

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پور تفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(سهام)

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۸/۳۰			تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۹/۳۰				
	تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)		
				تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	مبلغ فروش (میلیون ریال)					
بیمه ملت	۵,۷۶۴,۵۸۹	۲۹,۶۴۳	۳۱,۱۱۴	۱,۴۹۹,۸۱۱	۱۰,۰۲۰	-۴,۵۲۹,۱۷۶	۳۰,۱۹۹	۲,۷۳۵,۲۲۴	۷,۰۱۱	۱۵,۹۲۴	۱۹,۱۰۰	۱,۸۶ %
پتروشیمی جم	۴,۹۸۵,۴۸۶	۵۷,۹۲۶	۶۱,۷۷۷	۱,۹۵۳	۲۶	-۲۰,۰۰۰	۲۷۳	۴,۹۶۷,۴۳۹	۱۳,۸۲۱	۵۷,۷۲۰	۶۸,۳۸۱	۶,۶۵ %
پلی پروپیلن جم	۲۰,۳۶۰,۱۷۷	۵۸۶,۵۴۱	۵۴۲,۵۸۳	۳۰,۰۰۰	۸۳۲	-۱۰۰,۰۰۰	۲,۸۱۸	۲۰,۳۹۰,۱۷۷	۲۸,۸۰۶	۵۸۴,۴۹۳	۵۸۲,۱۴۷	۵۶,۵۸ %
گوهران امید	۳,۷۳۲,۳۹۴	۹,۷۷۸	۹,۸۶۶	۸۹۱,۴۰۶	۳,۰۳۷	-۱,۹۴۰,۰۰۰	۶,۳۶۸	۲,۶۸۳,۸۰۰	۳,۵۸۰	۷,۱۵۸	۹,۵۷۰	۰,۹۳ %
گروه صنعتی ملی	۲۲۲,۴۲۹	۱۳,۵۳۹	۱۵,۹۰۰	.	.	-۲۲۲,۴۲۹	۱۸,۵۰۴	.	.	.	.	۰,۰۰ %
وصندوق	.	.	.	۱۱۰,۰۰۰	۴۵۷	.	.	۱۱۰,۰۰۰	۴۵۷	۴۵۹	۴۵۹	۰,۰۴ %
ح . گوهران امید	.	.	.	۷۰۶,۴۷۸	.	.	.	۷۰۶,۴۷۸	۲,۵۷۸	۹۵۲	۱,۸۱۴	۰,۱۸ %
سیمان فارس	.	.	.	۴۵۰۰	۱۹۴	-۴,۵۰۰	۱۹۹	.	.	.	.	۰,۰۰ %



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(تبعی)

نام شرکت	۱۳۹۸/۰۸/۳۰				۱۳۹۸/۰۹/۳۰			
	تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نرخ موثر	تعداد اوراق تبعی	قیمت اعمال	تاریخ اعمال	نرخ موثر



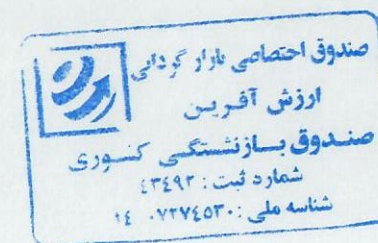
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۸/۰۹/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت						
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره (میلیون ریال)		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	بورسی یا فرا بورس	دارای مجوز از سازمان	نماد
۱,۸۰ %	۱۸,۵۵۵	۱۵,۶۰۱	۹۷۷,۲۷۶	۱۹,۰۰۰	۰	۰	۰	۰	۱۸,۳۰۳	۱۵,۶۰۱	۱۹,۰۰۰	۰	۰	۱۳۹۸/۱۱/۱۴	۱۳۹۶/۱۲/۰۲	بله	بله	اخزام ۱۲
۱۵,۷۱ %	۱۶۱,۶۴۳	۱۷۰,۹۰۳	۸۸۹,۱۲۶	۱۸۱,۹۳۲	۳۰,۴۴۹	۳۲,۶۰۰	۰	۰	۲۰۹,۴۴۶	۲۰۱,۱۹۱	۲۱۴,۵۳۲	۱۷	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲	۱۳۹۶/۰۹/۲۲	بله	بله	سلامت ۶



