

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

(سهام)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۲/۲۹			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				
%۲۲.۰۱	۴۳,۸۳۸,۷۹۶,۰۹۴	۴۳,۹۲۶,۳۰۲,۶۸۸	۱,۹۱۸	۲۲,۹۴۸,۰۷۸	۱۵,۴۵۸	۸	۸۲۸,۵۲۹,۱۸۸	۴۲۵,۸۰۶	۴۲,۶۶۶,۴۵۵,۴۲۸	۴۳,۰۹۷,۷۸۸,۸۱۲	۲۲,۵۲۲,۲۸۰	بیمه ملت
%۳۲.۵۱	۶۴,۷۵۱,۷۰۹,۲۹۴	۶۴,۸۲۵,۱۶۸,۰۷۱	۱۰,۳۰۷	۶,۳۰۷,۴۷۱	۳۸۰,۶۱۵,۲۵۸	۳۵,۰۰۰	۲,۱۲۵,۸۵۴,۹۶۰	۱۹۱,۶۷۳	۶۲,۲۵۵,۰۱۶,۶۸۳	۶۳,۰۵۸,۱۹۹,۹۶۳	۶,۱۵۰,۷۹۸	پتروشیمی جم
%۱۰.۰۶	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۱۳,۴۱۶	۱,۵۰۰,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۲۰,۰۴۵,۱۹۹,۲۵۵	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۱,۵۰۰,۰۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱/۳۱/۱۳۹۷
(تبعی)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱				۱۳۹۶/۱۲/۲۹				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 پورتنفوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱
(اوراق مشارکت)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۶/۱۲/۲۹			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 (میلیون ریال)	تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد										
%۰.۲۱	۴۱۰	۴۰۶	۹۱۱	۴۵۰	۰	۰	۰	۰	۴۰۴	۴۰۶	۴۵۰	۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰	۱۳۹۶/۱۰/۱۳	فرابورسی	بله	استادخانه ۳م بودجه -۹۶ ۹۷۰۷۱۰
%۱۵.۵۹	۳۱۰۰۶۴	۳۰.۳۷۲	۲۰۷۵۱	۱۱.۳۰۰	۱۰.۱۳۳	۳.۷۰۰	۱۰.۱۳۳	۳.۷۰۰	۳۰.۶۳۲	۳۰.۰۹۱	۱۱.۳۰۰	۱۷	۱۷	۱۳۹۷/۱۱/۰۹	۱۳۹۶/۰۱۱/۰۹	انرژی	بله	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتهوی
برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱
(تعدیل قیمت)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱						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 ۱۳۹۷/۰۱/۳۱
 (سپرده)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۶/۱۲/۲۹	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	۱۷,۶۲۳,۱۳۱	۰	۱۵,۶۲۳,۱۳۱	۲,۰۰۰,۰۰۰	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	۱۰,۰۰۶,۰۰۸,۸۷۷	۱۰,۰۰۲,۶۷۳,۳۷۹	۳,۸۳۵,۴۹۸	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
%۱۹.۳۲	۳۸,۴۸۹,۱۲۶,۸۴۸	۱۹,۷۴۳,۱۰۱,۶۱۹	۱۰,۷۲۰,۲۹۸,۹۵۱	۴۷,۵۱۱,۹۲۹,۵۱۶	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 ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

(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		اسناد خزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۱۰-۹۷
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	سامان سی تیر
۲۰۰,۸۲۱,۰۱۰	۱۴۳	۲۰۰,۸۲۰,۸۶۷	۱۱۴,۲۴۱	-۱۶,۹۵۹	۱۳۱,۲۰۰	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
۵۴۱,۳۱۹,۵۹۲	۳۲۰,۶۳۵	۵۴۰,۹۹۸,۹۵۷	۳۴۶,۵۹۱,۳۱۰	-۱,۱۵۰,۵۹۸	۳۴۷,۷۴۱,۹۰۸	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱/۳/۱۳۹۷
(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 بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۱/۳۱

