

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(سهام)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۷/۰۲/۳۱			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				
%۲۳.۰۱	۴۸,۰۱۲,۴۶۴,۴۲۴	۰	۱,۸۶۶	۲۵,۸۳۳,۲۲۷	۰	۰	۳۵۰,۸۶۸,۲۹۹	۱۸۸,۸۳۹	۴۷,۹۹۳,۵۴۳,۶۹۰	۴۹,۰۳۹,۸۴۰,۰۴۵	۲۵,۶۴۴,۳۸۸	بیمه ملت
%۳۳.۰۵	۶۸,۹۸۰,۹۶۵,۰۴۶	۰	۱۱,۹۷۲	۵,۷۸۴,۹۴۰	۱۰,۳۳۸,۶۶۱,۱۸۲	۹۷۹,۲۴۴	۴,۴۳۹,۳۶۸,۲۵۶	۴۳۶,۷۱۳	۶۳,۲۱۱,۳۱۰,۶۳۹	۶۴,۸۴۷,۱۹۰,۷۵۵	۶,۳۲۷,۴۷۱	پتروشیمی جم
%۹.۷۴	۲۰,۳۲۰,۴۰۴,۰۸۶	۰	۱۳,۴۹۳	۱,۵۱۲,۰۲۹	۸,۹۰۸,۶۹۷	۷۰۰	۱۷۷,۲۵۶,۱۸۳	۱۲,۷۲۹	۲۰,۰۴۳,۷۰۵,۲۴۰	۲۰,۱۳۰,۰۶۰,۳۸۴	۱,۵۰۰,۰۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(تبعی)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱				۱۳۹۷/۰۲/۳۱				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(اوراق مشارکت)

اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت				اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت				اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت				اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
درآمد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده	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										
%۰.۲۰	۴۲۳	۰	۹۴۰	۴۵۰	۰	۰	۰	۰	۴۱۰	۴۰۶	۴۵۰	۰	۰	۱۳۹۷/۰۷/۱۰	۱۳۹۶/۱۰/۱۳	فرابورسی	بله	استادخانه ۳م بودجه ۹۷-۹۶
%۱۴.۲۷	۲۹,۷۷۸	۰	۱,۰۰۰	۲۹,۸۰۰	۰	۰	۲۹,۸۲۱,	۲۹,۸۰۰	۰	۰	۰	۲۰	۲۰	۱۳۹۷/۰۶/۳۱	۱۳۹۳/۰۶/۳۱	بورسی	بله	اوراق اجاره فولاد کاوه جنوب کیش
%۱۵.۳۰	۳۱,۰۹۲۸	۰	۲,۸۲۷	۱۱,۳۰۰	۰	۰	۰	۰	۳۱,۰۵۰	۳۰,۳۷۲	۱۱,۳۰۰	۱۷	۱۷	۱۳۹۷/۱۱/۰۹	۱۳۹۶/۱۱/۰۹	انرژی	بله	سلف گاز مایع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱						نام شرکت
دلایل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	درآمد تعدیل	مبلغ پس از تعدیل	قیمت پایانی	تعداد	

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(سپرده)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۷/۰۲/۳۱	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	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	۱۷,۸۷۹,۵۸۰	۱۷,۸۷۹,۵۸۰	۱۳۵,۶۰۰	۱۷,۷۴۳,۹۸۰	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۰۴	سپرده کوتاه مدت	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
%۰	۷,۴۷۱,۶۰۳	۷,۴۸۱,۶۰۳	۰	۷,۴۸۱,۶۰۳	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۴	حساب جاری	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	سامان سی تیر
%۰	۵۰۰,۰۰۰	۳۲,۶۳۰,۵۷۷,۳۴۱	۳۲,۶۳۰,۰۷۷,۳۴۱	۵۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	حساب جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
%۳.۶۱	۷,۵۳۲,۳۰۲,۳۸۴	۴۰,۱۶۳,۱۱۴,۷۲۵	۷,۵۹۲,۵۷۶,۶۱۸	۳۲,۵۷۰,۵۳۸,۱۰۷	۱۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	سپرده کوتاه مدت	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(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 - ۳۵ بودجه ۹۶ - ۹۷۰۷۱۰
۴۰۶,۴۷۷,۴۴۱		۴۰۶,۴۷۷,۴۴۱	۴۰۶,۴۷۷,۴۴۱		۴۰۶,۴۷۷,۴۴۱	۲۰	۱۳۹۷/۰۶/۳۱		اوراق اجاره فولادکاو جنوب کیش
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	سامان سی تیر
۲۰۱,۱۰۳,۴۷۷	۱۶۱	۲۰۱,۱۰۳,۳۱۶	۲۸۷,۲۶۶	-۱۱	۲۸۷,۲۷۷	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
۹۱۰,۹۰۶,۲۳۷	۵۱,۳۸۴	۹۱۰,۸۵۴,۸۵۳	۳۸۰,۲۰۳,۳۷۱	-۱۹۷۴۹۰	۳۸۰,۴۰۰,۸۶۱	۱۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(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	تاریخ مجمع	

