

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

( سهام )

۱۳۹۶/۱۲/۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۱/۳۰			نام شرکت		
					قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره	خرید طی دوره	خالص ارزش فروش		بهای تمام شده	تعداد
							مبلغ فروش (میلیون ریال)	تعداد						
%۲۰.۲۰	۴۲,۶۶۶	۴۳,۰۹۷	۱,۹۰۲	۲۲,۵۲۲,۲۸۰	۲	۱,۵۱۰	۱۵,۴۶۵	۷,۹۱۲,۳۸۵	۲۸,۷۸۶	۲۷,۶۳۴	۱۴,۶۱۱,۴۰۵	بیمه ملت		
%۲۹.۴۷	۶۲,۲۵۵	۶۳,۰۵۸	۱۰,۱۶۲	۶,۱۵۰,۷۹۸	۰	۰	۶۳,۰۵۸,	۶,۱۵۰,۷۹۸	۰	۰	۰	پتروشیمی جم		
%۹.۴۹	۲۰,۰۴۵	۲۰,۱۳۰	۱۳,۴۱۷	۱,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۲۰,۱۳۰	۱,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)		

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

(تبعی)

۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۶/۱۱/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین صندوق باز نشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۶/۱۲/۲۹					تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۱/۳۰			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 (هزار ریال)	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	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										نام اوراق
%۰.۱۹	۴۰۴	۴۰۶	۸۹۹	۴۵۰	۰	۰	۴۰۶	۴۵۰	۰	۰	۰	۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰	۱۳۹۶/۱۰/۱۳	فرابورسی	بله	اسناد خزانه ۳م بودجه -۹۶ ۹۷۰۷۱۰
%۱۴.۵۰	۳۰.۶۳۲	۳۰.۰۹۱	۲.۷۱۲	۱۱.۳۰۰	۰	۰	۰	۰	۳۰.۲۲۷	۳۰.۰۹۱	۱۱.۳۰۰	۱۷	۱۷	۱۳۹۷/۱۱/۰۹	۱۳۹۶/۰۱۱/۰۹	انرژی	بله	سلف گاز ملیع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

( تعدیل قیمت )

۱۳۹۶/۱۲/۲۹						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**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹**  
**( سپرده )**

۱۳۹۶/۱۲/۲۹		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۱۱/۳۰	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 %	۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۷۹۴,۸۴۶,۶۴۴	۱۸۵,۰۶۶,۸۳۳	۱۵,۶۱۱,۷۷۹,۸۱۱	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰ %	۷,۴۸۱,۶۰۳	۱۵,۸۳۷,۲۷۵,۰۴۱	۱۵,۷۹۴,۸۴۶,۶۴۴	۴۹,۹۱۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۴	حساب جاری	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
۰ %	۳,۸۳۵,۴۹۸	۱۵,۵۶۹,۴۰۳,۲۸۰	۱۵,۵۷۰,۸۹۷,۳۶۳	۲,۳۴۱,۴۱۵	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۲۲.۴۹ %	۴۷,۵۱۱,۹۲۹,۵۱۶	۱۵,۵۹۶,۵۴۷,۳۶۳	۶۳,۱۰۵,۹۸۶,۸۷۹	۲,۴۹۰,۰۰۰	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

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

( 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
۲۰۰,۷۰۶,۷۶۹	۱۷,۱۰۲	۲۰۰,۶۸۹,۶۶۷	۳۸,۶۲۹,۷۲۱	-۱۶۰,۱۲۸	۳۸,۷۸۹,۸۴۹	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
۱۹۴,۷۲۸,۲۸۲	۱,۴۷۱,۲۳۳	۱۹۳,۲۵۷,۰۴۹	۱۹۴,۷۲۶,۹۰۸	۱,۴۷۱,۲۲۳	۱۹۳,۲۵۵,۶۸۵	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹  
( 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	تاریخ مجمع	



