

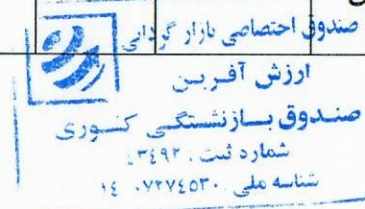
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سهام)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰			نام شرکت
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	قیمت بازار	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	
					مبلغ فروش (میلیون ریال)	تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد				
۲,۲۳ %	۲۷,۷۱۰	۲۵,۲۳۴	۸,۲۵۸	۳,۳۶۹,۰۰۵	۶۸,۸۷۹	-۷,۹۲۲,۹۳۵	۲۰,۰۴۹	۲,۴۶۰,۷۱۶	۶۸,۳۳۶	۵,۹۸۱	۸,۸۳۱,۲۲۴	بیمه ملت
۶,۱۰ %	۷۵,۸۲۰	۵۳,۸۴۱	۱۶,۶۹۰	۴,۵۶۱,۰۴۸	۸,۳۶۳	-۵۲۶,۱۰۰	۳,۴۸۳	۲۳۰,۰۰۰	۷۵,۸۴۶	۵۶,۵۴۵	۴,۸۵۷,۱۴۸	جم
۶۰,۲۶ %	۷۴۸,۸۷۱	۵۷۲,۰۷۲	۳۸,۰۱۰	۱۹,۷۸۰,۸۶۹	۱۰,۳۰۳	-۲۸۰,۰۰۰	۵,۴۰۱	۱۵۶,۴۶۸	۶۸۲,۱۵۸	۵۷۴,۷۶۶	۱۹,۹۰۴,۴۰۱	جم پیلن
۰,۱۴ %	۱,۷۶۸	۹۵۲	۲,۵۱۳	۷۰۶,۴۷۸	.	.	.	.	۱,۵۶۶	۹۵۲	۷۰۶,۴۷۸	ح. گوه‌ران
۰,۴۷ %	۵,۸۶۳	۵,۳۴۸	۳,۵۱۳	۱,۶۷۵,۷۸۱	۳,۱۳۶	-۸۵۹,۱۳۵	۱,۸۶۲	۵۳۰,۰۰۰	۶,۶۹۴	۶,۱۷۳	۲,۰۰۴,۹۱۶	گوه‌ران
۰,۲۸ %	۳,۵۱۶	۳,۱۴۹	۵,۸۶۱	۶۰۲,۴۳۷	۲,۵۲۱	-۴۸۰,۰۰۰	۳,۱۱۹	۵۹۰,۰۰۰	۲,۵۰۷	۲,۳۸۲	۴۹۲,۴۳۷	وصندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(تبعی)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰				۱۳۹۸/۱۰/۳۰				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	



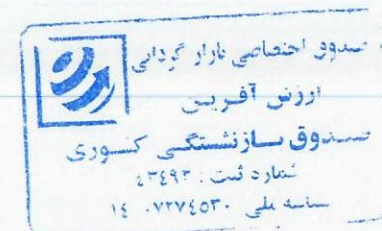
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰			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		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (میلیون)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	نرخ سود موثر	نرخ	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								
۰,۰۰ %	.	.	.	.	۱۹,۰۰۰	۱۹,۰۰۰	.	.	۱۸,۸۴۸	۱۵,۶۰۱	۱۹,۰۰۰	.	.	۱۳۹۸/۱۱/۱۴	۱۳۹۶/۱۲/۰۲	اخزا-م ۱۲
۱۲,۸۲ %	۱۵۹,۳۷۸,	۱۷۰,۹۰۳	۸۷۶,۶۶۷	۱۸۱,۹۳۲	.	.	.	.	۱۶۳,۴۰۵	۱۷۰,۹۰۳	۱۸۱,۹۳۲	۱۷	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲	۱۳۹۶/۰۹/۲۲	مراجعه سلامت ۶



