

مستودق سرمايه گذاري اختصامي بازارگرداني ارزش آفرين مستودق بازنشستگي كشوري

صورت وضعيت پورتفوي

براي ماه منتهي به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(سهام)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱					تغييرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۱/۳۱			نام شرکت
درصد به کل دارايي های مستودق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قيمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۲۴.۴۶ %	۴۷,۹۹۳,۵۴۳,۶۹۰	۴۹,۰۳۹,۸۴۰,۰۴۵	۱,۸۷۹	۲۵,۶۴۴,۳۸۸	۱۴,۷۵۸,۴۴۷	۷,۸۵۴	۵,۱۲۸,۵۵۷,۹۲۴	۲,۷۰۴,۱۶۴	۴۳,۸۳۸,۷۹۶,۰۹۴	۴۳,۹۲۶,۳۰۲,۶۸۸	۲۲,۹۴۸,۰۷۸	بيمه ملت
۳۲.۲۲ %	۶۳,۲۱۱,۳۱۰,۶۳۹	۶۴,۸۴۷,۱۹۰,۷۵۵	۱۰,۰۳۰	۶,۳۲۷,۴۷۱	۵,۴۹۷,۷۱۲,۰۵۸	۵۵۳,۶۸۷	۵,۷۰۳,۱۰۷,۹۲۰	۵۷۳,۶۸۷	۶۴,۷۵۱,۷۰۹,۲۹۴	۶۴,۸۲۵,۱۶۸,۰۷۱	۶,۳۰۷,۴۷۱	پتروشيمي جم
۱۰.۲۲ %	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۱۳,۴۱۶	۱,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۱,۵۰۰,۰۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدينگ)

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(تبعی)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱				۱۳۹۷/۰۱/۳۱				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

مستودق سرمايه گذاري اختصامي بازارگرداني ارزش آفرين مستودق بازنشستگي كشوري

صورت وضعيت پورتفوي

براي ماه منتهي به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(اوراق مشاركت)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱					تغييرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۱/۳۱			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
درصد به كل دارايي هاي مستودق	خالص ارزش فروش (ميليون ريال)	بهاي تمام شده (ميليون ريال)	قيمت بازار هر ورقه (هزار ريال)	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (ميليون ريال)	بهاي تمام شده (ميليون ريال)	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاريخ سررسيد	تاريخ انتشار	بورسي يا فرابورسي	داراي مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهاي تمام شده	تعداد										نام اوراق
%۰.۲۱	۴۱۶	۴۰۶	۹۲۶	۴۵۰	۰	۰	۰	۰	۴۱۰	۴۰۶	۴۵۰	۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰	۱۳۹۶/۱۰/۱۳	فرابورسي	بله	استادخزانه- ۳م بودجه ۹۶- ۹۷۰۷۱۰-
%۱۶.۰۵	۳۱.۴۹۶	۳۰.۳۷۲	۲.۷۸۹	۱۱.۳۰۰	۰	۰	۰	۰	۳۱.۰۶۴	۳۰.۳۷۲	۱۱.۳۰۰	۱۷	۱۷	۱۳۹۷/۱۱/۰۹	۱۳۹۶/۰۱۱/۰۹	انرژي	بله	سلف گز مبيع ۹۷۱

سندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین سندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱						نام شرکت
دلایل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	درصد تعدیل	مبلغ پس از تعدیل	قیمت پایانی	تعداد	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱
(سپرده)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۰۱/۳۱	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰ %	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۶/۰۸/۰۶	حساب جاری	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰.۰۱ %	۱۷,۷۴۳,۹۸۰	۱۰,۰۰۰	۱۳۰,۸۴۹	۱۷,۶۲۳,۱۳۱	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰ %	۷,۴۸۱,۶۰۳	۰	۰	۷,۴۸۱,۶۰۳	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۴	حساب جاری	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰ %	۵۰۰,۰۰۰	۸,۲۷۶,۰۹۵,۴۹۳	۸,۲۷۶,۰۹۵,۴۹۳	۵۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۱۶.۰۰ %	۳۲,۵۷۰,۵۳۸,۱۰۷	۸,۲۷۶,۰۸۲,۴۹۳	۲,۳۵۸,۲۳۶,۷۵۲	۳۸,۴۸۹,۱۲۶,۸۴۸	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	سپرده کوتاه مدت	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(سود اوراق بهادار و سپرده بانکی)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			طی ماه			مشخصات			
خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	خالص درآمد	هزینه تنزیل	درآمد سود	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ دریافت سود	توضیحات
۰		۰	۰		۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰		استادخزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۱۰-۹۷
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	سامان سی تیر
۲۰۰,۹۶۱,۹۰۰	۱۵۴	۲۰۰,۹۶۱,۷۴۶	۱۴۰,۸۹۰	۱۱	۱۴۰,۸۷۹	۱۰		۴	سامان سی تیر
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	سامان سی تیر
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک انصار میدان فاطمی
۸۳۱,۴۵۹,۵۹۵	۲۷۱,۸۲۳	۸۳۱,۱۸۷,۷۷۲	۲۹۰,۱۴۰,۰۰۳	-۴۸,۸۱۲	۲۹۰,۱۸۸,۸۱۵	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

سندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین سندوق باز نشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(درآمد سود سهام)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه			اطلاعات مجمع			نام شرکت
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	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نام شرکت
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
-۹۵۸,۵۲۱,۲۶۹	۴۸,۹۵۲,۰۶۴,۹۵۹	۴۷,۹۹۳,۵۴۳,۶۸۹	۲۵,۶۴۴,۳۸۸	-۹۵۸,۸۱۶,۸۸۸	۴۸,۹۵۲,۳۶۰,۵۷۸	۴۷,۹۹۳,۵۴۳,۶۸۹	۲۵,۶۴۴,۳۸۸	بیمه ملت
-۱,۶۳۵,۸۸۰,۱۱۶	۶۴,۸۴۷,۱۹۰,۷۵۵	۶۳,۲۱۱,۳۱۰,۶۳۸	۶,۳۲۷,۴۷۱	-۱,۵۶۲,۴۲۱,۳۳۸	۶۴,۷۷۳,۷۳۱,۹۷۷	۶۳,۲۱۱,۳۱۰,۶۳۸	۶,۳۲۷,۴۷۱	پتروشیمی جم
-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۱,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
۱۰,۳۱۹,۶۲۷	۴۰۶,۱۹۶,۵۲۹	۴۱۶,۵۱۶,۱۵۶	۴۵۰	۶,۴۵۶,۸۶۵	۴۱۰,۰۵۹,۲۹۱	۴۱۶,۵۱۶,۱۵۶	۴۵۰	اسنادخزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷ ۹۷۰۷۱۰
۱,۱۲۴,۵۵۵,۵۳۵	۳۰,۳۷۲,۰۰۸,۵۰۰	۳۱,۴۹۶,۵۶۴,۰۳۵	۱۱,۳۰۰	۴۳۲,۲۱۲,۵۱۱	۳۱,۰۶۴,۳۵۱,۵۲۴	۳۱,۴۹۶,۵۶۴,۰۳۵	۱۱,۳۰۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین مندوق باز نشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱
(درآمد ناشی از تغییر قیمت فروش)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نام شرکت
سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش	ارزش دفتری	بهای فروش	تعداد	
۱۳,۵۴۰,۹۴۴	۴۵۹,۴۵۲,۸۵۰	۴۷۲,۹۹۳,۷۹۴	۲۴۳,۷۴۲	-۲۳۴,۹۹۲	۱۴,۹۹۳,۴۳۹	۱۴,۷۵۸,۴۴۷	۷,۸۵۴	بیمه ملت
-۱۶۱,۶۴۴,۷۷۲	۶,۰۳۹,۹۷۲,۰۸۸	۵,۸۷۸,۳۲۷,۳۱۶	۵۸۸,۶۸۷	-۱۸۳,۳۷۳,۱۷۸	۵,۶۸۱,۰۸۵,۲۳۶	۵,۴۹۷,۷۱۲,۰۵۸	۵۵۳,۶۸۷	پتروشیمی جم
۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۹,۸۵۳,۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۱۳۳,۲۰۸,۵۰۰	۳,۷۰۰	۰	۰	۰	۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱
(سرمایه گذاری در سهام)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه					طی ماه					نام شرکت
درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	درصد از کل درآمدها	مبلغ	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود سهام	
۲۳%	-۹۴۴,۹۸۰,۳۲۵	۱۳,۵۴۰,۹۴۴	-۹۵۸,۵۲۱,۲۶۹	۰	۴۹.۰۰۹۰%	-۹۵۹,۰۵۱,۸۸۰	-۲۳۴,۹۹۲	-۹۵۸,۸۱۶,۸۸۸	۰	بیمه ملت
۵۲%	-۱,۷۹۷,۵۲۴,۸۸۸	-۱۶۱,۶۴۴,۷۷۲	-۱,۶۳۵,۸۸۰,۱۱۶	۰	۸۹.۰۰۳۶%	-۱,۷۴۵,۷۹۴,۵۱۶	-۱۸۳,۳۷۳,۱۷۸	-۱,۵۶۲,۴۲۱,۳۳۸	۰	پتروشیمی جم
۲۴%	-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۰	-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۰	۰%	۰	۰	۰	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)

مستدوق سرامیه گذاری اخصامی بازارگردانی ارزش آفرین مستدوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(سرامیه گذاری در اوراق بهادار)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				توضیحات
جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	جمع	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق	
۱,۴۰۴,۶۶۴,۰۳۵	۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۱,۱۲۴,۵۵۵,۵۳۵	۰	۴۳۲,۲۱۲,۵۱۱	۰	۴۳۲,۲۱۲,۵۱۱	۰	سلف گاز مایع ۹۷۱
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	استادخانه- ۳م بودجه ۹۶- ۹۷۰۷۱۰
۱۰,۳۱۹,۶۲۷	۰	۱۰,۳۱۹,۶۲۷	۰	۶,۴۵۶,۸۶۵	۰	۶,۴۵۶,۸۶۵	۰	استادخانه- ۳م بودجه ۹۶- ۹۷۰۷۱۰

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(درآمد سپرده بانکی)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه		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		۰	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
	۲۰۰,۹۶۱,۷۴۶		۱۴۰,۸۷۹	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
	۰		۰	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
	۰		۰	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
	۸۳۱,۱۸۷,۷۷۲		۲۹۰,۱۸۸,۸۱۵	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(سایر درآمدها)

۱۳۹۷/۰۲/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۰	۰	سایر درآمدها
۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۳۱

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	-۲.۷۰۴.۸۴۶.۳۹۶	%۱۳۸.۴۴	%-۱.۳۸
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۴۳۸.۶۹۹.۳۷۶	%-۲۲.۴۵	%۰.۲۲
درآمد سپرده بانکی	۲۹۰.۳۲۹.۶۹۴	%-۱۴.۸۶	%۰.۱۵