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹

( 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	
-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۶۳,۰۵۸,۱۹۹,۹۶۳	۶۲,۲۵۵,۰۱۶,۶۸۲	۶,۱۵۰,۷۹۸	-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۶۳,۰۵۸,۱۹۹,۹۶۳	۶۲,۲۵۵,۰۱۶,۶۸۲	۶,۱۵۰,۷۹۸	پتروشیمی جم
-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۲۰,۰۴۵,۱۹۹,۲۵۵	۱,۵۰۰,۰۰۰	-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۲۰,۰۴۵,۱۹۹,۲۵۵	۱,۵۰۰,۰۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
-۳۴۳,۵۳۱,۱۴۰	۴۳,۰۰۹,۹۸۶,۵۶۸	۴۲,۶۶۶,۴۵۵,۴۲۷	۲۲,۵۲۲,۲۸۰	-۱,۵۸۲,۵۱۹,۵۱۸	۴۴,۲۴۸,۹۷۴,۹۴۶	۴۲,۶۶۶,۴۵۵,۴۲۷	۲۲,۵۲۲,۲۸۰	بیمه ملت
-۱,۷۹۵,۰۳۲	۴۰۶,۱۹۶,۵۲۹	۴۰۴,۴۰۱,۴۹۶	۴۵۰	-۱,۷۹۵,۰۳۲	۴۰۶,۱۹۶,۵۲۹	۴۰۴,۴۰۱,۴۹۶	۴۵۰	استادخزانه-۳ بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰
۵۴۰,۲۳۹,۰۱۵	۳۰,۰۹۱,۹۰۰,۰۰۰	۳۰,۶۳۲,۱۳۹,۰۱۵	۱۱,۳۰۰	۴۰۴,۳۲۷,۸۳۲	۳۰,۲۲۷,۸۱۱,۱۸۳	۳۰,۶۳۲,۱۳۹,۰۱۵	۱۱,۳۰۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹**  
**(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	
۱۳,۷۷۵,۷۶۰	۴۴۴,۴۴۴,۱۲۹	۴۵۸,۲۱۹,۸۸۹	۲۳۵,۸۸۰	۹۱,۴۱۶	۲,۸۷۸,۰۰۸	۲,۹۶۹,۴۲۴	۱,۵۱۰	بیمه ملت

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹**  
**( 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	
۲۹%	-۳۲۹,۷۵۵,۳۸۰	۱۳,۷۷۵,۷۶۰	-۳۴۳,۵۳۱,۱۴۰	۰	-۶۸۱.۶۴%	-۱,۵۸۲,۴۲۸,۱۰۲	۹۱,۴۱۶	-۱,۵۸۲,۵۱۹,۵۱۸	۰	بیمه ملت
۲۴%	-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۰	-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۰	-۳۴۵.۹۸%	-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۰	-۸۰۳,۱۸۳,۲۸۰	۰	پتروشیمی جم
۹۳%	-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۰	-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۰	-۳۶.۵۵%	-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۰	-۸۴,۸۶۱,۱۲۹	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹**  
**( 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 ۹۶-۹۷۱۰-۹۷
-۱,۷۹۵,۰۳۲	۰	-۱,۷۹۵,۰۳۲	۰	-۱,۷۹۵,۰۳۲	۰	-۱,۷۹۵,۰۳۲	۰	اسناد خزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۱۰-۹۷
۵۴۰,۲۳۹,۰۱۵	۰	۵۴۰,۲۳۹,۰۱۵	۰	۴۰۴,۳۲۷,۸۳۲	۰	۴۰۴,۳۲۷,۸۳۲	۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری**  
**برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹**  
**( 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
°	۲۰۰,۶۸۹,۶۶۷	°	۳۸,۷۸۹,۸۴۹	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
°	۱۹۳,۲۵۷,۰۴۹	°	۱۹۳,۲۵۵,۶۸۵	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری  
برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹  
( سایر درآمدها )

۱۳۹۶/۱۲/۲۹	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 بازنشستگی کشوری  
 برای ماه منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۲۹  
 ( جمع درآمدها )

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	-۲.۴۷.۴۷۲.۵۱۱	%۱۳۴.۵۷	%-۱.۱۷
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۴۰۲.۵۳۲.۸۰۰	%-۲۱.۹۳	%۰.۱۹
درآمد سپرده بانکی	۲۳۲.۰۴۵.۵۳۴	%-۲۱.۶۴	%۰.۱۱