۹۹/۰۶/۲۹       | ۵۹۰                            | ۱۵                  | .                  | .           | .                   | ۸,۸۵۰              | ۱۷۸-        | ۸,۶۷۲               |
| توسعه صنایع بهشهر             | ۱۳۹۹/۰۴/۲۱       | ۱,۵۱۶,۰۰۰                      | ۱۹۰                 | .                  | .           | .                   | ۲۸۸,۰۴۰,۰۰۰        | .           | ۲۸۸,۰۴۰,۰۰۰         |
| دارویی تامین                  | ۱۳۹۹/۰۵/۱۵       | ۱۲۸,۰۵۰                        | ۳,۷۰۰               | .                  | .           | .                   | ۴۷۳,۷۸۵,۰۰۰        | .           | ۴۷۳,۷۸۵,۰۰۰         |
| سرمایه گذاری تامین اجتماعی    | ۱۳۹۹/۰۷/۲۳       | ۳۷۹,۰۰۰                        | ۱,۲۰۰               | .                  | .           | .                   | ۴۵۴,۸۰۰,۰۰۰        | .           | ۴۵۴,۸۰۰,۰۰۰         |
| سرمایه گذاری سیمان تامین      | ۱۳۹۹/۰۵/۰۸       | ۲۵,۵۴۵                         | ۷۷۰                 | .                  | .           | .                   | ۱۹,۶۶۹,۶۵۰         | .           | ۱۹,۶۶۹,۶۵۰          |
| صنعتی زر ماکارون              | ۱۳۹۹/۰۶/۰۳       | ۲,۲۴۶                          | ۳۵۶                 | .                  | .           | .                   | ۷۹۹,۵۷۶            | .           | ۷۹۹,۵۷۶             |
| فولاد خوزستان                 | ۱۳۹۹/۰۵/۱۵       | ۵۰۰,۰۰۰                        | ۵۳۰                 | .                  | .           | .                   | ۲۶۵,۰۰۰,۰۰۰        | .           | ۲۶۵,۰۰۰,۰۰۰         |
| فولاد مبارکه                  | ۱۳۹۹/۰۵/۱۵       | ۵۰۰,۰۰۰                        | ۲۲۵                 | .                  | .           | .                   | ۱۱۲,۵۰۰,۰۰۰        | .           | ۱۱۲,۵۰۰,۰۰۰         |
| ملی مس                        | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱       | ۱,۵۰۰,۰۰۰                      | ۲۵۰                 | .                  | .           | .                   | ۳۷۵,۰۰۰,۰۰۰        | .           | ۳۷۵,۰۰۰,۰۰۰         |
| پارس دارو                     | ۱۳۹۹/۰۴/۰۹       | ۱۵۰,۰۰۰                        | ۶,۴۴۰               | .                  | .           | .                   | ۹۵۶,۸۳۴,۹۶۶        | ۹,۱۷۵,۰۳۴-  | ۹۶۶,۰۰۰,۰۰۰         |
| پتروشیمی ارومیه               | ۱۳۹۹/۰۶/۰۳       | ۱,۷۷۸                          | ۲۵۷                 | .                  | .           | .                   | ۴۵۷,۲۰۱            | .           | ۴۵۷,۲۰۱             |
| پلیمر آریا ساسول              | ۱۳۹۹/۰۴/۰۹       | ۳,۲۰۹                          | ۸,۷۴۰               | .                  | .           | .                   | ۲۸,۰۴۶,۶۶۰         | .           | ۲۸,۰۴۶,۶۶۰          |
| چادرملو                       | ۱۳۹۹/۰۴/۰۴       | ۱,۱۳۲,۰۰۰                      | ۷۰۰                 | .                  | .           | .                   | ۷۹۲,۴۰۰,۰۰۰        | .           | ۷۹۲,۴۰۰,۰۰۰         |
| گروه بهمن                     | ۱۳۹۹/۰۴/۳۱       | ۱,۵۷۰,۰۰۰                      | ۴۰۰                 | .                  | .           | .                   | ۶۲۸,۰۰۰,۰۰۰        | .           | ۶۲۸,۰۰۰,۰۰۰         |
| جمع                           |                  |                                |                     | .                  | .           | .                   | ۴,۴۱۳,۲۷۴,۵۷۵      | ۹,۱۷۵,۲۱۲-  | ۴,۴۲۲,۴۴۹,۷۸۷       |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |             | طی دوره        |               |             | نرخ سود علی الحساب | تاریخ سررسید | تاریخ دریافت سود | شرح        |   |
|----------------|-------------|----------------|---------------|-------------|--------------------|--------------|------------------|------------|---|
| خالص درآمد     | هزینه تنزیل | درآمد سود      | خالص درآمد    | هزینه تنزیل |                    |              |                  |            | درآمد سود   |
| ۱۳,۶۷۹,۶۸۰,۲۷۸ | ۰           | ۱۳,۶۷۹,۶۸۰,۲۷۸ | ۱,۹۱۸,۰۳۲,۹۹۹ | ۰           | ۱,۹۱۸,۰۳۲,۹۹۹      | ۱۰           | ۱۳۹۹/۱۱/۲۸       | ۱۳۹۹/۱۱/۲۸ | اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله ۲۴ بانک صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد |
| ۵,۱۵۹,۴۸۵,۰۲۶  | ۶,۴۶۷,۵۵۰-  | ۵,۱۶۵,۹۵۲,۵۷۶  | ۱,۴۶۸,۹۴۱,۳۰۲ | ۶,۴۶۷,۵۵۰-  | ۱,۴۷۵,۴۰۸,۸۵۲      | ۲۰           | ۱۴۰۱/۰۷/۱۶       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۶ | بلند مدت-۰۴۰۱۵۲۷۵۵۱۰۰۵-آینده  |
| ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲  | ۲,۵۰۸,۲۸۶-  | ۲,۲۹۵,۰۸۱,۹۵۸  | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵   | ۳,۵۸۳,۲۶۶-  | ۸۱۹,۶۷۲,۱۳۱        | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۰۷       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ | بلند مدت-۰۴۰۱۵۶۵۲۷۴۰۰۷-آینده  |
| ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲  | ۲,۵۰۸,۲۸۶-  | ۲,۲۹۵,۰۸۱,۹۵۸  | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵   | ۳,۵۸۳,۲۶۶-  | ۸۱۹,۶۷۲,۱۳۱        | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۰۷       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ | بلند مدت-۰۴۰۱۵۶۵۳۰۴۰۰۸-آینده  |
| ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲  | ۲,۵۰۸,۲۸۶-  | ۲,۲۹۵,۰۸۱,۹۵۸  | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵   | ۳,۵۸۳,۲۶۶-  | ۸۱۹,۶۷۲,۱۳۱        | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۰۷       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۷ | بلند مدت-۰۴۰۱۵۶۵۳۳۴۰۰۱-آینده  |
| ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴  | ۶,۸۰۸,۲۰۶-  | ۳,۹۳۴,۴۲۶,۲۲۰  | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰ | ۷,۱۶۶,۵۳۲-  | ۱,۶۳۹,۳۴۴,۲۶۲      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۱۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۹ | بلند مدت-۰۴۰۱۶۰۹۱۷۲۰۰۴-آینده  |
| ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴  | ۶,۸۰۸,۲۰۶-  | ۳,۹۳۴,۴۲۶,۲۲۰  | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰ | ۷,۱۶۶,۵۳۲-  | ۱,۶۳۹,۳۴۴,۲۶۲      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۱۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۹ | بلند مدت-۰۴۰۱۶۰۹۱۷۸۰۰۳-آینده  |
| ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴  | ۶,۸۰۸,۲۰۶-  | ۳,۹۳۴,۴۲۶,۲۲۰  | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰ | ۷,۱۶۶,۵۳۲-  | ۱,۶۳۹,۳۴۴,۲۶۲      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۸/۱۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۹ | بلند مدت-۰۴۰۱۶۰۹۱۸۴۰۰۵-آینده  |
| ۱۰,۳۵۶,۱۶۴,۲۸۰ | ۰           | ۱۰,۳۵۶,۱۶۴,۲۸۰ | ۲,۹۵۸,۹۰۴,۰۸۰ | ۰           | ۲,۹۵۸,۹۰۴,۰۸۰      | ۱۸           | ۱۴۰۰/۰۱/۱۵       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱ | بلند مدت-۰۴۰۵۲۶۸۷۵۰۰۰۸-دی   |
| ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹  | ۲۶۸,۷۴۵-    | ۲,۸۴۱,۵۳۰,۰۵۴  | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰ | ۱۱,۹۴۴,۲۲۰- | ۱,۶۹۳,۹۸۹,۰۷۰      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۹/۰۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹ | بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۶-خاورمیانه                                      |
| ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹  | ۲۶۸,۷۴۵-    | ۲,۸۴۱,۵۳۰,۰۵۴  | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰ | ۱۱,۹۴۴,۲۲۰- | ۱,۶۹۳,۹۸۹,۰۷۰      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۹/۰۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹ | بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۷-خاورمیانه                                      |
| ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹  | ۲۶۸,۷۴۵-    | ۲,۸۴۱,۵۳۰,۰۵۴  | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰ | ۱۱,۹۴۴,۲۲۰- | ۱,۶۹۳,۹۸۹,۰۷۰      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۹/۰۹       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹ | بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۸-خاورمیانه                                      |
| ۳,۳۴۳,۹۰۳,۹۶۸  | ۳۵۸,۳۲۷-    | ۳,۳۴۴,۲۶۲,۲۹۵  | ۲۰۰۱۷,۵۵۸,۰۰۴ | ۱۵,۲۲۸,۸۸۱- | ۲,۰۳۲,۷۸۶,۸۸۵      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۹/۱۰       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۰ | بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۹-خاورمیانه                                      |
| ۱,۹۱۷,۴۴۱,۵۴۷  | ۵۹۱,۲۳۹-    | ۱,۹۱۸,۰۳۲,۷۸۶  | ۱,۵۰۳,۱۷۱,۱۹۰ | ۲۱,۴۱۸,۹۷۳- | ۱,۵۲۴,۵۹۰,۱۶۳      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۹/۲۲       | ۱۳۹۹/۱۰/۲۲ | بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۸۴-خاورمیانه                                      |
| ۲۹,۱۷۸,۰۹۰,۶۸۳ | ۰           | ۲۹,۱۷۸,۰۹۰,۶۸۳ | ۴,۰۹۲,۷۴۶,۴۶۳ | ۱۶,۸۴۲,۵۷۸- | ۴,۰۹۰,۵۸۹,۰۴۱      | ۲۰           | ۱۴۰۰/۰۲/۲۵       | ۱۳۹۹/۱۰/۲۵ | بلند مدت-۱-۱۱۳-۲۱۱-۱۳۲۰۰۷۸-۱۲۶-۹۸۵-ایران زمین                                 |
| ۱۳,۴۸۲,۵۸۲,۶۵۸ | ۱۴,۴۳۰,۷۲۱- | ۱۳,۴۹۷,۰۱۳,۳۷۹ | ۳,۷۹۳,۰۸۹,۷۷۹ | ۱۴,۵۵۱,۹۸۷- | ۳,۸۰۷,۶۴۱,۷۶۶      | ۱۸           | ۱۴۰۱/۰۷/۱۴       | ۱۳۹۹/۱۰/۱۴ | بلند مدت-۱-۶۶۹۱۴۷-۲۱۱-۱۱۳-گردشگری   |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| شرح  | تاریخ دریافت سود | تاریخ سررسید | نرخ سود علی الحساب | طی دوره       |             |               | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |             |                |
|--|------------------|--------------|--------------------|---------------|-------------|---------------|----------------|-------------|----------------|
|  |                  |              |                    | درآمد سود     | هزینه تنزیل | خالص درآمد    | درآمد سود      | هزینه تنزیل | خالص درآمد     |
| بلند مدت-۱-۶۶۹۱۴۷-۱۲۰۲-۱۱۳-گردشگری         | ۱۳۹۹/۱۰/۰۲       | ۱۴۰۰/۰۵/۰۲   | ۱۸                 | ۴,۵۶۱,۳۰۶,۹۹۴ | ۱۶,۳۷۰,۹۸۶- | ۴,۵۴۴,۹۳۶,۰۰۸ | ۲۷,۳۵۱,۷۶۲,۸۷۶ | ۴,۰۷۴,۵۵۶-  | ۲۷,۳۴۷,۶۸۸,۳۲۰ |
| بلند مدت-۲-۷۸-۱۳۲۰-۹۸۵-۱۲۶-ایران زمین      | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | ۱۴۰۰/۰۳/۰۱   | ۲۰                 | ۸۲۱,۹۱۷,۸۰۸   | ۳,۵۹۳,۰۸۳-  | ۸۱۸,۳۲۴,۷۲۵   | ۵,۸۶۳,۰۱۳,۶۹۶  | .           | ۵,۸۶۳,۰۱۳,۶۹۶  |
| بلند مدت-۳-۷۸-۱۳۲۰-۹۸۵-۱۲۶-ایران زمین      | ۱۳۹۹/۱۰/۰۶       | ۱۴۰۰/۰۵/۰۶   | ۲۰                 | ۲,۴۶۵,۷۵۳,۴۵۰ | ۱۰,۱۰۵,۵۴۷- | ۲,۴۵۵,۶۴۷,۹۰۳ | ۱۴,۴۶۵,۷۵۳,۴۰۵ | ۶,۴۶۷,۵۵۰-  | ۱۴,۴۵۹,۲۸۵,۸۵۵ |
| کوتاه مدت-۰۴-۱۸۷۰۰۴-۰۲۰۳۵۶۵-آینده          | ۱۳۹۹/۱۰/۱۱       | -            | .                  | ۱۷۰,۴۸۸       | .           | ۱۷۰,۴۸۸       | ۳۳,۵۴۰,۴۷۴     | .           | ۳۳,۵۴۰,۴۷۴     |
| کوتاه مدت-۰۴-۲۳۰۰۴-۲۰۳۵۹۳۰-آینده           | ۱۳۹۹/۱۰/۱۹       | -            | .                  | ۴,۸۲۱         | .           | ۴,۸۲۱         | ۲۰,۹۴۱         | .           | ۲۰,۹۴۱         |
| کوتاه مدت-۰۶-۴۰۰۶-۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰-صادرات        | ۱۳۹۹/۱۰/۱۶       | -            | .                  | ۴,۷۵۴         | .           | ۴,۷۵۴         | ۱۵,۴۵۴,۸۲۲     | .           | ۱۵,۴۵۴,۸۲۲     |
| کوتاه مدت-۰۹-۷۳۷۴۹-۱۰۷۰۷۰۷۰۸۱۰۸۱-خاورمیانه | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | ۴,۸۲۱         | .           | ۴,۸۲۱         | ۵۰,۲۲۵         | .           | ۵۰,۲۲۵         |
| کوتاه مدت-۱-۷۸-۱۳۲۰-۸۴۰-۱۲۶-ایران زمین     | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | ۸,۲۱۹         | .           | ۸,۲۱۹         | ۴۰,۹۷۹         | .           | ۴۰,۹۷۹         |
| مراجعه عام دولت-۳-ش.خ ۰۱۰۵                 | ۱۴۰۰/۰۴/۲۴       | ۱۴۰۱/۰۵/۲۴   | ۱۶                 | ۷,۷۳۶,۱۲۳,۰۷۶ | .           | ۷,۷۳۶,۱۲۳,۰۷۶ | ۴۵,۶۲۱,۳۰۸,۷۳۷ | .           | ۴۵,۶۲۱,۳۰۸,۷۳۷ |
| مراجعه عام دولت-۴-ش.خ ۰۰۰۶                 | ۱۳۹۹/۱۱/۰۷       | ۱۴۰۰/۰۶/۰۷   | ۱۵                 | ۵,۳۴۲,۲۳۶,۸۸۹ | .           | ۵,۳۴۲,۲۳۶,۸۸۹ | ۲۹,۴۱۳,۳۱۲,۸۷۸ | .           | ۲۹,۴۱۳,۳۱۲,۸۷۸ |
| مراجعه عام دولت-۴-ش.خ ۰۰۰۹                 | ۱۳۹۹/۱۲/۱۲       | ۱۴۰۰/۰۹/۱۲   | ۱۵                 | ۲,۶۴۳,۹۳۶,۴۷۵ | .           | ۲,۶۴۳,۹۳۶,۴۷۵ | ۱۱,۷۰۸,۹۸۴,۰۱۶ | .           | ۱۱,۷۰۸,۹۸۴,۰۱۶ |
| مراجعه عام دولت-۴-ش.خ ۰۱۰۶                 | ۱۳۹۹/۱۱/۰۷       | ۱۴۰۱/۰۶/۰۷   | ۱۶                 | ۳,۴۱۸,۸۳۷,۲۸۰ | .           | ۳,۴۱۸,۸۳۷,۲۸۰ | ۱۶,۶۴۰,۵۱۲,۶۴۹ | .           | ۱۶,۶۴۰,۵۱۲,۶۴۹ |
| مراجعه عام دولت-۴-ش.خ ۰۱۰۷                 | ۱۳۹۹/۱۱/۲۱       | ۱۴۰۱/۰۷/۰۲   | ۱۶                 | ۲,۱۵۹,۱۲۳,۲۶۸ | .           | ۲,۱۵۹,۱۲۳,۲۶۸ | ۱۰,۱۸۶,۲۸۹,۵۰۳ | .           | ۱۰,۱۸۶,۲۸۹,۵۰۳ |
| مراجعه کرمان موتور-۰۶-۲۰۳۰۶-۱۴۰۲           | ۱۴۰۰/۰۳/۰۶       | ۱۴۰۲/۰۳/۰۶   | ۱۸                 | ۲۰,۲۸,۷۱۲,۹۷۹ | .           | ۲۰,۲۸,۷۱۲,۹۷۹ | ۱۵,۰۷۳,۴۲۸,۷۲۱ | .           | ۱۵,۰۷۳,۴۲۸,۷۲۱ |
| مشارکت دولت-باشرایط خاص ۱۴۰۰۱۰             | ۱۴۰۰/۰۴/۲۶       | ۱۴۰۰/۱۰/۲۶   | ۱۷                 | ۵۸۸,۰۰۴,۷۱۲   | .           | ۵۸۸,۰۰۴,۷۱۲   | ۳,۹۹۷,۲۸۸,۵۳۳  | .           | ۳,۹۹۷,۲۸۸,۵۳۳  |
| مشارکت لیزینگ ایران وشرق ۱۴۰۰۱۰            | ۱۳۹۹/۱۱/۲۵       | ۱۴۰۰/۱۰/۲۵   | ۱۸                 | ۱۳۵,۵۶۷,۸۸۴   | .           | ۱۳۵,۵۶۷,۸۸۴   | ۲,۰۶۱,۴۱۵,۳۴۵  | .           | ۲,۰۶۱,۴۱۵,۳۴۵  |

