

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**صورت وضعیت پورتفوی برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰**  
**(سهام)**

۱۳۹۶/۱۰/۳۰					تغییرات طی دوره						۱۳۹۶/۰۹/۳۰			نام شرکت
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره	فروش طی دوره	فروش طی دوره	خرید طی دوره	خرید طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده			مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	تعداد	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد		
۹۰.۸۷ %	۴,۹۳۰,۵۸۸,۳۶۷	۰	۱,۸۹۴	۲,۶۱۳,۶۹۶	۰		۰	۵,۰۱۹,۸۴۰,۴۵۰		۲,۶۱۳,۶۹۶	۰	۰	۰	بیمه ملت

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

(تبعی)

۱۳۹۶/۱۰/۳۰				۱۳۹۶/۰۹/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۶/۱۰/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۰۹/۳۰			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت							
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ مؤثر	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرابورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد										

سندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری  
صورت وضعیت پورتفوی برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰  
(تعدیل قیمت)

۱۳۹۶/۱۰/۳۰						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 ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

(گواهی سپرده)

۱۳۹۶/۱۰/۳۰				تغییرات طی دوره	تغییرات طی دوره	تغییرات طی دوره	تغییرات طی دوره	۱۳۹۶/۰۹/۳۰	۱۳۹۶/۰۹/۳۰	۱۳۹۶/۰۹/۳۰	اطلاعات اوراق گواهی سپرده	اطلاعات اوراق گواهی سپرده	اطلاعات اوراق گواهی سپرده	اطلاعات اوراق گواهی سپرده	اطلاعات اوراق گواهی سپرده
درصد به کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرا بورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد	خالص ارزش فروش						تاریخ سررسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

(سپرده)

۱۳۹۶/۱۰/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۰۹/۳۰	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۹۰.۰۹%	۴۵,۰۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۴۵,۰۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۴,۵۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۰۸/۰۶	حساب جاری	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰%	۰	۰	۰	۰	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰%	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۴	حساب جاری	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰%	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۰%	۰	۰	۰	۰	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	سپرده کوتاه مدت	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

( 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
°		°	°		°	°	۱۳۹۷/۰۷/۱۰		استادخزانه- ۳م بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰
°	°	°	°	°	°	°		۱۷	سامان سی تیر
°	°	°	°	°	°	۱۰		۴	سامان سی تیر
°	°	°	°	°	°	°		۱۷	سامان سی تیر
°	°	°	°	°	°	°		۱۷	بانک انصار میدان فاطمی
°	°	°	°	°	°	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق باز نشستگی کشوری  
 صورت وضعیت درآمدها  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰  
 (درآمد سود سهام)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			طی ماه			اطلاعات مجمع			نام شرکت
خالص درآمد سود سهام	هزینه تذریل	جمع درآمد سود سهام	خالص درآمد سود سهام	هزینه تذریل	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهام	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ مجمع	



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

(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	
-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۵,۰۱۹,۸۴۰,۴۵۰	۴,۹۳۰,۵۸۸,۳۶۶	۲,۶۱۳,۶۹۶	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۵,۰۱۹,۸۴۰,۴۵۰	۴,۹۳۰,۵۸۸,۳۶۶	۲,۶۱۳,۶۹۶	بیمه ملت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

( درآمد ناشی از 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	

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰**  
**( 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	
۱۰۰%	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۰	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۰	۰	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۰	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۰	بیمه ملت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت درآمدها

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰

( سرمایه‌گذاری 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	
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اسنادخانه - ۳۲۵ بودجه ۹۶ - ۹۷۰۷۱۰

**مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**صورت وضعیت درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰**  
**( 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
°	°	°	°	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
°	°	°	°	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری  
صورت وضعیت درآمدها  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰  
( سایر درآمدها )

۱۳۹۶/۱۰/۳۰	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 درآمدها**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۰/۳۰**  
**( جمع درآمدها )**

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	-۸۹,۲۵۲,۰۸۳	۰	% -۰.۱۸
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۰	۰	% ۰.۰۰
درآمد سپرده بانکی	۰	۰	% ۰.۰۰