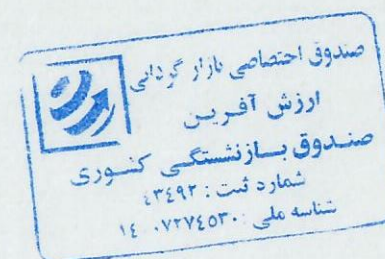
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۸/۰۹/۳۰						نام شرکت
تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(گواهی سپرده)

۱۳۹۸/۰۹/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۰۸/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
درصد به کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	تعداد	بورسی یا فرابورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سر رسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(سپرده)

سپرده	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۰۹/۳۰	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۶۳-۱۳۳۱۸۹۱۸-۱	حساب جاری	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۵۰۰,۰۰۰	۹۴,۷۶۰,۲۷۹,۵۷۱	۹۴,۷۶۰,۲۷۹,۵۷۱	۵۰۰,۰۰۰
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۳۳۱۸۹۱۸-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۱۳۸,۸۸۱,۱۹۲,۹۲۵	۱۱۴,۷۵۱,۸۳۲,۰۴۴	۹۴,۷۶۰,۷۲۹,۵۷۱	۱۵۸,۸۷۲,۲۹۵,۳۹۸
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۴/۰۵	۰	۲۵,۴۹۸,۷۹۲	۰	۰	۲۵,۴۹۸,۷۹۲
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰
								درصد به کل دارایی‌ها
								۰,۰۰ %
								۱۵,۴۴ %
								۰,۰۰ %
								۰,۰۰ %



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(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 سر رسید	روز دریافت سود	توضیحات
۱۷,۰۱۶		۱۷,۰۱۶	۳,۰۴۶		۳,۰۴۶	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲		سلامت ۶
۱۴۸		۱۴۸	۰		۰	۲۱	۱۳۹۹/۰۲/۱۴		صکوک رایتل
۴,۶۶۹	۰	۴,۶۶۹	۹۳۴	۰	۹۳۴	۰		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۱۷	بانک ملت بورس کالا
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰		۲۵	بانک ملت بورس کالا



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(درآمد سود سهام)

نام شرکت	اطلاعات مجمع		طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه		
	تاریخ مجمع	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	سود متعلق به هر سهم	جمع درآمد سود سهام	هزینه تنزیل	خالص درآمد سود سهام	جمع درآمد سود سهام (ریال)	هزینه تنزیل
بیمه ملت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۱۷,۳۳۱,۷۱۶	۲۵۰	۰	۰	۰	۴,۳۳۳	۰
پتروشیمی جم	۱۳۹۸/۰۴/۱۹	۵,۱۹۲,۸۳۳	۱,۶۷۰	۰	۰	۰	۸,۶۷۲	۰