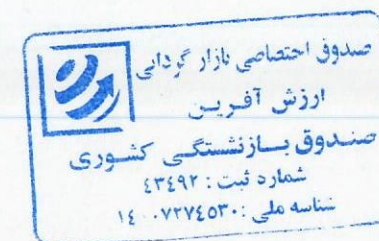
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰						نام شرکت
تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(گواهی سپرده)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۰/۳۰			اطلاعات اوراق گواهی سپرده				
درصد به کل دارایی ها	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 ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سپرده)

سپرده	مشخصات حساب بانکی				۱۳۹۸/۱۰/۳۰	تغییرات طی دوره		۱۳۹۸/۱۱/۳۰	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش	کاهش	مبلغ	درصد به کل دارایی‌ها
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	حساب جاری	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۶۸۰,۰۰۰	۲۸,۴۷۶,۶۲۵,۵۵۹	۲۸,۴۷۶,۶۲۵,۵۵۹	۶۸۰,۰۰۰	۰,۰۰ %
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۱۲۹,۱۹۱,۱۶۵,۸۹۰	۱۰۱,۴۹۴,۸۳۰,۲۰۵	۲۸,۴۷۷,۱۹۵,۵۵۹	۲۰۲,۲۰۸,۸۰۰,۵۳۶	۱۶,۲۷ %
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۴/۰۵	۰	۲۵,۱۴۸,۷۹۲	۰	۰	۲۵,۱۴۸,۷۹۲	۰,۰۰ %
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰,۰۰ %



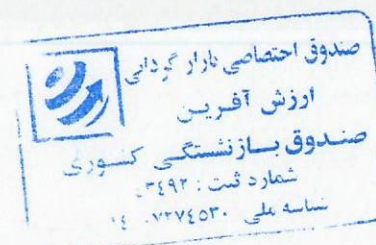
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سود اوراق بهادار و سپرده های 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
۲۱,۸۴۸,۳۵۸,۳۴۱		۲۱,۸۴۸,۳۵۸,۳۴۱	۲,۴۵۱,۹۶۴,۷۵۹		۲,۴۵۱,۹۶۴,۷۵۹	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲		مراجعه سلامت ۶
۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰		۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰	.		.	۲۱	۱۳۹۹/۰۲/۱۴		صکوک اجاره رایتل
۱۴۵,۲۹۲	.	۱۴۵,۲۹۲	.	.	.	.		۴	بانک سامان سی تیر
۶,۴۳۹,۷۶۵,۵۴۰	.	۶,۴۳۹,۷۶۵,۵۴۰	۹۶۴,۹۲۰,۸۸۶	.	۹۶۴,۹۲۰,۸۸۶	.		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی



