

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( سهام )

۱۳۹۶/۱۱/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۰/۳۰			نام شرکت
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد				
۳۸.۴۲%	۲۸,۷۸۶,۰۴۲,۶۶۷	۲۷,۶۳۴,۸۶۳,۶۰۹	۱,۹۷۸	۱۴,۶۱۱,۴۰۵	۴۵۵,۲۵۰,۴۶۵	۲۳۴,۳۷۰	۲۳,۰۵۸,۰۳۲,۰۴۴	۱۲,۲۳۲,۰۷۹	۴,۹۳۰,۵۸۸,۳۶۷	۵,۰۱۹,۸۴۰,۴۵۰	۲,۶۱۳,۶۹۶	بیمه ملت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

(تبعی)

۱۳۹۶/۱۱/۳۰				۱۳۹۶/۱۰/۳۰				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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( اوراق مشارکت )

۱۳۹۶/۱۱/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۰/۳۰			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت							
درصد به کل داراییهای صندوق	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	قیمت بازار هر ورقه (میلیون ریال)	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سررسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرابورسی	دارای مجوز از سازمان	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد										
%۴۰.۳۴	۳۰.۲۲۷	۳۰.۰۹۱	۲	۱۱.۳۰۰	۰	۰	۳۰.۰۹۱	۱۱.۳۰۰	۰	۰	۰	۱۷	۱۷	۱۳۹۷/۱۱/۰۹	۱۳۹۶۰/۱۱/۰۹	فرابورسی	بله	سلف گاز مایع ۹۷

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( تعدیل قیمت )

۱۳۹۶/۱۱/۳۰						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 بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( سپرده )

۱۳۹۶/۱۱/۳۰		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۱۰/۳۰	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی ها	مبلغ	کاهش	افزایش	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
%۰	۰	۴۵,۰۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۴۵,۰۰۱,۰۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۰۸/۰۶	حساب جاری	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
%۲۰.۸۴	۱۵,۶۱۱,۷۷۹,۸۱۱	۵۲,۸۲۷,۸۲۲,۸۵۹	۶۸,۴۳۹,۶۰۲,۶۷۰	۰	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
%۰.۰۷	۴۹,۹۱۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۴	حساب جاری	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
%۰	۲,۳۴۱,۴۱۵	۱۵۸,۵۸۵	۲,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
%۰	۲,۴۹۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۲,۵۰۰,۰۰۰	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 پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( 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
۰		۰	۰		۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰		استادخانه-۳ بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	سامان سی تیر
۱۶۲,۰۷۷,۰۴۸	۱۷۷,۲۳۰	۱۶۱,۸۹۹,۸۱۸	۱۶۲,۰۷۷,۰۴۸	۱۷۷,۲۳۰	۱۶۱,۸۹۹,۸۱۸	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
۱,۳۷۴	۱۰	۱,۳۶۴	۱,۳۷۴	۱۰	۱,۳۶۴	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

(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 بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

(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	
۱,۲۳۸,۹۸۸,۳۷۸	۲۷,۵۴۷,۰۵۴,۲۸۹	۲۸,۷۸۶,۰۴۲,۶۶۷	۱۴,۶۱۱,۴۰۵	۱,۲۳۸,۹۸۸,۳۷۸	۲۷,۵۴۷,۰۵۴,۲۸۹	۲۸,۷۸۶,۰۴۲,۶۶۷	۱۴,۶۱۱,۴۰۵	بیمه ملت
۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۳۰,۰۹۱,۹۰۰,۰۰۰	۳۰,۲۲۷,۸۱۱,۱۸۳	۱۱,۳۰۰	۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۳۰,۰۹۱,۹۰۰,۰۰۰	۳۰,۲۲۷,۸۱۱,۱۸۳	۱۱,۳۰۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

(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	
۱۳,۶۸۴,۳۴۴	۴۴۱,۵۶۶,۱۲۱	۴۵۵,۲۵۰,۴۶۵	۲۳۴,۳۷۰	۱۳,۶۸۴,۳۴۴	۴۴۱,۵۶۶,۱۲۱	۴۵۵,۲۵۰,۴۶۵	۲۳۴,۳۷۰	بیمه ملت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری  
 صورت وضعیت پورتفوی  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰  
 ( 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	
۸۰.۷۰ %	۱,۲۵۲,۶۷۲,۷۲۲	۱۳,۶۸۴,۳۴۴	۱,۲۳۸,۹۸۸,۳۷۸	۰	۸۰.۷۰ %	۱,۲۵۲,۶۷۲,۷۲۲	۱۳,۶۸۴,۳۴۴	۱,۲۳۸,۹۸۸,۳۷۸	۰	بیمه ملت

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری  
 صورت وضعیت پورتفوی  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰  
 ( سرمایه 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	
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اسناد خزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۱۰-۹۷۰۷۱۰
۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۰	۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۰	۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۰	۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

(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
۰	۰	۰	۰	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰	۱۶۱,۸۹۹,۸۱۸	۰	۱۶۱,۸۹۹,۸۱۸	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰	۰	۰	۰	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰	۰	۰	۰	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۰	۱,۳۶۴	۰	۱,۳۶۴	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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( سایر درآمدها )

۱۳۹۶/۱۱/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
°	°	سایر درآمدها
°	°	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
°	°	تعدیل کارمزد کارگزار

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

( جمع درآمدها )

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	۱,۲۵۲,۶۷۲,۷۲۲	%۸۰.۷۰	%۱.۶۷
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۱۳۵,۹۱۱,۱۸۳	%۸.۷۶	%۰.۱۸
درآمد سپرده بانکی	۱۶۱,۹۰۱,۱۸۲	%۱۰.۴۳	%۰.۲۲