صندوق سرمایه‌گذاری اختتامی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(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	
۹,۷۲۵,۵۶۴,۳۸۶	۵۹,۲۵۵,۴۰۰,۶۶۰	۶۸,۹۸۰,۹۶۵,۰۴۶	۵,۷۸۴,۹۴۰	۱۱,۳۶۱,۴۴۴,۵۰۳	۵۷,۶۱۹,۵۲۰,۵۴۳	۶۸,۹۸۰,۹۶۵,۰۴۶	۵,۷۸۴,۹۴۰	پنروشیمی جم
۲۲,۴۸۱,۳۱۶	۲۰,۲۹۷,۹۲۲,۷۶۹	۲۰,۳۲۰,۴۰۴,۰۸۵	۱,۵۱۲,۰۲۹	۱۰۸,۸۳۶,۴۶۰	۲۰,۲۱۱,۵۶۷,۶۲۵	۲۰,۳۲۰,۴۰۴,۰۸۵	۱,۵۱۲,۰۲۹	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
-۱,۲۹۰,۴۶۸,۸۳۴	۴۹,۳۰۲,۹۳۳,۲۵۸	۴۸,۰۱۲,۴۶۴,۴۲۳	۲۵,۸۳۳,۲۲۷	-۳۳۱,۹۴۷,۵۶۴	۴۸,۳۴۴,۴۱۱,۹۸۸	۴۸,۰۱۲,۴۶۴,۴۲۳	۲۵,۸۳۳,۲۲۷	بیمه ملت
-۴۳,۲۱۰,۰۰۰	۲۹,۸۲۱,۶۰۵,۰۰۰	۲۹,۷۷۸,۳۹۵,۰۰۰	۲۹,۸۰۰	-۴۳,۲۱۰,۰۰۰	۲۹,۸۲۱,۶۰۵,۰۰۰	۲۹,۷۷۸,۳۹۵,۰۰۰	۲۹,۸۰۰	اوراق اجاره فولدکاوه جنوب کیش
۱۶,۸۶۰,۵۸۲	۴۰۶,۱۹۶,۵۲۹	۴۲۳,۰۵۷,۱۱۱	۴۵۰	۶,۵۴۰,۹۵۵	۴۱۶,۵۱۶,۱۵۶	۴۲۳,۰۵۷,۱۱۱	۴۵۰	استادزانه-م-بودجه ۹۶-۹۷۰۷۱۰
۱,۵۵۶,۷۶۸,۰۴۵	۳۰,۳۷۲,۰۰۸,۵۰۰	۳۱,۹۲۸,۷۷۶,۵۴۵	۱۱,۳۰۰	۴۳۲,۲۱۲,۵۱۱	۳۱,۴۹۶,۵۶۴,۰۳۴	۳۱,۹۲۸,۷۷۶,۵۴۵	۱۱,۳۰۰	سلف گازمابع ۹۷۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(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	
-۴۸۵,۱۰۱	۹,۳۹۳,۷۹۸	۸,۹۰۸,۶۹۷	۷۰۰	-۴۸۵,۱۰۱	۹,۳۹۳,۷۹۸	۸,۹۰۸,۶۹۷	۷۰۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
۱۴۵,۸۵۸,۰۵۹	۱۶,۰۷۱,۱۳۰,۴۳۹	۱۶,۲۱۶,۹۸۸,۴۹۸	۱,۵۶۷,۹۳۱	۱۲۴,۱۲۹,۶۵۳	۱۵,۷۱۲,۲۴۳,۵۸۷	۱۵,۸۳۶,۳۷۳,۲۴۰	۱,۵۳۲,۹۳۱	پتروشیمی جم
۱۳,۵۴۰,۹۴۴	۴۵۹,۴۵۲,۸۵۰	۴۷۲,۹۹۳,۷۹۴	۲۴۳,۷۴۲	-۲۳۴,۹۹۲	۱۴,۹۹۳,۴۳۹	۱۴,۷۵۸,۴۴۷	۷,۸۵۴	بیمه ملت
۲۸۰,۱۰۸,۵۰۰	۹,۸۵۳,۱۰۰,۰۰۰	۱۰,۱۳۳,۲۰۸,۵۰۰	۳,۷۰۰	۰	۰	۰	۰	سلف گاز مایع ۹۷۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(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	
۰.۱۸ %	۲۱,۹۹۶,۲۱۵	-۴۸۵,۱۰۱	۲۲,۴۸۱,۳۱۶	۰	%۱.۰۴	۱۰۸,۳۵۱,۳۵۹	-۴۸۵,۱۰۱	۱۰۸,۸۳۶,۴۶۰	۰	گروه صنعتی ملی (هلدینگ)
%۸۲.۱۸	۹,۸۷۱,۴۲۲,۴۴۵	۱۴۵,۸۵۸,۰۵۹	۹.۷۲۵.۵۶۴.۳۸۶	۰	%۹۵.۰۶	۹.۹۲۳.۱۵۲.۸۱۷	۱۲۴.۱۲۹.۶۵۳	۹.۷۹۹.۰۲۳.۱۶۴	۰	پتروشیمی جم
-۱۰.۶۳%	-۱,۲۷۶,۹۲۷,۸۹۰	۱۳,۵۴۰,۹۴۴	-۲۹۰.۴۶۸.۸۳۴	۰	%-۱۲.۳۷	-۱.۲۹۰.۹۹۹.۴۴۵	-۲۳۴.۹۹۲	-۱.۲۹۰.۷۶۴.۴۵۳	۰	بیمه ملت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳/۳/۱۳۹۷