**قابل معامله دارا الگوریتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| شرح                                      | تاریخ دریافت سود | تاریخ سررسید | نرخ سود علی الحساب | طی دوره     |               |                | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ |                |            |
|--|------------------|--------------|--------------------|-------------|---------------|----------------|------------|----------------|------------|
|  |                  |              |                    | درآمد سود   | هزینه تنزیل   | خالص درآمد     | درآمد سود  | هزینه تنزیل    | خالص درآمد |
| منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۱۰۸              | ۱۴۰۰/۰۲/۱۸       | ۱۴۰۱/۰۸/۱۸   | ۱۷,۹               | .           | ۵,۶۷۳,۳۳۸,۱۶۰ | ۴۱,۵۷۳,۰۰۹,۳۲۱ | .          | ۴۱,۵۷۳,۰۰۹,۳۲۱ |            |
| کوتاه مدت-۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹-آینده            | ۱۳۹۹/۱۰/۱۴       | -            | ۱۸                 | ۱۰,۶۲۱,۱۲۸- | ۲,۶۸۱,۵۳۹,۷۰۰ | ۱۹,۸۶۹,۸۹۵,۲۲۶ | .          | ۱۹,۸۶۹,۸۹۵,۲۲۶ |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۱۲۷۵۰۲۶۰۲-کارآفرین          | ۱۳۹۹/۱۰/۳۱       | ۱۴۰۱/۰۵/۱۶   | ۱۸                 | .           | .             | ۵,۶۵۵,۷۳۷,۷۰۵  | .          | ۵,۶۵۵,۷۳۷,۷۰۵  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۳۵۳۸۵۸۰۰۱-آینده             | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | ۱۴۰۰/۰۲/۳۱   | ۱۸                 | .           | .             | ۴,۲۷۸,۶۸۸,۵۲۳  | .          | ۴,۲۷۸,۶۸۸,۵۲۳  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۴۵۲۱۹۹۰۰۱-آینده             | ۱۳۹۹/۱۰/۱۱       | ۱۴۰۰/۰۵/۱۱   | ۱۸                 | .           | .             | ۸,۲۶۲,۲۹۵,۰۸۰  | .          | ۸,۲۶۲,۲۹۵,۰۸۰  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۴۸۹۷۰۵۰۰۹-آینده             | ۱۳۹۹/۱۰/۱۱       | ۱۴۰۰/۰۶/۱۱   | ۱۸                 | .           | .             | ۳,۳۹۳,۴۴۲,۶۲۱  | .          | ۳,۳۹۳,۴۴۲,۶۲۱  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۵۲۰۰۱۰۰۰۱-آینده             | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹       | ۱۴۰۱/۰۷/۰۹   | ۱۸                 | .           | .             | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴  | .          | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۱۵۲۰۰۱۶۰۰۰-آینده             | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹       | ۱۴۰۱/۰۷/۰۹   | ۱۸                 | .           | .             | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴  | .          | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۶۰۴۲۵۳۶۰۰۱-صادرات            | ۱۳۹۹/۱۰/۲۰       | ۱۴۰۱/۰۶/۲۰   | ۱۸                 | .           | .             | ۴,۰۲۷,۸۶۸,۸۵۱  | .          | ۴,۰۲۷,۸۶۸,۸۵۱  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۶۰۶۵۸۰۶۰۰۰-صادرات            | ۱۳۹۹/۱۰/۱۸       | ۱۴۰۱/۰۷/۰۹   | ۱۸                 | .           | .             | ۳,۲۹۹,۹۹۹,۹۹۸  | .          | ۳,۲۹۹,۹۹۹,۹۹۸  |            |
| بلند مدت-۰۴۰۶۰۶۵۸۳۳۰۰۵-صادرات            | ۱۳۹۹/۱۰/۰۹       | ۱۴۰۱/۰۷/۰۹   | ۱۸                 | .           | .             | ۱,۶۲۲,۹۵۰,۸۱۷  | .          | ۱,۶۲۲,۹۵۰,۸۱۷  |            |
| بلند مدت-۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۸۸۱۳-خاورمیانه | ۱۳۹۹/۱۰/۲۷       | ۱۴۰۰/۰۲/۲۷   | ۱۸                 | .           | .             | ۷,۴۲۵,۵۵۵,۸۰۸  | .          | ۷,۴۲۵,۵۵۵,۸۰۸  |            |
| بلند مدت-۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۱-گردشگری       | ۱۳۹۹/۱۰/۲۸       | ۱۳۹۹/۰۷/۲۸   | ۲۰                 | .           | .             | ۱,۵۳۴,۲۴۶,۵۷۴  | .          | ۱,۵۳۴,۲۴۶,۵۷۴  |            |
| بلند مدت-۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۲-گردشگری       | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰       | ۱۳۹۹/۰۹/۳۰   | ۲۰                 | .           | .             | ۴,۴۳۸,۳۵۶,۱۶۲  | .          | ۴,۴۳۸,۳۵۶,۱۶۲  |            |
| بلند مدت-۱۱۳,۱۱۹۷,۶۶۹۱۴۷,۳-گردشگری       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۳       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۳   | ۲۰                 | .           | .             | ۸,۹۷۴,۵۲۰,۵۶۹  | .          | ۸,۹۷۴,۵۲۰,۵۶۹  |            |
| بلند مدت-۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱-پاریسیان        | ۱۳۹۹/۱۰/۰۳       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۳   | ۲۰                 | .           | .             | ۱۰,۱۶۳,۸۳۵,۶۱۸ | .          | ۱۰,۱۶۳,۸۳۵,۶۱۸ |            |