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نماد
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	
۸۶۲	۹۵۲	۱,۸۱۴	۷۰۶,۴۷۸	۸۶۲	۹۵۲	۱,۸۱۴	۷۰۶,۴۷۸	ح. گوه‌ران امید
۲	۴۵۷	۴۵۹	۱۱۰,۰۰۰	۲	۴۵۷	۴۵۹	۱۱۰,۰۰۰	وصندوق
			.	۲,۲۱۵	۲,۲۱۵		.	وملی
۳,۲۱۴	۱۵,۸۸۶	۱۹,۱۰۰	۲,۷۳۵,۲۲۴	۱,۶۰۷	۱۷,۴۹۳	۱۹,۱۰۰	۲,۷۳۵,۲۲۴	ملت
۲,۳۵۰	۵۸۴,۴۹۷	۵۸۲,۱۴۷	۲۰,۲۹۰,۱۷۷	۴۱,۶۱۲	۵۴۰,۵۳۴	۵۸۲,۱۴۷	۲۰,۲۹۰,۱۷۷	جم پیلن
۷۳۶	۶۹,۱۱۷	۶۸,۳۸۱	۴,۹۶۷,۴۳۹	۶,۸۵۶	۶۱,۵۲۵	۶۸,۳۸۱	۴,۹۶۷,۴۳۹	پتروشیمی جم
۲,۳۰۹	۷,۲۶۱	۹,۵۷۰	۲,۶۸۳,۸۰۰	۲,۴۲۲	۷,۱۴۷	۹,۵۷۰	۲,۶۸۳,۸۰۰	گوه‌ران امید
۱۱,۲۸۵	۱۷۲,۹۲۸	۱۶۱,۶۴۳	۱۸۱,۹۳۲	۱۷,۵۱۴	۱۷۹,۱۵۸	۱۶۱,۶۴۳	۱۸۱,۹۳۲	مراجعه سلامت ۶
۱,۶۹۸	۱۶,۸۵۷	۱۸,۵۵۵	۱۹,۰۰۰	۲۵۲	۱۸,۳۰۳	۱۸,۵۵۵	۱۹,۰۰۰	اخزا-م ۱۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(درآمد ناشی از فروش)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نام شرکت (نماد)
سود و زیان ناشی از فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	سود و زیان ناشی از فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	
۸۸۷	۱۵۰۲۷۱	۱۴۰۳۸۴	۱۰۰۹۳۰۳۶۶	۶	۲۷۸	۲۷۳	۲۰۰۰۰	پتروشیمی جم
۱۰۰۵۶۴	۳۷۰۳۱۵	۴۷۰۸۷۹	۱۷۰۷۶۴۰۵۶۴	۱۰۵۶۵	۴۸۰۳	۶۰۳۶۸	۱۰۹۴۰۰۰۰	گوهران امید
۲۶۰۹۶۹	۱۳۱۰۱۵۵	۱۵۸۰۱۲۴	۳۴۰۲۱۹۰۸۲۸	۶۰۵۵۸	۲۳۰۶۴۱	۳۰۰۱۹۹	۴۰۵۲۹۰۱۷۶	بیمه ملت
۳	۲۶۰۸۷۸	۲۶۰۸۷۴	۹۴۳۰۳۸۸	۶۲	۲۰۸۸۱	۲۰۸۱۸	۱۰۰۰۰۰	جم پیلن
۳۱۰۲۴۳	۴۷۰۹۱۱	۷۹۰۱۵۴	۱۰۵۱۶۰۴۵۰	۴۰۸۱۹	۱۳۰۶۸۵	۱۸۰۵۰۴	۲۲۲۰۴۲۹	وملی
۱۶۱	۳۰۰۲۸۸	۳۰۰۴۴۹	۳۲۰۶۰۰	۱۶۱	۳۰۰۲۸۸	۳۰۰۴۴۹	۳۲۰۶۰۰	مراجعه سلامت ۶
۲۹	۱۰۰۴۴۵	۱۰۰۴۱۶	۱۰۰۳۰۹	۰	۰	۰	۰	صکوک اجاره رایتل ماهانه ۲۱٪
	۶۰	۶۰	۶۰	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۸
۷۴۸	۹۰۲۸۶	۱۰۰۰۳۴	۱۰۰۰۳۴	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۴
۱۶	۵۱۱	۵۲۷	۵۲۷	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۲۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(سرمایه‌گذاری در سهام)