(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	
۱۰۸۳۶۰۸۷۶۰۵۴۵	۲۸۰۰۱۰۸۰۵۰۰	۱۰۵۵۶۰۷۶۸۰۰۴۵	۰	۸۷۸۰۳۶۷۰۳۵۹	۰	۸۷۸۰۳۶۷۰۳۵۹	۰	سلف گز مایع ۹۷۱
۱۶۰۸۶۰۰۵۸۲	۰	۱۶۰۸۶۰۰۵۸۲	۰	۱۲۰۹۹۷۰۸۲۰	۰	۱۲۰۹۹۷۰۸۲۰	۰	استادخانه-۳م بودجه ۹۶-۹۷۱۰
۳۶۳۰۲۶۷۰۴۴۱	۰	-۴۳۰۲۱۰۰۰۰۰	۴۰۶۰۴۷۷۰۴۴۱	۳۶۳۰۲۶۷۰۴۴۱	۰	-۴۳۰۲۱۰۰۰۰۰	۴۰۶۰۴۷۷۰۴۴۱	اوراق اجاره فولادکاوہ جنوب کیش

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(درآمد سپرده بانکی)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		طی ماه		نام سپرده بانکی	
درآمد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درآمد 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	۲۰۱,۱۰۳,۳۱۶	۰	۲۸۷,۲۷۷	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	۹۱۰,۸۵۴,۸۵۳	۰	۳۸۰,۴۰۰,۸۶۱	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(سایر درآمدها)

۱۳۹۷/۰۳/۳۱	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 سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش‌آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

برای ماه منتهی به ۱۳۹۷/۰۳/۳۱

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی های صندوق
سرمایه گذاری در سهام	۸.۷۴۰.۵۰۴.۷۳۱	%۸۳.۷۳	%۴۰.۱۹
سرمایه گذاری در اوراق بهادار	۱.۲۵۴.۶۳۲.۶۲۰	%۱۲.۰۲	%۰.۶۰
درآمد سپرده بانکی	۳۸۰.۶۸۸.۱۳۸	%۳.۶۵	%۰.۱۸