(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	
-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۱,۵۰۰,۰۰۰	-۱,۴۹۴,۰۱۵	۲۰,۰۴۵,۱۹۹,۲۵۵	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۱,۵۰۰,۰۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
۲۹۵,۶۱۹	۴۳,۸۳۸,۵۰۰,۴۷۴	۴۳,۸۳۸,۷۹۶,۰۹۳	۲۲,۹۴۸,۰۷۸	۳۴۳,۸۲۶,۷۶۰	۴۳,۴۹۴,۹۶۹,۳۳۳	۴۳,۸۳۸,۷۹۶,۰۹۳	۲۲,۹۴۸,۰۷۸	بیمه ملت
-۷۳,۴۵۸,۷۷۷	۶۴,۸۲۵,۱۶۸,۰۷۱	۶۴,۷۵۱,۷۰۹,۲۹۳	۶,۳۰۷,۴۷۱	۷۲۹,۷۲۴,۵۰۳	۶۴,۰۲۱,۹۸۴,۷۹۰	۶۴,۷۵۱,۷۰۹,۲۹۳	۶,۳۰۷,۴۷۱	پتروشیمی جم
۳,۸۶۲,۷۶۲	۴۰۶,۱۹۶,۵۲۹	۴۱۰,۰۵۹,۲۹۱	۴۵۰	۵,۶۵۷,۷۹۵	۴۰۴,۴۰۱,۴۹۶	۴۱۰,۰۵۹,۲۹۱	۴۵۰	اسنادخزانه-م-بودجه ۹۶-۹۷ ۹۷۰۷۱۰
۶۹۲,۳۴۳,۰۲۴	۳۰,۳۷۲,۰۰۸,۵۰۰	۳۱,۰۶۴,۳۵۱,۵۲۴	۱۱,۳۰۰	۱۵۲,۱۰۴,۰۰۹	۳۰,۹۱۲,۲۴۷,۵۱۵	۳۱,۰۶۴,۳۵۱,۵۲۴	۱۱,۳۰۰	سلف گازمیع ۹۷۱

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱/۳/۱۳۹۷

(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	
۱۳,۷۷۵,۹۳۶	۴۴۴,۴۵۹,۴۱۱	۴۵۸,۲۳۵,۳۴۷	۲۳۵,۸۸۸	۱۷۶	۱۵,۲۸۲	۱۵,۴۵۸	۸	بیمه ملت
۲۱,۷۲۸,۴۰۶	۳۵۸,۸۸۶,۸۵۲	۳۸۰,۶۱۵,۲۵۸	۳۵,۰۰۰	۲۱,۷۲۸,۴۰۶	۳۵۸,۸۸۶,۸۵۲	۳۸۰,۶۱۵,۲۵۸	۳۵,۰۰۰	پتروشیمی جم
۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۹,۸۵۳,۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۱۳۳,۲۰۸,۵۰۰	۳,۷۰۰	۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۹,۸۵۳,۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۱۳۳,۲۰۸,۵۰۰	۳,۷۰۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱/۳۱/۱۳۹۷

(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	
۰.۸۸ %	۱۴,۰۷۱,۵۵۵	۱۳,۷۷۵,۹۳۶	۲۹۵,۶۱۹	۰	۱۸.۲۸ %	۳۴۳,۸۲۶,۹۳۶	۱۷۶	۳۴۳,۸۲۶,۷۶۰	۰	بیمه ملت
-۳.۲۴ %	-۵۱,۷۳۰,۳۷۱	۲۱,۷۲۸,۴۰۶	-۷۳,۴۵۸,۷۷۷	۰	۳۹.۹۵ %	۷۵۱,۴۵۲,۹۰۹	۲۱,۷۲۸,۴۰۶	۷۲۹,۷۲۴,۵۰۳	۰	پتروشیمی جم
-۵.۴۱ %	-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۰	-۸۶,۳۵۵,۱۴۴	۰	-۰.۰۸ %	-۱,۴۹۴,۰۱۵	۰	-۱,۴۹۴,۰۱۵	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)

مستندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین مستندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱/۳۱/۱۳۹۷

(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	
۹۷۲,۴۵۱,۵۲۴	۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۶۹۲,۳۴۳,۰۲۴	۰	۴۳۲,۲۱۲,۵۰۹	۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۱۵۲,۱۰۴,۰۰۹	۰	سلف گزاینه ۹۷۱
۳,۸۶۲,۷۶۲	۰	۳,۸۶۲,۷۶۲	۰	۵,۶۵۷,۷۹۵	۰	۵,۶۵۷,۷۹۵	۰	اسنادخزانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰

مندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری
صورت وضعیت پورتفوی
برای ماه منتهی به ۱/۳۱/۱۳۹۷
(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
°	۲۰۰,۸۲۰,۸۶۷	°	۱۳۱,۲۰۰	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
°	°	°	°	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۱	۵۴۰,۹۹۸,۹۵۷	°	۳۴۷,۷۴۱,۹۰۸	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 ۱/۳۱/۱۳۹۷

(سایر درآمدها)

۱۳۹۷/۰۱/۳۱	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 بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱/۳۱/۱۳۹۷

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	۱,۰۹۳,۷۸۵,۸۳۰	%۵۸.۱۵	%۰.۵۵
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۴۳۷,۸۷۰,۳۰۴	%۲۳.۲۸	%۰.۲۲
درآمد سپرده بانکی	۳۴۷,۸۷۳,۱۰۸	% - ۱۸.۴۹	%۰.۱۷