نام شرکت	طی ماه					از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	مبلغ (میلیون ریال)	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	مبلغ (میلیون ریال)	درصد از کل درآمدها
پتروشیمی جم	۰	۶,۸۵۶	۶	۶,۸۵۱	۱۳,۳۶ %	۸,۶۷۲	۷۳۶	۸۸۷	۷,۰۴۹	۷,۱۴ %
توسعه گوه‌ران امید	۰	۲,۴۲۲	۱,۵۶۵	۳,۹۸۷	۷,۷۸ %		۲,۳۰۹	۱۰,۵۶۴	۱۲,۸۷۳	۱۳,۰۳ %
بیمه ملت	۰	۱,۶۰۷	۶,۵۵۸	۸,۱۶۵	۱۵,۹۳ %	۴,۳۳۳	۳,۲۱۴	۲۶,۹۶۹	۳۴,۵۱۶	۳۴,۹۴ %
بلی پروپیلن جم	۰	۴۱,۶۱۲	۶۲	۴۱,۵۵۰	۸۱,۰۴ %		۲,۳۵۰	۳	۲,۳۵۴	-۲,۳۸ %
گروه صنعتی ملی	۰	۲,۲۱۵	۴,۸۱۹	۲,۶۰۴	۵,۰۸ %			۳۱,۲۴۳	۳۱,۲۴۳	۳۱,۶۳ %
ح. گوه‌ران امید	۰	۸۶۲		۸۶۲	۱,۶۸ %		۸۶۲		۸۶۲	۰,۸۷ %
وصندوق	۰	۲		۲	۰,۰۰ %		۲		۲	۰,۰۰ %



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(سرمایه‌گذاری در اوراق)

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	
۵,۸۹۲,۲۱۷,۶۰۲	۱۶۰,۸۳۴,۳۸۴	-۱۱,۲۸۵,۰۶۸,۷۷۰	۱۷,۰۱۶,۴۵۱,۹۸۸	-۱۴,۳۰۷,۹۲۹,۳۷۶	۱۶۰,۸۳۴,۳۸۴	-۱۷,۵۱۴,۳۱۶,۵۴۶	۳,۰۴۵,۵۵۲,۷۸۶	مربحه سلامت ۶
۱۱۸,۹۷۰,۴۸۲	-۲۹,۳۷۱,۹۳۸	.	۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰	.	.	.	.	صایتل ۲۱ %
۴۶۷,۵۷۳	۴۶۷,۵۷۳	.	.	.	.	.	.	اخزا-م ۸
۷۴۷,۶۹۸,۱۸۴	۷۴۷,۶۹۸,۱۸۴	.	.	.	.	.	.	اخزا-م ۴
۱۶,۱۵۱,۱۲۳	۱۶,۱۵۱,۱۲۳	.	.	.	.	.	.	اخزا-م ۲۲
.	.	.	.	.	.	.	.	اخزا-م ۹
۱,۶۹۸,۲۰۳,۹۰۹	.	۱,۶۹۸,۲۰۳,۹۰۹	.	۲۵۲,۱۵۶,۰۵۵	.	۲۵۲,۱۵۶,۰۵۵	.	اخزا-م ۱۲



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(درآمد سپرده بانکی)

نام سپرده بانکی		طی ماه		از ابتدای سال مالی تا پایان ماه	
نام سپرده	شماره حساب	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده	سود سپرده بانکی و گواهی سپرده	درصد سود به میانگین سپرده
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	.	.	.	.
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	.	.	۱۴۵,۲۹۲	.
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	.	.	.	.
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	.	.	.	.
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	۹۳۳,۷۵۹,۴۳۱	.	۴,۶۶۹,۳۸۰,۵۰۷	.
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	.	.	.	.
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	.	.	.	.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(سایر درآمدها)

۱۳۹۸/۰۹/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۵۵۹,۳۷۸	۴۰,۸۹۴	سایر درآمدها
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۵۵۹,۳۷۸	۴۰,۸۹۴	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۰۹/۳۰

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۶۴۰.۲۶.۲۵۴.۶۲۸	۱۲۴,۸۸ %	۶,۲۲ %
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	-۱۴۰.۵۵.۷۷۳.۳۲۱	-۲۷,۴۲ %	-۱,۳۷ %
درآمد سپرده بانکی	۹۳۳.۷۵۹.۴۳۱	۱,۸۲ %	۰,۰۹ %