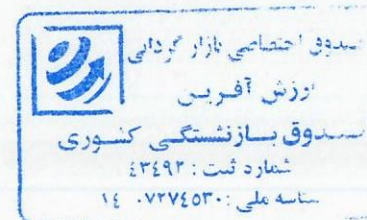
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(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	هزینه تنزیل
بیمه ملت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۱۷,۳۳۱,۷۱۶	۲۵۰	۰	۰	۰	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰	۰
پتروشیمی جم	۱۳۹۸/۰۴/۱۹	۵,۱۹۲,۸۳۳	۱,۶۷۰	۰	۰	۰	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰	۰
گوهران امید	۱۳۹۸/۱۱/۱۹	۱,۶۳۵,۷۸۱	۴۰۰	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰	۸۹,۷۱۶,۵۹۴	۵۶۴,۵۹۵,۸۰۶	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰	۸۹,۷۱۶,۵۹۴
							۵۶۴,۵۹۵,۸۰۶	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت (میلیون ریال)	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)
ح. گوهرا	۷۰۶,۴۷۸	۱,۷۶۸	۱,۵۶۶	۲۰۱	۷۰۶,۴۷۸	۱,۷۶۸	۹۵۲
امید							۸۱۶
وصندوق	۶۰۲,۴۳۷	۳,۵۱۷	۳,۲۷۴	۲۴۲	۶۰۲,۴۳۷	۳,۵۱۷	۳,۱۴۹
بیمه ملت	۳,۳۶۹,۰۰۵	۲۷,۷۱۰	۳۳,۷۷۲	-۶,۰۶۲	۳,۳۶۹,۰۰۵	۲۷,۷۱۰	۲۵,۲۳۱
جم پیلن	۱۹,۷۸۰,۸۶۹	۷۴۸,۸۷۱	۶۷۹,۴۶۴	۶۹,۴۰۷	۱۹,۷۸۰,۸۶۹	۷۴۸,۸۷۰	۵۷۲,۰۷۶
پتروشیمی جم	۴,۵۶۱,۰۴۸	۷۵,۸۲۰	۷۱,۹۸۹	۳,۸۳۱	۴,۵۶۱,۰۴۸	۷۵,۸۲۰	۶۳,۷۴۲
گوهرا امید	۱,۶۷۵,۷۸۱	۵,۸۶۳	۵,۸۵۸	۵	۱,۶۷۵,۷۸۱	۵,۸۶۳	۵,۳۶۶
مراجعه سلامت ۶	۱۸۱,۹۳۲	۱۵۹,۳۷۸	۱۶۳,۴۰۵	-۴,۰۲۷	۱۸۱,۹۳۲	۱۵۹,۳۷۸	۱۷۲,۹۲۸
صندوق اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین							
صندوق بازنشتگی کشوری							
شماره ثبت: ۳۴۹۲							
سأله ملی: ۷۲۷۴۵۳۰							
۱۴							

صندوق اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین
صندوق بازنشتگی کشوری
شماره ثبت: ۳۴۹۲
سأله ملی: ۷۲۷۴۵۳۰
۱۴

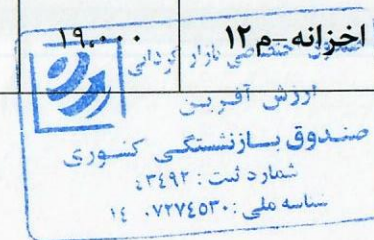
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پور تقوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(درآمد ناشی از فروش)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نام شرکت
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	
۲۶۶	۴,۹۸۹	۵,۲۵۶	۱,۰۸۱,۰۰۰	۱۶۹	۲,۳۵۱	۲,۵۲۱	۴۸۰,۰۰۰	وصندوق
۳۲۱	۲۴,۷۰۴	۲۵,۰۲۶	۱,۷۶۹,۸۰۹	۱,۰۲۲	۷,۳۴۱	۸,۳۶۳	۵۲۶,۱۰۰	پتروشیمی جم
۱۲,۲۱۲	۴۸,۳۳۵	۶۰,۵۴۶	۲۱,۵۰۵,۰۲۸	۴۳۸	۲,۶۹۷	۳,۱۳۶	۸۵۹,۱۳۵	گوهران امید
۴۳,۶۲۷	۲۰۷,۹۴۹	۲۵۱,۵۷۶	۴۵,۶۴۲,۷۶۳	۱۴,۲۶۶	۵۴,۶۱۲	۶۸,۸۷۹	۷,۹۲۲,۹۳۵	بیمه ملت
۴,۰۹۱	۶۰,۹۸۳	۶۵,۰۷۴	۲,۱۲۵,۳۹۸	۲,۲۰۸	۸,۰۹۵	۱۰,۳۰۳	۲۸۰,۰۰۰	جم پیلن
۲,۱۴۳	۱۶,۸۵۶	۱۹,۰۰۰	۱۹,۰۰۰	۲,۱۴۳	۱۶,۸۵۷	۱۹,۰۰۰		