**قابل معامله دارا الگوریتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود اوراق بهادار با درآمد ثابت و سپرده بانکی

| شرح                                    | تاریخ دریافت سود | تاریخ سررسید | نرخ سود علی الحساب | طی دوره      |                |                | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰      |             |                 |
|--|------------------|--------------|--------------------|--------------|----------------|----------------|-----------------|-------------|-----------------|
|  |                  |              |                    | درآمد سود    | هزینه تنزیل    | خالص درآمد     | درآمد سود       | هزینه تنزیل | خالص درآمد      |
| بلند مدت-۶۰۶-۴۲۶۳۷۸۴-۴۰۱-پارسیان       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱   | ۲۰                 | .            | .              | .              | ۴,۴۱۰,۹۵۸,۹۱۰   | .           | ۴,۴۱۰,۹۵۸,۹۱۰   |
| بلند مدت-۷۰۰۸۴۳۲۲۹۲۴-شهر               | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | ۱۴۰۰/۰۲/۲۸   | ۱۸                 | .            | .              | .              | ۶,۳۱۲,۳۲۸,۷۸۱   | .           | ۶,۳۱۲,۳۲۸,۷۸۱   |
| صکوک مریجه سایپا ۱۱۲-۳ماهه ۱۶٪         | ۱۳۹۹/۱۲/۲۰       | ۱۴۰۱/۱۲/۲۰   | ۱۶                 | .            | .              | .              | ۱,۶۲۴,۰۳۳,۳۵۲   | .           | ۱,۶۲۴,۰۳۳,۳۵۲   |
| کوتاه مدت-۱-۵۶۶۰۱-۱۱۲۷۰۵۶۶۰۲۰-کارآفرین | ۱۳۹۹/۱۰/۱۶       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۵,۰۰۸,۰۸۶       | .           | ۵,۰۰۸,۰۸۶       |
| کوتاه مدت-۲۱۶۲۸۷۷۶۳۰۰۰-صادرات          | ۱۳۹۹/۱۰/۱۸       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۱۶,۳۹۴          | .           | ۱۶,۳۹۴          |
| کوتاه مدت-۶۰۹-۹۸۸۴۰۶-۴۷۰-پارسیان       | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۲۵,۲۰۵          | .           | ۲۵,۲۰۵          |
| کوتاه مدت-۷۰۰۸۴۳۱۶۶۸۴۷-شهر             | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۳۷,۱۵۲          | .           | ۳۷,۱۵۲          |
| مریجه گندم ۲-واجدشرایط خاص ۱۴۰۰        | ۱۴۰۰/۰۲/۲۰       | ۱۴۰۰/۰۸/۲۰   | ۱۷                 | .            | .              | .              | ۱,۶۱۱,۷۳۸,۲۴۳   | .           | ۱,۶۱۱,۷۳۸,۲۴۳   |
| کوتاه مدت-۵-۹۱۵۰۰۵-۳۳۵۰۲۰-آینده        | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۳۰۷,۴۳۱,۳۹۶     | .           | ۳۰۷,۴۳۱,۳۹۶     |
| کوتاه مدت-۱-۱۱۳,۹۹۶۷,۶۶۹۱۴۷-گردشگری    | ۱۳۹۹/۱۰/۰۱       | -            | .                  | .            | .              | .              | ۳۹,۸۷۸          | .           | ۳۹,۸۷۸          |
| جمع                                    |                  |              |                    | ۱۸۳,۲۸۲,۷۶۷- | ۷۰,۵۵۳,۱۸۳,۰۸۱ | ۷۰,۳۶۹,۹۰۰,۳۱۴ | ۴۲۹,۵۱۰,۹۳۵,۲۷۱ | ۶۱,۱۴۵,۶۵۴- | ۴۲۹,۴۴۹,۷۸۹,۶۱۷ |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰              |                   |                 |           | 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   |                                  |
| ۲۰,۸۶۰,۴۰۶,۷۴۱          | ۲۳,۵۹۹,۰۲۵,۱۵۳    | ۴۴,۴۵۹,۴۳۱,۸۹۴  | ۷۹۹,۱۱۲   | .                       | .              | .              | .       | کشتیرانی ایران                   |
| ۱۷,۸۵۰,۲۶۶,۳۹۱          | ۲۴,۵۴۸,۹۲۹,۷۵۱    | ۴۲,۳۹۳,۱۹۶,۱۴۲  | ۱,۴۲۳,۲۳۶ | .                       | .              | .              | .       | پتروشیمی خلیج فارس               |
| ۱۶,۰۲۳,۵۵۲,۱۵۹          | ۲۲,۰۵۷,۴۴۳,۷۸۲    | ۳۸,۰۸۰,۹۹۵,۹۴۱  | ۱,۵۷۰,۰۰۰ | .                       | .              | .              | .       | گروه بهمن                        |
| ۱۵,۰۱۵,۰۹۱,۳۷۸          | ۲۱,۲۳۳,۸۲۶,۵۶۴    | ۳۶,۲۴۸,۹۱۷,۹۴۲  | ۱,۷۴۴,۰۰۰ | .                       | .              | .              | .       | فولاد مبارکه                     |
| ۱۱,۰۳۹,۱۴۲,۳۶۵          | ۱۰,۱۰۲,۰۶۵,۰۹,۲۷۰ | ۱۱۲,۲۴۵,۶۵۱,۶۳۵ | ۱۳۴,۷۶۳   | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۷بودجه۹۸-۰۰۰۷۱۹      |
| ۷,۷۸۸,۷۴۹,۹۶۸           | ۴۲,۳۰۷,۹۲۱,۴۸۸    | ۵۰,۰۹۶,۶۷۱,۴۵۶  | ۳,۸۲۴     | ۳۹۳,۸۹۴,۹۴۴-            | ۵۰,۴۹۰,۵۶۶,۴۰۰ | ۵۰,۰۹۶,۶۷۱,۴۵۶ | ۳,۸۲۴   | صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر    |
| ۶,۵۲۵,۶۲۴,۶۰۵           | ۱۱۸,۸۹۲,۲۹۱,۳۲۶   | ۱۲۵,۴۱۷,۹۱۵,۹۳۱ | ۱۵۸,۵۷۳   | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۱۲بودجه۹۸-۰۰۱۱۱۱     |
| ۵,۵۸۹,۱۲۸,۳۹۶           | ۵۸,۰۴۰,۰۲۱,۷۹۸    | ۶۳,۶۲۹,۱۵۰,۱۹۴  | ۷۸,۰۳۳    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۲۳بودجه۹۷-۰۰۰۸۲۴     |
| ۵,۰۳۴,۴۲۷,۲۱۷           | ۷,۲۴۶,۴۹۱,۶۱۳     | ۱۲,۲۸۰,۹۱۸,۸۳۰  | ۳۷۹,۴۶۲   | .                       | .              | .              | .       | سرمایه گذاری تامین اجتماعی       |
| ۵,۰۰۲,۸۴۳,۷۵۰           | ۴۴,۹۹۱,۸۴۳,۷۵۰    | ۴۹,۹۹۴,۶۸۷,۵۰۰  | ۵۰,۰۰۰    | .                       | .              | .              | .       | صکوک مریحه سایپا۱۱۲-۳ماهه ۱۶٪    |
| ۴,۳۹۲,۹۷۱,۳۶۶           | ۱۵۶,۰۲۸,۵۲۲,۱۸۲   | ۱۶۰,۴۲۱,۴۹۳,۵۴۸ | ۲۱۹,۷۹۷   | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۱۴بودجه۹۸-۰۱۰۳۱۸     |
| ۳,۹۷۶,۱۳۲,۱۰۹           | ۳۷,۷۷۱,۱۳۵,۵۹۱    | ۴۱,۷۴۷,۲۶۷,۷۰۰  | ۴۸,۴۶۵    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۲۲بودجه۹۷-۰۰۰۴۲۸     |
| ۳,۸۹۷,۱۱۶,۳۷۶           | ۲۴,۱۳۲,۹۰۵,۱۱۹    | ۲۸,۰۳۰,۰۲۱,۴۹۵  | ۲۸,۹۰۰    | .                       | .              | .              | .       | مرایحه گندم ۲-واجدشرایط خاص ۱۴۰۰ |
| ۳,۶۲۴,۶۲۰,۰۳۸           | ۳۶,۵۳۲,۰۵۸,۸۶۴    | ۴۰,۱۵۶,۶۷۸,۹۰۲  | ۴۸,۶۲۱    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۲۱بودجه۹۷-۰۰۰۷۲۸     |
| ۳,۶۲۴,۱۸۹,۱۴۳           | ۴۷,۶۵۸,۵۵۱,۵۶۱    | ۵۱,۲۸۲,۷۴۰,۷۰۴  | ۸۹۰,۵۶۱   | ۶,۳۲۰,۲۷۵,۴۹۳           | ۴۴,۹۶۲,۴۶۵,۲۱۱ | ۵۱,۲۸۲,۷۴۰,۷۰۴ | ۸۹۰,۵۶۱ | مواداولیه داروپخش                |
| ۲,۶۸۰,۴۴۵,۴۳۲           | ۵۱,۶۰۶,۱۱۸,۳۴۹    | ۵۴,۲۸۶,۵۶۳,۷۸۱  | ۷۷,۵۵۲    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۱۸بودجه۹۸-۰۱۰۶۱۴     |
| ۲,۳۵۰,۹۴۳,۹۱۳           | ۱۷,۵۰۲,۸۳۶,۶۱۳    | ۱۹,۸۵۳,۷۸۰,۵۲۶  | ۲۴۶,۰۳۴   | .                       | .              | .              | .       | پدیده شیمی قرن                   |
| ۲,۲۹۱,۹۹۵,۱۰۴           | ۳۰,۲۸۴,۸۱۰,۸۴۵    | ۳۲,۵۷۶,۸۰۵,۹۴۹  | ۴۱,۲۳۸    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۱۰بودجه۹۸-۰۰۱۰۰۶     |
| ۲,۲۷۱,۳۳۵,۳۰۴           | ۲۰,۲۱۶,۲۷۵,۱۳۶    | ۲۲,۴۸۷,۶۱۰,۴۴۰  | ۲۶,۰۰۰    | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۵بودجه۹۸-۰۰۰۴۲۲      |
| ۲,۱۸۶,۱۹۶,۱۲۱           | ۱۱۰,۸۴۸,۲۳۵,۷۰۷   | ۱۱۳,۰۳۴,۴۳۱,۸۲۸ | ۱۵۷,۷۱۳   | .                       | .              | .              | .       | اسنادخزانه-م۱۷بودجه۹۸-۰۱۰۵۱۲     |

