

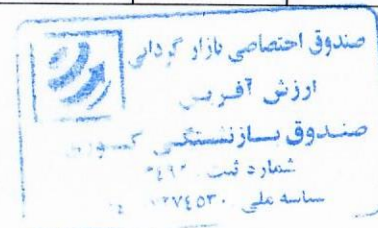
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(سهام)

نام شرکت	۱۳۹۸/۱۲/۲۹			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۱/۳۱			
	تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	قیمت بازار	بهای تمام شده (میلیون ریال)	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)
				تعداد	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	مبلغ فروش (میلیون ریال)				
ملت	۲,۲۳۹,۲۰۷	۱۷,۳۸۸	۱۷,۲۰۲	۲,۵۰۶,۳۹۸	۲۶,۹۴۰	۲,۰۲۰,۰۰۰	۱۸,۱۹۵	۲,۷۲۵,۶۰۵	۱۲,۱۵۸	۲۸,۱۸۰	۳۳,۰۰۶
جم	۴,۵۷۱,۰۴۸	۵۷,۰۱۱	۷۷,۲۲۹	۳۷۲,۲۳۶	۷,۳۴۱	۵۶۰,۰۰۰	۱۱,۰۵۶	۴,۳۸۳,۲۸۴	۲۲,۹۲۹	۵۷,۳۳۵	۱۰۰,۱۰۳
جم پیلن	۲۰,۰۶۰,۳۰۸	۵۹۳,۶۹۱	۷۷۱,۹۹۷	۳۷۸,۴۲۹	۱۸,۶۸۰	۷۵۰,۰۰۰	۳۴,۹۱۰	۱۹,۶۸۸,۷۳۷	۵۴,۵۳۲	۵۹۰,۱۲۱	۱,۰۶۹,۳۸۲
ح. گوه‌ران امید	۷۰۶,۴۷۸	۹۵۲	۲۰۲۵	*	*	*	*	۷۰۶,۴۷۸	۴,۵۷۹	۹۵۲	۲,۲۲۲
گوه‌ران امید	۲,۳۵۳,۹۳۳	۸,۶۳۶	۹,۰۹۴	۶۴۰,۰۰۰	۳,۱۳۶	۱,۶۸۰,۰۰۰	۸,۰۷۵	۱,۳۱۳,۹۳۳	۵,۵۷۹	۵,۴۱۶	۷,۳۰۱
وصندوق	۴۹۶,۲۳۷	۲,۷۷۹	۲,۸۵۱	۴۵,۰۰۰	۳۰۰	۱۰۰,۰۰۰	۶۷۴	۴۴۱,۲۳۷	۸,۲۳۷	۲,۵۱۲	۳,۶۲۰



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(تبعی)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱				۱۳۹۸/۱۲/۲۹				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 ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			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	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								
۱۰,۳۹ %	۱۷۰,۸۹۲	۱۷۰,۹۰۳	۹۴۰,۰۰۰	۱۸۱,۹۳۲	۰	۰	۰	۰	۱۷۰,۸۹۲	۱۷۰,۹۰۳	۱۸۱,۹۳۲	۱۷	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲	۱۳۹۶/۰۹/۲۲	سلامت ۶



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱						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 ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(گواهی سپرده)

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				تغییرات طی دوره				۱۳۹۸/۱۲/۲۹			۱۳۹۹/۰۱/۳۱		
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سر رسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فرابورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش		
													درصد به کل دارایی‌ها
													خالص ارزش فروش



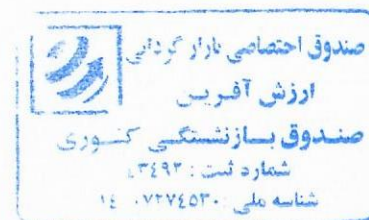
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(سپرده)

سپرده	مشخصات حساب بانکی				۱۳۹۸/۱۲/۲۹	تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۱/۳۱	
	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	۵۰۰,۰۰۰	۶,۷۰۸,۷۵۰,۹۵۴	۶,۷۰۸,۷۵۰,۹۵۴	۵۰۰,۰۰۰	۰,۰۰ %
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۲۱۰,۹۷۷,۰۱۳,۲۸۷	۶۵,۹۸۶,۲۹۲,۰۷۶	۳۱,۳۹۱,۱۳۸,۲۳۸	۲۴۵,۵۷۲,۱۶۷,۱۲۵	۱۴,۹۳ %
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۴/۰۵	۰	۲۵,۱۴۸,۷۹۲	۰	۳۰,۰۰۰	۲۵,۱۱۸,۷۹۲	۰,۰۰ %
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰,۰۰ %