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سرمایه‌گذاری در سهام)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه					طی ماه					نام شرکت
درصد از کل درآمدها	مبلغ (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود سهام (میلیون ریال)	درصد از کل درآمدها	مبلغ (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود سهام	
۰,۲۰ %	۶۳۴	۲۶۶	۳۶۷	۰	۰,۴۸ %	۴۱۲	۱۶۹	۲۴۲	۰	وصندوق
۶,۶۲ %	۲۱۰,۷۲	۳۲۱	۱۲۰,۷۸	۸,۶۷۲	۵,۶۲ %	۴,۸۵۴	۱۰,۲۲	۳,۸۳۱	۰	پتروشیمی جم
۴,۱۷ %	۱۳,۲۷۴	۱۲,۲۱۱	۴۹۷	۵۶۵	۱,۱۷ %	۱,۰۰۸	۴۳۸	۵	۵۶۴,۵۹۵,۸۰۶	گوهران امید
۱۵,۸۴ %	۵۰,۴۳۹	۴۳,۶۲۷	۲,۴۷۹	۴,۳۳۲	۹,۵۱ %	۸,۲۰۴	۱۴,۲۶۶	-۶,۰۶۲	۰	بیمه ملت
۵۶,۸۰ %	۱۸۰,۸۸۶	۴۰,۹۱	۱۷۶,۷۹۴	۰	۸۲,۹۸ %	۷۱,۶۱۵	۲,۲۰۸	۶۹,۴۰۷	۰	جم پیلن
۹,۸۱ %	۳۱,۲۴۳	۳۱,۲۴۳	۰	۰	۰,۰۰ %	۰	۰	۰	۰	وملی
۰,۲۶ %	۸۱۶	۰	۸۱۵	۰	۰,۲۳ %	۲۰۲	۰	۲۰۲	۰	ح. گوهران امید



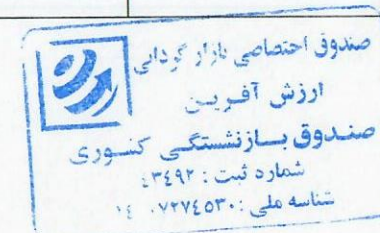
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سرمایه گذاری در اوراق بهادار)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				توضیحات
جمع (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود اوراق (میلیون ریال)	جمع (میلیون ریال)	درآمد فروش (درآمد فروش)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود اوراق	
۲,۱۴۳	۲,۱۴۳	۰	۰	۱۵۲	۲,۱۴۳	-۱,۹۹۲	۰	اخزا-م ۱۲
۱۱۹	-۲۹	۰	۱۴۸	۰	۰	۰	۰	صکوک اجاره رایتل
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۸
۷۴۸	۷۴۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۴
۱۶	۱۶	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزا-م ۲۲
۸,۴۵۹	۱۶۱	-۱۳,۵۵۰	۲۱,۸۴۸	-۱,۵۷۵	۰	-۴,۰۲۷	۲,۴۵۱,۹۶۴,۷۵۹	مراجعه سلامت ۶



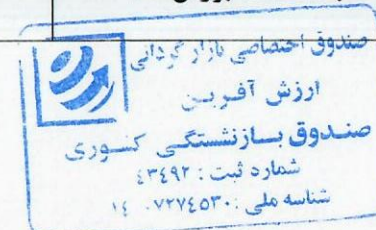
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(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	۱۸۶۹-۸۲۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	۹۶۴,۹۲۰,۸۸۶	.	۶,۴۳۹,۷۶۵,۵۴۰	.
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	.	.	.	.
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	.	.	.	.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(سایر درآمدها)

۱۳۹۸/۱۱/۳۰	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۴,۴۸۶,۹۸۸	.	سایر درآمدها
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
.	.	تعدیل کارمزد کارگزار
۴,۴۸۶,۹۸۸	.	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۸۶,۲۹۵,۲۶۹,۲۲۵	۹۹,۹۹ %	۶,۹۴ %
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	-۱,۴۲۳,۵۲۰,۶۲۰	-۱,۶۵ %	-۰,۱۱ %
درآمد سپرده بانکی	۹۶۴,۹۲۰,۸۸۶	۱,۱۲ %	۰,۰۸ %