**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰              |                 |                 |           | 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  |                                  |
| ۱,۲۶۶,۰۸۲,۵۲۳           | ۱۱,۶۳۴,۹۷۳,۵۷۹  | ۱۲,۹۰۱,۰۵۶,۱۰۲  | ۱۴,۸۴۰    | .                       | .              | .              | .      | اسنادخزانه-م-۱۶ بودجه ۹۷-۴۰۷-۰۰۰ |
| ۱,۰۵۷,۸۱۲,۹۹۸           | ۱۰,۴۳۹,۲۳۰,۲۶۷  | ۱۱,۴۹۷,۰۴۳,۲۶۵  | ۱۳,۴۸۰    | .                       | .              | .              | .      | اسنادخزانه-م-۱۳ بودجه ۹۷-۵۱۸-۰۰۰ |
| ۸۴۲,۹۹۰,۸۱۷             | ۵,۲۹۹,۸۱۸,۴۴۴   | ۶,۱۴۲,۸۰۹,۲۶۱   | ۵۰,۰۰۰    | .                       | .              | .              | .      | ملی کشت و صنعت و دامپروری پارس   |
| ۳۷۴,۹۰۸,۹۱۰             | ۴۳,۱۷۲,۵۳۹,۳۴۷  | ۴۳,۵۴۷,۴۴۸,۲۵۷  | ۳,۲۲۹,۱۵۹ | .                       | .              | .              | .      | سرمایه گذاری غدیر                |
| ۳۵۱,۳۵۶,۶۹۰             | ۶۴۹,۰۶۶,۴۲۵     | ۱,۰۰۰,۴۲۳,۱۱۵   | ۱۵,۶۵۸    | ۱۳۶,۲۶۳,۴۸۱             | ۸۶۴,۱۵۹,۶۳۴    | ۱,۰۰۰,۴۲۳,۱۱۵  | ۱۵,۶۵۸ | پتروشیمی بوعلی سینا              |
| ۲۷۴,۲۸۲,۴۷۰             | ۴۰۲,۶۹۹,۸۷۰     | ۶۷۶,۹۸۲,۳۴۰     | ۲۵,۵۴۵    | .                       | .              | .              | .      | سرمایه گذاری سیمان تامین         |
| ۲۶۲,۶۶۳,۵۷۸             | ۲۳۳,۴۲۱,۶۷۳,۴۵۹ | ۲۳۳,۶۸۴,۳۳۷,۰۳۷ | ۴۰۷,۹۰۰   | .                       | .              | .              | .      | اسنادخزانه-م-۲۰ بودجه ۹۸-۸۰۶-۰۲۰ |
| ۲۴۲,۷۸۶,۰۹۵             | ۱۵,۰۰۴,۹۷۹,۵۷۹  | ۱۵,۲۴۷,۷۶۵,۶۷۴  | ۳۱۸,۰۰۰   | .                       | .              | .              | .      | انفورماتیک                       |
| ۲۳۷,۴۲۷,۶۷۸             | ۲۱,۱۰۱,۳۰۴,۸۴۵  | ۲۱,۳۳۸,۷۳۲,۵۲۳  | ۲۱,۳۴۱    | ۱۵۳,۲۸۶,۲۵۰             | ۲۱,۱۸۵,۴۴۶,۲۷۳ | ۲۱,۳۳۸,۷۳۲,۵۲۳ | ۲۱,۳۴۱ | مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۴۰۱۰  |
| ۲۱۷,۸۳۴,۹۵۶             | ۹۰۷,۷۳۰,۸۶۷     | ۱,۱۲۵,۵۶۵,۸۲۳   | ۹۰,۱۶۲    | .                       | .              | .              | .      | سرمایه گذاری مالی سپهصادرات      |
| ۲۱۷,۶۲۰,۰۱۵             | ۲۹۸,۷۰۴,۱۵۴     | ۵۱۶,۳۲۴,۱۶۹     | ۳,۲۰۹     | .                       | .              | .              | .      | پلیمر آریا ساسول                 |
| ۹۲,۷۲۳,۸۳۷              | ۸۹,۳۲۷,۹۱۷      | ۱۸۲,۰۵۱,۷۵۴     | ۲,۲۴۶     | .                       | .              | .              | .      | صنعتی زر ماکارون                 |
| ۷۴,۹۶۷,۳۸۷              | ۹۳,۴۱۳,۱۱۶      | ۱۶۸,۳۸۰,۵۰۳     | ۴۲,۴۳۷    | .                       | .              | .              | .      | بهساز کاشانه تهران               |
| ۶۷,۹۹۵,۰۲۵              | ۶۰,۰۶۴,۹۴۸      | ۱۲۸,۰۵۹,۹۷۳     | ۳,۸۷۳     | .                       | .              | .              | .      | تولید نیروی برق آبادان           |
| ۶۱,۴۱۶,۵۰۸              | ۱۵۲,۷۹۷,۹۱۸     | ۲۱۴,۲۱۴,۴۲۶     | ۱۴,۶۸۴    | .                       | .              | .              | .      | تامین سرمایه امین                |
| ۴۹,۵۸۶,۶۷۱              | ۹۵,۳۰۷,۰۷۹      | ۹۹۹,۸۹۳,۷۵۰     | ۱,۰۰۰     | .                       | .              | .              | .      | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ-۱۰۶        |
| ۴۰,۹۱۸,۹۲۳              | ۹۵,۶۷۶,۹۸۵      | ۱۳۶,۵۹۵,۹۰۸     | ۵,۱۶۹     | .                       | .              | .              | .      | برق و انرژی پیوندگستر پارس       |
| ۲۹,۰۹۰,۴۲۹              | ۱۱,۲۱۱,۵۶۸      | ۴۰,۳۰۱,۹۹۷      | ۱,۷۷۸     | .                       | .              | .              | .      | پتروشیمی ارومیه                  |
| ۲۲,۴۹۱,۷۹۷              | ۱۵,۹۷۴,۹۲۰      | ۳۸,۴۶۶,۷۱۷      | ۴,۹۷۲     | .                       | .              | .              | .      | لیزینگ پارسینا                   |
| ۲۱,۷۳۱,۰۹۷              | ۹۶۷,۸۳۸,۷۵۲     | ۹۸۹,۵۶۹,۸۴۹     | ۱,۰۰۰     | .                       | .              | .              | .      | مراجعه عام دولت ۳-ش.خ-۱۰۵        |



**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

سود(زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰              |                   |                   |            | 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   |                               |
| ۲۱,۱۷۱,۵۸۷              | ۲۰,۴۷۷,۱۳۳        | ۴۱,۶۴۸,۷۲۰        | ۹۷۴        | .                       | .               | .               | .       | کشاورزی و دامپروری ملارد شیر  |
| ۱۳,۴۳۲,۱۰۷              | ۲۲,۳۶۸,۲۱۴        | ۳۵,۸۰۰,۳۲۱        | ۹۳۱        | .                       | .               | .               | .       | توسعه مسیر برق گیلان          |
| ۱۲,۰۹۵,۵۵۷              | ۹۷۰,۸۰۰,۰۰۰       | ۹۸۲,۸۹۵,۵۵۷       | ۱,۰۰۰      | .                       | .               | .               | .       | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ.۰۰۰۶    |
| ۶,۷۰۸,۰۲۲               | ۳,۵۴۱,۸۷۰         | ۱۰,۲۴۹,۸۹۲        | ۵۹۰        | .                       | .               | .               | .       | تهیه توزیع غذای دنا آفرین فدک |
| ۱,۴۹۱,۸۲۱               | ۹۳۵,۵۵۴           | ۲,۴۲۷,۳۷۵         | ۲۲۸        | .                       | .               | .               | .       | سرمایه گذاری پویا             |
| ۶۱۷,۹۶۲                 | ۱,۵۱۲,۸۲۶         | ۲,۱۳۰,۷۸۸         | ۸۶۴        | .                       | .               | .               | .       | توسعه و عمران امید            |
| ۱,۳۷۸,۶۴۰-              | ۱۸۴,۱۹۲,۲۵۴       | ۱۸۲,۸۱۳,۶۱۴       | ۱۰,۵۳۹     | .                       | .               | .               | .       | تامین سرمایه بانک ملت         |
| ۱۲,۹۲۱,۱۴۴-             | ۱,۰۳۲,۸۱۲,۷۶۹     | ۱,۰۱۹,۸۹۱,۶۲۵     | ۱,۰۰۰      | .                       | .               | .               | .       | مراجعه کرمان موتور ۳۰۶-۲۰۲۰۱۴ |
| ۱۵,۸۱۱,۴۲۵-             | ۲۳۰,۰۶۵,۱۸۶       | ۲۱۴,۲۵۳,۷۶۱       | ۵,۵۰۰      | .                       | .               | .               | .       | سرمایه گذاری کشاورزی کوثر     |
| ۱۰۴,۹۴۹,۱۸۸-            | ۳۳,۵۱۹,۴۱۹,۵۰۳    | ۳۳,۴۱۴,۴۷۰,۳۱۵    | ۳,۶۱۸,۱۹۱  | .                       | .               | .               | .       | بانک ملت                      |
| ۵۱۰,۶۸۰,۲۶۳-            | ۲۱,۰۴۴,۱۵۹,۸۷۹    | ۲۰,۵۳۳,۴۷۹,۶۱۶    | ۱۵۷,۸۴۶    | .                       | .               | .               | .       | پارس دارو                     |
| ۶۳۷,۳۹۲,۶۱۶-            | ۳۵,۷۸۱,۷۰۷,۹۵۲    | ۳۵,۱۴۴,۳۱۵,۳۳۶    | ۵۳۸,۹۵۰    | .                       | .               | .               | .       | دارویی تامین                  |
| ۵,۶۲۷,۴۸۰,۶۱۶-          | ۵۶,۴۰۱,۲۷۸,۳۳۴    | ۵۰,۷۷۳,۷۹۷,۷۱۸    | ۲,۰۰۰,۰۰۰  | .                       | .               | .               | .       | ملی مس                        |
| ۶,۵۵۵,۵۳۳,۰۸۵-          | ۲۲,۰۱۳,۹۴۷,۴۹۵    | ۱۵,۴۵۸,۴۱۴,۴۱۰    | ۱,۰۰۰,۰۰۰  | .                       | .               | .               | .       | گل گهر                        |
| ۹,۶۲۳,۵۴۸,۸۷۹-          | ۴۴,۴۳۵,۲۲۰,۱۷۵    | ۳۴,۸۱۱,۶۷۱,۲۹۶    | ۱,۵۱۶,۰۰۰  | .                       | .               | .               | .       | توسعه صنایع بهشهر             |
| ۱۰,۷۳۹,۷۷۰,۴۷۴-         | ۳۹,۶۷۷,۸۵۱,۷۶۳    | ۲۸,۹۳۸,۰۸۱,۲۸۹    | ۲,۰۳۲,۰۰۰  | .                       | .               | .               | .       | چادرملو                       |
| ۱۹,۳۳۹,۴۹۶,۷۹۸-         | ۶۷,۶۱۳,۸۱۲,۲۷۰    | ۴۸,۲۷۴,۳۱۵,۴۷۲    | ۱,۵۰۸,۰۶۸  | .                       | .               | .               | .       | فولاد خوزستان                 |
| ۹۴,۷۱۸,۴۲۰,۲۰۸          | ۱,۶۶۴,۴۲۹,۱۹۱,۶۷۸ | ۱,۷۵۹,۱۴۷,۶۱۱,۸۸۶ | ۲۴,۷۸۵,۰۱۸ | ۶,۲۱۵,۹۳۰,۲۸۰           | ۱۱۷,۵۰۲,۶۳۷,۵۱۸ | ۱۲۳,۷۱۸,۵۶۷,۷۹۸ | ۹۳۱,۳۸۴ | 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

**قابل معامله دارا الگوربتم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق بهادار

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰                    |                   |                   |            | 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      |                                  |
| ۳۴,۲۰۴,۲۰۸,۲۹۶                | ۲۳۳,۵۶۰,۲۵۰,۵۹۸   | ۲۶۷,۷۶۴,۴۵۸,۸۹۴   | ۲۴۵,۷۰۰    | ۰                             | ۲۶۷,۷۶۴,۴۵۸,۸۹۴   | ۲۶۷,۷۶۴,۴۵۸,۸۹۴   | ۲۴۵,۷۰۰    | مراجعه عام دولت ۴-ش خ ۱۰۶        |
| ۲۱,۹۶۵,۶۱۶,۳۶۸                | ۳۹۸,۹۹۸,۸۰۰,۰۰۰   | ۴۲۰,۹۶۴,۴۱۶,۳۶۸   | ۴۱۱,۰۰۰    | ۱۰۵۰۷,۳۶۵,۱۹۴-                | ۴۳۱,۴۷۱,۷۸۱,۵۶۲   | ۴۲۰,۹۶۴,۴۱۶,۳۶۸   | ۴۱۱,۰۰۰    | مراجعه عام دولت ۴-ش خ ۱۰۶        |
| ۱۹,۷۴۶,۴۲۰,۳۱۳                | ۳۶۸,۵۸۳,۱۸۲,۱۸۷   | ۳۸۸,۳۲۹,۶۰۲,۵۰۰   | ۴۰۰,۰۰۰    | ۲۰۰۹,۶۳۵,۶۸۸                  | ۳۸۶,۳۱۹,۹۶۶,۸۱۲   | ۳۸۸,۳۲۹,۶۰۲,۵۰۰   | ۴۰۰,۰۰۰    | منفعت دولت ۵-ش خاص سایر ۱۰۸      |
| ۱۶,۸۴۴,۱۰۱,۴۰۹                | ۵۴۸,۷۶۴,۵۷۲,۴۳۴   | ۵۶۵,۶۰۸,۶۷۳,۸۴۳   | ۵۶۷,۰۰۰    | ۱,۲۸۸,۵۵۷,۴۰۷-                | ۵۶۶,۸۹۷,۲۳۱,۲۵۰   | ۵۶۵,۶۰۸,۶۷۳,۸۴۳   | ۵۶۷,۰۰۰    | مراجعه عام دولت ۳-ش خ ۱۰۵        |
| ۱۶,۴۷۴,۵۸۶,۲۹۵                | ۲۰۲,۳۰۸,۹۵۲,۰۰۰   | ۲۱۸,۷۸۳,۵۳۸,۲۹۵   | ۲۰۹,۲۰۰    | ۰                             | ۲۱۸,۷۸۳,۵۳۸,۲۹۵   | ۲۱۸,۷۸۳,۵۳۸,۲۹۵   | ۲۰۹,۲۰۰    | مراجعه عام دولت ۴-ش خ ۱۰۰۹       |
| ۴,۷۴۸,۴۶۷,۵۴۰                 | ۱۴۹,۰۸۳,۶۴۵,۳۳۵   | ۱۵۳,۸۳۲,۱۱۲,۸۷۵   | ۱۵۷,۰۰۰    | ۱۰,۹۸۸,۰۰۸,۰۶۲-               | ۱۶۴,۸۲۰,۱۲۰,۹۳۷   | ۱۵۳,۸۳۲,۱۱۲,۸۷۵   | ۱۵۷,۰۰۰    | مراجعه عام دولت ۴-ش خ ۱۰۷        |
| ۴,۷۱۹,۱۴۴,۵۰۰                 | ۳۵,۲۷۳,۶۰۵,۵۰۰    | ۳۹,۹۹۲,۷۵۰,۰۰۰    | ۴۰,۰۰۰     | ۰                             | ۳۹,۹۹۲,۷۵۰,۰۰۰    | ۳۹,۹۹۲,۷۵۰,۰۰۰    | ۴۰,۰۰۰     | مشارکت دولت -بشرایط خاص ۱۰۱۰۴۰   |
| ۴,۷۷۱,۴۲۸,۳۲۵-                | ۱۴۹,۷۴۵,۱۴۷,۰۷۵   | ۱۴۴,۹۷۳,۷۱۸,۷۵۰   | ۱۴۵,۰۰۰    | ۰                             | ۱۴۴,۹۷۳,۷۱۸,۷۵۰   | ۱۴۴,۹۷۳,۷۱۸,۷۵۰   | ۱۴۵,۰۰۰    | مراجعه کرمان موتور ۲۰۳۰۶۱۴۰      |
| ۴,۴۶۰,۰۰۴,۷۶۲                 | ۱۵۰,۱۳,۶۹۳,۲۳۹    | ۱۹,۴۷۳,۷۴۰,۰۰۱    | ۱۹,۰۰۰     | ۲,۷۲۸,۶۵۳,۲۳۶-                | ۲۲,۲۰۲,۳۹۳,۲۳۷    | ۱۹,۴۷۳,۷۴۰,۰۰۱    | ۱۹,۰۰۰     | سکه تمام بهار تحویل ۱روزه صادرات |
| ۴۲۶,۵۶۲,۸۶۲                   | ۹,۹۶۸,۴۶۶,۳۰۲     | ۱۰,۳۹۵,۰۲۹,۱۶۴    | ۹۸۶,۵۳۳    | ۴۲۶,۵۶۲,۸۶۲                   | ۹,۹۶۸,۴۶۶,۳۰۲     | ۱۰,۳۹۵,۰۲۹,۱۶۴    | ۹۸۶,۵۳۳    | بانک خاورمیانه                   |
| ۲۷۹,۰۱۵,۸۳۶                   | ۱۰,۰۰۴,۷۷۹,۳۳۱    | ۱۰,۰۲۸۳,۷۹۵,۱۶۷   | ۸۵,۰۰۰     | ۲۷۹,۰۱۵,۸۳۶                   | ۱۰,۰۰۴,۷۷۹,۳۳۱    | ۱۰,۰۲۸۳,۷۹۵,۱۶۷   | ۸۵,۰۰۰     | ملی کشت و صنعت و دامپروری پارس   |
| ۸۷,۷۷۶,۱۷۴                    | ۳۸۴,۶۶۶,۲۸۸       | ۴۷۲,۴۴۲,۴۶۲       | ۲۶,۵۴۴     | ۵۸,۰۴,۹۳۴                     | ۴۶۶,۶۳۷,۵۲۸       | ۴۷۲,۴۴۲,۴۶۲       | ۲۶,۵۴۴     | مدیریت سرمایه گذاری کوثرپهن      |
| ۲۳,۸۲۵,۳۸۵                    | ۳۵,۵۵۳,۷۸۶        | ۵۹,۳۷۹,۱۷۱        | ۱,۴۲۱      | ۴,۷۰۳,۷۷۵                     | ۵۴,۶۷۵,۳۹۶        | ۵۹,۳۷۹,۱۷۱        | ۱,۴۲۱      | رایان هم افزا                    |
| ۱۵,۱۵۸,۹۲۲                    | ۱۵,۸۳۳,۳۵۲        | ۳۰,۹۹۲,۲۷۴        | ۶۳۳        | ۱۳,۲۶۹,۲۷۹                    | ۱۷,۷۲۲,۹۹۵        | ۳۰,۹۹۲,۲۷۴        | ۶۳۳        | صنایع چوب خزر کاسپین             |
| ۱۱,۲۲۱,۷۲۲                    | ۷۲,۱۹۵,۴۹۳        | ۸۳,۴۱۷,۲۱۵        | ۱,۸۱۳      | ۱۱,۲۲۱,۷۲۲                    | ۷۲,۱۹۵,۴۹۳        | ۸۳,۴۱۷,۲۱۵        | ۱,۸۱۳      | سپیدار سیستم آسیا                |
| ۲,۵۳۳,۴۲۰,۳۵۲-                | ۹,۸۸۵,۴۱۴,۱۵۲     | ۷,۳۵۱,۹۹۳,۸۰۰     | ۴۰۰,۰۰۰    | ۲,۵۳۳,۴۲۰,۳۵۲-                | ۹,۸۸۵,۴۱۴,۱۵۲     | ۷,۳۵۱,۹۹۳,۸۰۰     | ۴۰۰,۰۰۰    | یاما                             |
| ۵,۲۲۷,۶۴۴,۷۳۱-                | ۱۹,۵۶۱,۸۲۵,۷۳۱    | ۱۴,۳۳۴,۲۰۱,۰۰۰    | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | ۵,۸۷۲,۸۴۷,۴۰۰-                | ۲۰,۲۰۷,۰۴۸,۴۰۰    | ۱۴,۳۳۴,۲۰۱,۰۰۰    | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | فولاد مبارکه                     |
| ۶,۳۷۸,۹۶۱,۰۷۸-                | ۲۰,۰۷۲,۹۹۳,۸۷۸    | ۱۳,۶۹۴,۰۳۲,۸۰۰    | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | ۴,۴۱۱,۵۹۳,۹۰۰-                | ۱۸,۱۰۵,۶۲۶,۷۰۰    | ۱۳,۶۹۴,۰۳۲,۸۰۰    | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | سرمایه گذاری غدیر                |
| ۸,۶۶۰,۶۰۱,۲۴۶-                | ۲۳,۳۳۲,۷۷۹,۲۴۶    | ۱۴,۶۷۲,۱۷۸,۰۰۰    | ۶,۰۰۰,۰۰۰  | ۵,۴۵۰,۰۶۰,۹۷۲-                | ۲۰,۱۲۲,۲۳۸,۹۷۲    | ۱۴,۶۷۲,۱۷۸,۰۰۰    | ۶,۰۰۰,۰۰۰  | بانک تجارت                       |
| ۱۰,۹۷۷,۱۸۰,۴۵۶-               | ۲۹,۳۱۷,۴۰۲,۹۵۶    | ۱۸,۳۴۰,۲۲۲,۵۰۰    | ۵,۰۰۰,۰۰۰  | ۵,۷۱۵,۷۸۷,۵۰۰-                | ۲۴,۰۵۶,۰۱۰,۰۰۰    | ۱۸,۳۴۰,۲۲۲,۵۰۰    | ۵,۰۰۰,۰۰۰  | بانک ملت                         |
| ۳۶,۶۱۴,۹۴۵,۳۱۶-               | ۱۱۰,۱۲۴,۹۴۲,۸۱۶   | ۷۳,۵۰۹,۹۹۷,۵۰۰    | ۸۵۰,۰۰۰    | ۱۸,۶۸۱,۶۷۸,۶۷۵-               | ۹۲,۱۹۱,۶۷۶,۱۷۵    | ۷۳,۵۰۹,۹۹۷,۵۰۰    | ۸۵۰,۰۰۰    | پارس دارو                        |
| ۵۹,۹۹۱,۳۳۴,۸۱۸-               | ۱۹۹,۹۴۷,۱۰۴,۳۹۸   | ۱۳۹,۹۵۵,۷۶۹,۵۸۰   | ۳,۱۹۰      | ۳۵,۳۱۷,۸۳۶,۱۸۰-               | ۱۷۵,۲۷۳,۶۰۵,۷۶۰   | ۱۳۹,۹۵۵,۷۶۹,۵۸۰   | ۳,۱۹۰      | صندوق سرمایه گذاری مشترک خوارزمی |
| ۱۱,۱۴۹,۳۴۴,۹۳۸-               | ۴,۵۳۴,۰۵۵,۸۰۶,۰۹۷ | ۲,۵۲۲,۹۰۶,۴۶۲,۱۵۹ | ۱۸,۳۴۹,۰۳۴ | ۱۰۰,۷۴۵,۵۹۴,۷۸۲-              | ۲,۶۲۳,۶۵۲,۰۵۶,۹۴۱ | ۲,۵۲۲,۹۰۶,۴۶۲,۱۵۹ | ۱۸,۳۴۹,۰۳۴ | جمع                              |

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

**قابل معامله دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| سهام                           | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |                  |                |          | طی دوره        |                  |                |                |
|--------------------------------|----------------|------------------|----------------|----------|----------------|------------------|----------------|----------------|
|                                | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | جمع مبلغ | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش     | جمع مبلغ       |
| کشتریانی جمهوری اسلامی ایران   | .              | .                | ۲۰,۸۶۰,۴۰۶,۷۴۱ | ۴/۰۰٪    | .              | .                | .              | .              |
| صنایع پتروشیمی خلیج فارس       | .              | .                | ۱۷,۸۵۰,۲۶۶,۳۹۱ | ۳/۴۳٪    | .              | .                | .              | .              |
| گروه بهمن                      | .              | .                | ۱۶,۰۲۳,۵۵۲,۱۵۹ | ۳/۲۰٪    | ۶۲۸,۰۰۰,۰۰۰    | .                | .              | .              |
| فولاد مبارکه اصفهان            | .              | .                | ۱۵,۰۱۵,۰۹۱,۳۷۸ | ۱/۹۰٪    | ۱۱۲,۵۰۰,۰۰۰    | ۲۴/۸۰٪           | ۵,۸۷۲,۸۴۷,۴۰۰- | ۵,۸۷۲,۸۴۷,۴۰۰- |
| صندوق سرمایه گذاری همیان سپهر  | .              | .                | ۷,۷۸۸,۷۴۹,۹۶۸  | ۱/۴۹٪    | .              | ۱/۶۶٪            | ۳۹۳,۸۹۴,۹۴۴-   | ۳۹۳,۸۹۴,۹۴۴-   |
| سرمایه گذاری تامین اجتماعی     | .              | .                | ۵,۴۸۹,۲۲۷,۲۱۷  | ۱/۰۵٪    | ۴۵۴,۸۰۰,۰۰۰    | .                | .              | .              |
| تولید مواد اولیه داروپخش       | .              | .                | ۳,۶۲۴,۱۸۹,۱۴۳  | ۰/۷۰٪    | .              | -۲۶/۹۹٪          | ۶,۳۲۰,۲۷۵,۴۹۳  | ۶,۳۲۰,۲۷۵,۴۹۳  |
| پدیده شیمی قرن                 | .              | .                | ۲,۳۵۰,۹۴۳,۹۱۳  | ۰/۴۵٪    | .              | .                | .              | .              |
| ملی کشت و صنعت و دامپروری پارس | .              | .                | ۸۴۲,۹۹۰,۸۱۷    | ۰/۲۲٪    | .              | -۱/۱۸٪           | ۲۷۹,۰۱۵,۸۳۶    | ۲۷۹,۰۱۵,۸۳۶    |
| سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)     | .              | .                | ۳۷۴,۹۰۸,۹۱۰    | -۱/۱۵٪   | .              | ۱۸/۶۳٪           | ۴,۴۱۱,۵۹۳,۹۰۰- | ۴,۴۱۱,۵۹۳,۹۰۰- |
| پتروشیمی بوعلی سینا            | .              | .                | ۳۵۱,۳۵۶,۶۹۰    | ۰/۰۷٪    | .              | -۰/۵۸٪           | ۱۳۶,۲۶۳,۴۸۱    | ۱۳۶,۲۶۳,۴۸۱    |
| خدمات انفورماتیک               | .              | .                | ۲۴۲,۷۸۶,۰۹۵    | ۰/۰۵٪    | .              | .                | .              | .              |
| سرمایه گذاری سیمان تامین       | .              | .                | ۲۷۴,۲۸۲,۴۷۰    | ۰/۰۶٪    | ۱۹,۶۶۹,۶۵۰     | .                | .              | .              |
| سرمایه گذاری مالی سپهرصادرات   | .              | .                | ۲۱۷,۸۳۴,۹۵۶    | ۰/۰۴٪    | .              | .                | .              | .              |
| پلیمر آریا ساسول               | .              | .                | ۲۱۷,۶۲۰,۰۱۵    | ۰/۰۵٪    | ۲۸,۰۴۶,۶۶۰     | .                | .              | .              |
| صنعتی زر ماکارون               | .              | .                | ۹۳,۵۲۳,۴۱۳     | ۰/۰۲٪    | ۷۹۹,۵۷۶        | .                | .              | .              |

**قابل معامله دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| سهام                          | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |                  |            |          | طی دوره        |                  |            |          |
|-------------------------------|----------------|------------------|------------|----------|----------------|------------------|------------|----------|
|                               | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش | جمع مبلغ | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | درآمد فروش | جمع مبلغ |
| بانک ملت                      | ۰              | ۵,۷۱۵,۷۸۷,۵۰۰-   | ۰          | ۰        | ۲۴/۱۴٪         | ۵,۷۱۵,۷۸۷,۵۰۰-   | ۰          | ۰        |
| بهساز کاشانه تهران            | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| تولید نیروی برق آبادان        | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| تامین سرمایه امین             | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| برق و انرژی پیوندگستر پارس    | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| پتروشیمی ارومیه               | ۰              | ۰                | ۰          | ۴۵۷,۲۰۱  | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| لیزینگ پارسیان                | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| کشاورزی و دامپروری ملارد شیر  | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| توسعه مسیر برق گیلان          | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| تهیه توزیع غذای دنا آفرین فدک | ۰              | ۰                | ۰          | ۸,۶۷۲    | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| سرمایه گذاری پویا             | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| توسعه و عمران امید            | ۰              | ۰                | ۰          | ۰        | ۰/۰٪           | ۰                | ۰          | ۰        |
| باما                          | ۰              | ۲,۵۳۳,۴۲۰,۳۵۲-   | ۰          | ۰        | ۱۰/۷۰٪         | ۲,۵۳۳,۴۲۰,۳۵۲-   | ۰          | ۰        |
| بانک تجارت                    | ۰              | ۵,۴۵۰,۰۶۰,۹۷۲-   | ۰          | ۰        | ۲۳/۰۲٪         | ۵,۴۵۰,۰۶۰,۹۷۲-   | ۰          | ۰        |
| بانک خاورمیانه                | ۰              | ۴۲۶,۵۶۲,۸۶۲      | ۰          | ۰        | -۱/۸۰٪         | ۴۲۶,۵۶۲,۸۶۲      | ۰          | ۰        |
| رایان هم افزا                 | ۰              | ۴,۷۰۳,۷۷۵        | ۰          | ۰        | -۰/۰۲٪         | ۴,۷۰۳,۷۷۵        | ۰          | ۰        |

**قابل معامله دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| سهام                             | ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |                  |                 |                     | طی دوره        |                  |                 |                     |
|----------------------------------|----------------|------------------|-----------------|---------------------|----------------|------------------|-----------------|---------------------|
|                                  | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | جمع مبلغ        | درصد از کل درآمد ها | درآمد سود سهام | درآمد تغییر ارزش | جمع مبلغ        | درصد از کل درآمد ها |
| سپیدار سیستم آسیا                | ۰              | ۱۱,۲۲۱,۷۲۲       | ۱۱,۲۲۱,۷۲۲      | -۰/۰۵%              | ۰              | ۱۱,۲۲۱,۷۲۲       | ۱۱,۲۲۱,۷۲۲      | ۰/۰۰%               |
| صنایع چوب خزر کاسپین             | ۰              | ۱۵,۱۵۸,۹۲۲       | ۱۵,۱۵۸,۹۲۲      | -۰/۰۶%              | ۰              | ۱۳,۲۶۹,۲۷۹       | ۱۳,۲۶۹,۲۷۹      | ۰/۰۰%               |
| صندوق سرمایه گذاری مشترک خوارزمی | ۰              | ۵۹,۹۹۱,۳۳۴,۸۱۸-  | ۵۹,۹۹۱,۳۳۴,۸۱۸- | ۱۴۹/۱۵%             | ۰              | ۳۵,۳۱۷,۸۳۶,۱۸۰-  | ۳۵,۳۱۷,۸۳۶,۱۸۰- | ۰/۰۰%               |
| مدیریت سرمایه گذاری کوثرپهمن     | ۰              | ۸۷,۷۷۶,۱۷۴       | ۸۷,۷۷۶,۱۷۴      | -۰/۰۳%              | ۰              | ۵,۸۰۴,۹۳۴        | ۵,۸۰۴,۹۳۴       | ۰/۰۰%               |
| تامین سرمایه بانک ملت            | ۰              | ۱,۳۷۸,۶۴۰-       | ۱,۳۷۸,۶۴۰-      | ۰/۰۰%               | ۰              | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| سرمایه گذاری کشاورزی کوثر        | ۰              | ۱۵,۸۱۱,۴۲۵-      | ۱۵,۸۱۱,۴۲۵-     | ۰/۰۰%               | ۰              | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| پارس دارو                        | ۰              | ۳۶,۱۶۸,۸۰۰,۶۱۳-  | ۳۶,۱۶۴,۹۴۵,۳۱۶- | ۹۵۶,۸۲۴,۹۶۶         | ۷۸/۸۹%         | ۱۸,۶۸۱,۶۷۸,۶۷۵-  | ۱۸,۶۸۱,۶۷۸,۶۷۵- | ۰/۰۰%               |
| سرمایه گذاری دارویی تامین        | ۰              | ۱۶۳,۶۰۷,۶۱۶-     | ۶۳۷,۳۹۲,۶۱۶-    | ۴۷۳,۷۸۵,۰۰۰         | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| ملی صنایع مس ایران               | ۰              | ۵,۲۵۲,۴۸۰,۶۱۶-   | ۵,۶۲۷,۴۸۰,۶۱۶-  | ۳۷۵,۰۰۰,۰۰۰         | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| معدنی و صنعتی گل گهر             | ۰              | ۶,۵۵۵,۵۳۳,۰۸۵-   | ۶,۵۵۵,۵۳۳,۰۸۵-  | ۰                   | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)       | ۰              | ۹,۳۳۵,۵۰۸,۸۷۹-   | ۹,۶۲۳,۵۴۸,۸۷۹-  | ۲۸۸,۰۴۰,۰۰۰         | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| معدنی و صنعتی چادر ملو           | ۰              | ۹,۹۴۷,۳۷۰,۴۷۴-   | ۱۰,۷۳۹,۷۷۰,۴۷۴- | ۷۹۲,۴۰۰,۰۰۰         | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| فولاد خوزستان                    | ۰              | ۱۹,۰۷۴,۴۹۶,۷۹۸-  | ۱۹,۳۲۹,۴۹۶,۷۹۸- | ۲۶۵,۰۰۰,۰۰۰         | ۰/۰۰%          | ۰                | ۰               | ۰/۰۰%               |
| جمع                              | ۰              | ۸۶,۷۸۰,۸۴۲,۳۳۷-  | ۲۸,۳۴۶,۳۹۰,۲۸۴  | ۴,۴۱۳,۲۷۴,۵۷۵       | ۳۰/۵۹%         | ۷۱,۱۸۰,۰۰۲,۵۴۱-  | ۷۷,۲۴۲,۶۴۶,۵۷۱- | ۶,۰۶۲,۶۴۴,۰۳۰       |

**قابل معامله دارا الگورنتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰     |                |                  |                 | طی دوره        |            |                  |                 |                                  |
|----------------|----------------|------------------|-----------------|----------------|------------|------------------|-----------------|----------------------------------|
| جمع            | درآمد فروش     | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق | جمع            | درآمد فروش | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق |                                  |
| ۶۲,۴۸۷,۱۴۱,۲۴۳ | ۲۱,۷۳۱,۰۹۷     | ۱۶,۸۴۴,۱۰۱,۴۰۹   | ۴۵,۶۲۱,۳۰۸,۷۳۷  | ۶,۴۴۷,۵۶۵,۶۶۹  | .          | ۱,۲۸۸,۵۵۷,۴۰۷-   | ۷,۷۳۶,۱۲۳,۰۷۶   | مراجعه عام دولت ۳-ش.خ ۱۰۵        |
| ۶۱,۳۱۹,۴۲۹,۶۳۴ | .              | ۱۹,۷۴۶,۴۲۰,۳۱۳   | ۴۱,۵۷۳,۰۰۹,۳۲۱  | ۷,۶۸۲,۹۷۳,۸۴۸  | .          | ۲,۰۰۹,۶۳۵,۶۸۸    | ۵,۶۷۳,۳۲۸,۱۶۰   | منفعت دولت ۵-ش.خاص سایر ۱۰۸      |
| ۵۱,۳۹۱,۰۲۴,۸۰۳ | ۱۲,۰۹۵,۵۵۷     | ۲۱,۹۶۵,۶۱۶,۳۶۸   | ۲۹,۴۱۳,۳۱۲,۸۷۸  | ۵,۱۶۵,۱۲۸,۳۰۵- | .          | ۱۰,۵۰۷,۳۶۵,۱۹۴-  | ۵,۳۴۲,۲۳۶,۸۸۹   | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ ۰۰۶        |
| ۵۰,۸۹۴,۳۰۷,۶۱۶ | ۴۹,۵۸۶,۶۷۱     | ۳۴,۲۰۴,۲۰۸,۲۹۶   | ۱۶,۶۴۰,۵۱۲,۶۴۹  | ۳,۴۱۸,۸۳۷,۲۸۰  | .          | .                | ۳,۴۱۸,۸۳۷,۲۸۰   | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ ۱۰۶        |
| ۲۸,۱۸۳,۵۷۰,۳۱۱ | .              | ۱۶,۴۷۴,۵۸۶,۲۹۵   | ۱۱,۷۰۸,۹۸۴,۰۱۶  | ۲,۶۴۳,۹۳۶,۴۷۵  | .          | .                | ۲,۶۴۳,۹۳۶,۴۷۵   | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ ۰۰۹        |
| ۱۴,۹۳۴,۷۵۷,۰۴۳ | .              | ۴,۷۴۸,۴۶۷,۵۴۰    | ۱۰,۱۸۶,۲۸۹,۵۰۳  | ۸,۸۲۸,۸۸۴,۷۹۴- | .          | ۱۰,۹۸۸,۰۰۸,۰۶۲-  | ۲,۱۵۹,۱۲۳,۲۶۸   | مراجعه عام دولت ۴-ش.خ ۱۰۷        |
| ۱۱,۰۳۹,۱۴۲,۳۶۵ | ۱۱,۰۳۹,۱۴۲,۳۶۵ | .                | .               | .              | .          | .                | .               | اسنادخزانه-م ۷ بودجه ۹۸-۱۹۰۷۱۹   |
| ۱۰,۲۸۹,۰۷۹,۲۵۲ | ۱۲,۹۲۱,۱۴۴-    | ۴,۷۷۱,۴۲۸,۳۲۵-   | ۱۵,۰۷۳,۴۲۸,۷۲۱  | ۲,۰۲۸,۷۱۲,۹۷۹  | .          | .                | ۲,۰۲۸,۷۱۲,۹۷۹   | مراجعه کرمان موتور ۲۰۳۰۶-۱۴۰۲۰۳  |
| ۸,۷۱۶,۴۳۳,۰۳۳  | .              | ۴,۷۱۹,۱۴۴,۵۰۰    | ۳,۹۹۷,۲۸۸,۵۳۳   | ۵۸۸,۰۰۴,۷۱۲    | .          | .                | ۵۸۸,۰۰۴,۷۱۲     | مشارکت دولت-باشریط خاص ۱۴۰۰۱۰    |
| ۶,۶۲۶,۸۷۷,۱۰۲  | ۵,۰۰۲,۸۴۳,۷۵۰  | .                | ۱,۶۲۴,۰۳۳,۳۵۲   | .              | .          | .                | .               | صکوک مراجعه سایپا ۱۱۲-۳ ماهه ۱۶٪ |
| ۶,۵۲۵,۶۲۴,۶۰۵  | ۶,۵۲۵,۶۲۴,۶۰۵  | .                | .               | .              | .          | .                | .               | اسنادخزانه-م ۱۲ بودجه ۹۸-۱۱۱۱۰۰  |
| ۵,۵۸۹,۱۲۸,۳۹۶  | ۵,۵۸۹,۱۲۸,۳۹۶  | .                | .               | .              | .          | .                | .               | اسنادخزانه-م ۲۳ بودجه ۹۷-۸۲۴۰۰۰  |
| ۵,۵۰۸,۸۵۴,۶۱۹  | ۳,۸۹۷,۱۱۶,۳۷۶  | .                | ۱,۶۱۱,۷۳۸,۲۴۳   | .              | .          | .                | .               | مراجعه گندم ۲-واجدشرایط خاص ۱۴۰۰ |
| ۴,۴۶۰,۰۴۶,۷۶۲  | .              | ۴,۴۶۰,۰۴۶,۷۶۲    | .               | ۲,۷۲۸,۶۵۳,۲۳۶- | .          | ۲,۷۲۸,۶۵۳,۲۳۶-   | .               | سکه تمام بهار تحویل اروزه صادرات |
| ۴,۳۹۲,۹۷۱,۳۶۶  | ۴,۳۹۲,۹۷۱,۳۶۶  | .                | .               | .              | .          | .                | .               | اسنادخزانه-م ۱۴ بودجه ۹۸-۱۰۳۱۸۰۰ |
| ۳,۹۷۶,۱۳۲,۱۰۹  | ۳,۹۷۶,۱۳۲,۱۰۹  | .                | .               | .              | .          | .                | .               | اسنادخزانه-م ۲۲ بودجه ۹۷-۰۰۴۲۸۰۰ |

قابل معامله دارا الگورتی  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰      |                |                  |                 | طی دوره       |             |                  |                 |                                   |
|-----------------|----------------|------------------|-----------------|---------------|-------------|------------------|-----------------|-----------------------------------|
| جمع             | درآمد فروش     | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق | جمع           | درآمد فروش  | درآمد تغییر ارزش | درآمد سود اوراق |                                   |
| ۳,۶۲۴,۶۲۰,۰۳۸   | ۳,۶۲۴,۶۲۰,۰۳۸  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۲۱ بودجه ۹۷-۰۰۷۲۸    |
| ۲,۶۸۰,۴۴۵,۴۳۲   | ۲,۶۸۰,۴۴۵,۴۳۲  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۰۱۰۶۱۴   |
| ۲,۲۹۸,۸۴۳,۰۲۳   | ۲۳۷,۴۲۷,۶۷۸    | ۰                | ۲,۰۶۱,۴۱۵,۳۴۵   | ۲۸۸,۸۵۴,۱۳۴   | ۱۵۳,۲۸۶,۲۵۰ | ۰                | ۱۳۵,۵۶۷,۸۸۴     | مشارکت لیزینگ ایران و شرق ۱۰-۱۴۰۰ |
| ۲,۲۹۱,۹۹۵,۱۰۴   | ۲,۲۹۱,۹۹۵,۱۰۴  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۱۰ بودجه ۹۸-۰۱۰۰۶    |
| ۲,۲۷۱,۳۳۵,۳۰۴   | ۲,۲۷۱,۳۳۵,۳۰۴  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۵ بودجه ۹۸-۰۰۴۲۲     |
| ۲,۱۸۶,۱۹۶,۱۲۱   | ۲,۱۸۶,۱۹۶,۱۲۱  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۱۷ بودجه ۹۸-۰۱۰۵۱۲   |
| ۱,۲۶۶,۰۸۲,۵۲۳   | ۱,۲۶۶,۰۸۲,۵۲۳  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۱۶ بودجه ۹۷-۰۰۴۰۷    |
| ۱,۰۵۷,۸۱۲,۹۹۸   | ۱,۰۵۷,۸۱۲,۹۹۸  | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۱۳ بودجه ۹۷-۰۰۵۱۸    |
| ۲۶۲,۶۶۳,۵۷۸     | ۲۶۲,۶۶۳,۵۷۸    | ۰                | ۰               | ۰             | ۰           | ۰                | ۰               | اسنادخزانه-م ۲۰ بودجه ۹۸-۰۲۰۸۰۶   |
| ۳۵۴,۲۷۴,۵۱۴,۳۸۰ | ۵۶,۳۷۲,۰۲۹,۹۲۴ | ۱۱۸,۳۹۱,۱۶۳,۱۵۸  | ۱۷۹,۵۱۱,۳۲۱,۲۹۸ | ۶,۳۷۶,۲۱۸,۷۶۲ | ۱۵۳,۲۸۶,۲۵۰ | ۲۳,۵۰۲,۹۴۸,۲۱۱-  | ۲۹,۷۲۵,۸۸۰,۷۲۳  | جمع                               |

**قابل معامله دارا الگورتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰                |                               | 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   |
| ۵/۴۷٪                     | ۱۳,۶۷۹,۶۸۰,۲۷۸                | ۴/۷۲٪                     | ۱,۹۱۸,۰۳۲,۹۹۹                 | -                     | اوراق گواهی سپرده الکترونیکی طرح ۳۰۹۸ مرحله ۲۴ بانک صادرات ۱۳۹۹۱۱۲۸ - ۱۸ درصد |
| ۱۱/۶۷٪                    | ۲۹,۱۷۸,۰۹۰,۶۸۳                | ۱۰/۰۷٪                    | ۴,۰۹۲,۷۴۶,۴۶۳                 | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۱     | سپرده بانکی بلند مدت - ایران زمین   |
| ۲/۳۵٪                     | ۵,۸۶۳,۰۱۳,۶۹۶                 | ۲/۰۱٪                     | ۸۱۸,۳۲۴,۷۲۵                   | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۲     | سپرده بانکی بلند مدت - ایران زمین   |
| ۵/۷۹٪                     | ۱۴,۴۵۹,۲۸۵,۸۵۵                | ۶/۰۴٪                     | ۲,۴۵۵,۶۴۷,۹۰۳                 | ۱۲۶-۹۸۵-۱۳۲۰۰۷۸-۳     | سپرده بانکی بلند مدت - ایران زمین   |
| ۲/۰۶٪                     | ۵,۱۵۹,۴۸۵,۰۲۶                 | ۳/۶۱٪                     | ۱,۴۶۸,۹۴۱,۳۰۲                 | ۰۴۰۱۵۲۷۵۵۱۰۰۵         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۰/۹۲٪                     | ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲                 | ۲/۰۱٪                     | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵                   | ۰۴۰۱۵۶۵۲۷۴۰۰۷         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۰/۹۲٪                     | ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲                 | ۲/۰۱٪                     | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵                   | ۰۴۰۱۵۶۵۳۰۴۰۰۸         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۰/۹۲٪                     | ۲,۲۹۲,۵۷۳,۶۷۲                 | ۲/۰۱٪                     | ۸۱۶,۰۸۸,۸۶۵                   | ۰۴۰۱۵۶۵۳۳۴۰۰۱         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۵۷٪                     | ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴                 | ۴/۰۲٪                     | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰                 | ۰۴۰۱۶۰۹۱۷۲۰۰۴         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۵۷٪                     | ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴                 | ۴/۰۲٪                     | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰                 | ۰۴۰۱۶۰۹۱۷۸۰۰۳         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۵۷٪                     | ۳,۹۲۷,۶۱۸,۰۱۴                 | ۴/۰۲٪                     | ۱,۶۳۲,۱۷۷,۷۳۰                 | ۰۴۰۱۶۰۹۱۸۴۰۰۵         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۱۴٪                     | ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹                 | ۴/۱۴٪                     | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰                 | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۶ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |
| ۱/۱۴٪                     | ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹                 | ۴/۱۴٪                     | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰                 | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۷ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |
| ۱/۱۴٪                     | ۲,۸۴۱,۲۶۱,۳۰۹                 | ۴/۱۴٪                     | ۱,۶۸۲,۰۴۴,۸۵۰                 | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۸ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |
| ۱/۳۴٪                     | ۳,۳۴۳,۹۰۳,۹۶۸                 | ۴/۹۶٪                     | ۲,۰۱۷,۵۵۸,۰۰۴                 | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۶۹ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |
| ۰/۷۷٪                     | ۱,۹۱۷,۴۴۱,۵۴۷                 | ۳/۷۰٪                     | ۱,۵۰۳,۱۷۱,۱۹۰                 | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۹۰۸۴ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |
| ۴/۱۴٪                     | ۱۰,۳۵۶,۱۶۴,۲۸۰                | ۷/۲۸٪                     | ۲,۹۵۸,۹۰۴,۰۸۰                 | ۰۴۰۵۲۶۸۷۵۰۰۰۸         | سپرده بانکی بلند مدت - دی   |
| ۱۰/۹۴٪                    | ۲۷,۳۴۷,۶۸۸,۳۲۰                | ۱۱/۱۸٪                    | ۴,۵۴۴,۹۳۶,۰۰۸                 | ۱۱۳-۱۲-۲۰-۶۶۹۱۴۷-۱    | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری  |
| ۵/۳۹٪                     | ۱۳,۴۸۲,۵۸۲,۶۵۸                | ۹/۳۳٪                     | ۳,۷۹۳,۰۸۹,۷۷۹                 | ۱-۶۶۹۱۴۷-۲۱۱-۱۱۳      | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری  |
| ۰/۰۰٪                     | ۴۰,۹۷۹                        | ۰/۰۰٪                     | ۸,۲۱۹                         | ۱۲۶-۸۴-۱۳۲۰۰۷۸-۱      | سپرده بانکی کوتاه مدت - ایران زمین  |
| ۰/۰۱٪                     | ۳۳,۵۴۰,۴۷۴                    | ۰/۰۰٪                     | ۱۷۰,۴۸۸                       | ۰۲۰۳۵۶۵۱۸۷۰۰۴         | سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده   |
| ۰/۰۰٪                     | ۲۰,۹۴۱                        | ۰/۰۰٪                     | ۴,۸۲۱                         | ۰۲۰۳۵۶۳۰۲۳۰۰۴         | سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده   |
| ۷/۹۵٪                     | ۱۹,۸۶۹,۸۹۵,۲۲۶                | ۶/۶۰٪                     | ۲,۶۸۱,۵۳۹,۷۰۰                 | ۰۸۰۱۴۰۷۱۵۱۰۰۹         | سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده   |
| ۰/۰۰٪                     | ۵۰,۲۲۵                        | ۰/۰۰٪                     | ۴,۸۲۱                         | ۱۰۰۸۱۰۸۱۰۷۰۷۰۷۳۷۴۹    | سپرده بانکی کوتاه مدت - خاورمیانه   |
| ۰/۰۱٪                     | ۱۵,۴۵۴,۸۲۲                    | ۰/۰۰٪                     | ۴,۷۵۴                         | ۰۲۱۵۹۶۸۳۶۴۰۰۶         | سپرده بانکی کوتاه مدت - صادرات  |
| ۱/۷۱٪                     | ۴,۲۷۸,۶۸۸,۵۲۳                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۰۴۰۱۳۵۳۸۵۸۰۰۱         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۳/۳۱٪                     | ۸,۲۶۲,۲۹۵,۰۸۰                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۰۴۰۱۴۵۲۱۹۹۰۰۱         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۳۶٪                     | ۳,۳۹۳,۴۴۲,۶۲۱                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۰۴۰۱۴۸۹۷۰۵۰۰۹         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۰/۷۹٪                     | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۰۴۰۱۵۲۰۰۱۰۰۰۱         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۰/۷۹٪                     | ۱,۹۶۷,۲۱۳,۱۱۴                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۰۴۰۱۵۲۰۰۱۶۰۰۰         | سپرده بانکی بلند مدت - آینده  |
| ۱/۷۶٪                     | ۴,۴۱۰,۹۵۸,۹۱۰                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۴۰۱-۴۲۶۳۷۸۴-۶۰۶       | سپرده بانکی بلند مدت - پارسین   |
| ۴/۰۷٪                     | ۱۰,۱۶۳,۸۳۵,۶۱۸                | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۴۰۱-۴۲۷۴۶۹۷-۶۰۱       | سپرده بانکی بلند مدت - پارسین   |
| ۲/۹۷٪                     | ۷,۴۲۵,۵۵۵,۸۰۸                 | ۰/۰۰٪                     | .                             | ۱۰۰۸-۶۰-۹۱۵-۱۱۱۱۷۸۸۱۳ | سپرده بانکی بلند مدت - خاورمیانه  |



**قابل معامله دارا الگوریتیم**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰**

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

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰                |                               | 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                        |
| ۲/۵۳٪                     | ۶,۳۱۲,۳۲۸,۹۸۱                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۷۰۰۸۴۳۲۲۹۲۴       | سپرده بانکی بلند مدت - شهر       |
| ۱/۶۱٪                     | ۴,۰۲۷,۸۶۸,۸۵۱                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۴۰۶۰۴۲۵۳۶۰۰۱     | سپرده بانکی بلند مدت - صادرات    |
| ۱/۳۳٪                     | ۳,۲۹۹,۹۹۹,۹۹۸                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۴۰۶۰۶۵۸۰۶۰۰۰     | سپرده بانکی بلند مدت - صادرات    |
| ۰/۶۵٪                     | ۱,۶۲۲,۹۵۰,۸۱۷                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۴۰۶۰۶۵۸۳۳۰۰۵     | سپرده بانکی بلند مدت - صادرات    |
| ۲/۲۶٪                     | ۵,۶۵۵,۳۷۳,۷۰۵                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۴۰۱۱۲۷۵۰۲۶۰۲     | سپرده بانکی بلند مدت - کارآفرین  |
| ۰/۶۱٪                     | ۱,۵۳۴,۲۴۶,۵۷۴                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۱,۶۶۹۱۴۷,۱۱۹۷,۱۱۳ | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| ۱/۷۸٪                     | ۴,۴۳۸,۳۵۶,۱۶۲                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۲,۶۶۹۱۴۷,۱۱۹۷,۱۱۳ | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| ۳/۵۹٪                     | ۸,۹۷۴,۵۲۰,۵۶۹                 | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۳,۶۶۹۱۴۷,۱۱۹۷,۱۱۳ | سپرده بانکی بلند مدت - گردشگری   |
| ۰/۱۲٪                     | ۳۰۷,۴۳۱,۳۹۶                   | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۲۰۳۳۵۰۹۱۵۰۰۵     | سپرده بانکی کوتاه مدت - آینده    |
| ۰/۰۰٪                     | ۲۵,۲۰۵                        | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۴۷۰-۹۸۸۴۰۶-۶۰۹    | سپرده بانکی کوتاه مدت - پاریسان  |
| ۰/۰۰٪                     | ۳۷,۱۵۲                        | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۷۰۰۸۴۳۱۶۶۸۴۷      | سپرده بانکی کوتاه مدت - شهر      |
| ۰/۰۰٪                     | ۱۶,۳۹۴                        | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۲۱۶۲۸۷۷۶۳۰۰۰     | سپرده بانکی کوتاه مدت - صادرات   |
| ۰/۰۰٪                     | ۵,۰۰۸,۰۸۶                     | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۰۲۰۱۱۲۷۰۵۶۶۰۱     | سپرده بانکی کوتاه مدت - کارآفرین |
| ۰/۰۰٪                     | ۳۹,۸۷۸                        | ۰/۰۰٪                     | ۰                             | ۱,۶۶۹۱۴۷,۹۹۶۷,۱۱۳ | سپرده بانکی کوتاه مدت - گردشگری  |
| ۱۰۰/۰۰٪                   | ۲۴۹,۹۳۸,۴۶۸,۳۱۹               | ۱۰۰/۰۰٪                   | ۴۰,۶۴۴,۰۱۹,۵۹۱                |                   | جمع                              |

قابل معامله دارا الگوریتیم  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

۲-۴- سایر درآمدها:

| ۱۳۹۹/۱۰/۳۰ | طی دوره   | سایر درآمدها                           |
|------------|-----------|--|
| مبلغ       | مبلغ      |  |
| ۴۶,۵۳۶,۱۷۹ | ۱,۴۲۶,۵۴۲ | تعدیل کارمزد کارگزاری آینده نگرخوارزمی |
| ۱۱,۶۲۰,۹۴۰ | ۰         | تعدیل کارمزد کارگزاری بانک پاسارگاد    |
| ۵۸,۱۵۷,۱۱۹ | ۱,۴۲۶,۵۴۲ | جمع                                    |