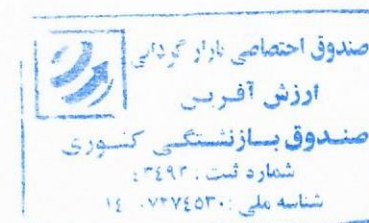
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(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	روز دریافت سود	توضیحات
۲۶,۹۶۸,۳۵۷,۳۱۶		۲۶,۹۶۸,۳۵۷,۳۱۶	۲,۶۸۱,۳۰۴,۳۶۸		۲,۶۸۱,۳۰۴,۳۶۸	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲		مراجعه سلامت ۶
۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰		۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰	.		.	۲۱	۱۳۹۹/۰۲/۱۴		صکوک رایتل ۲۱ %
۱۴۵,۲۹۲	.	۱۴۵,۲۹۲	.	.	.	.		۴	بانک سامان سی تیر
۹,۶۵۳,۰۱۹,۷۱۱	.	۹,۶۵۳,۰۱۹,۷۱۱	۱,۶۰۴,۸۷۴,۵۸۷	.	۱,۶۰۴,۸۷۴,۵۸۷	.		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(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	خالص درآمد سود سهام
بیمه ملت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۱۷,۳۳۱,۷۱۶	۲۵۰	۰	۰	۰	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰	۰	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰
پتروشیمی جم	۱۳۹۸/۰۴/۱۹	۵,۱۹۲,۸۳۳	۱,۶۷۰	۰	۰	۰	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰	۰	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰
گوهران امید	۱۳۹۸/۱۱/۱۹	۱,۶۳۵,۷۸۱	۴۰۰	۰	۰	۰	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰	۶۸,۹۵۹,۳۹۵	۵۸۵,۳۵۳,۰۰۵



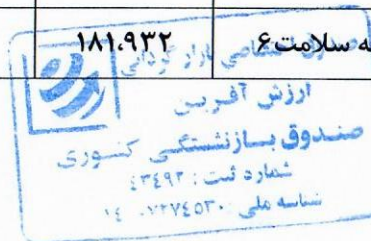
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				نام شرکت
سود و زیان ناشی از تغییر قیمت (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	بهای فروش (میلیون ریال)	تعداد	
۲,۲۷۰	۹۵۲	۳,۲۲۲	۷۰۶,۴۷۸	۱,۱۹۶	۲,۰۲۶	۳,۲۲۲	۷۰۶,۴۷۸	ح. گوه‌ران امید
۱,۱۰۸	۲,۵۱۲	۳,۶۲۰	۴۴۱,۲۳۷	۱,۰۳۶	۲,۵۸۴	۳,۶۲۰	۴۴۱,۲۳۷	وصندوق
۴,۸۲۶	۲۸,۱۸۰	۳۳,۰۰۶	۲,۷۲۵,۶۰۵	۵,۰۱۰	۲۷,۹۹۵	۳۳,۰۰۶	۲,۷۲۵,۶۰۵	ملت
۴۷۹,۲۵۸	۵۹۰,۱۲۴	۱,۰۶۹,۳۸۲	۱۹,۶۸۸,۷۳۷	۳۰۰,۹۵۶	۷۶۸,۴۲۶	۱,۰۶۹,۳۸۲	۱۹,۶۸۸,۷۳۷	جم پیلن
۳۵,۲۴۶	۶۴,۸۵۷	۱۰۰,۱۰۳	۴,۳۸۳,۲۸۴	۲۳,۶۵۵	۷۶,۴۴۸	۱۰۰,۱۰۳	۴,۳۸۳,۲۸۴	پتروشیمی جم
۱,۸۸۲	۵,۴۱۹	۷,۳۰۱	۱,۳۱۳,۹۳۳	۱,۴۳۱	۵,۸۷۰	۷,۳۰۱	۱,۳۱۳,۹۳۳	گوه‌ران امید
۱۹	۱۹	۰	۰	۰	۰	۰	۰	وصندوق
۲,۰۳۶	۱۷۲,۹۲۸	۱۷۰,۸۹۲	۱۸۱,۹۳۲	۰	۱۷۰,۸۹۲	۱۷۰,۸۹۲	۱۸۱,۹۳۲	مراجعه سلامت



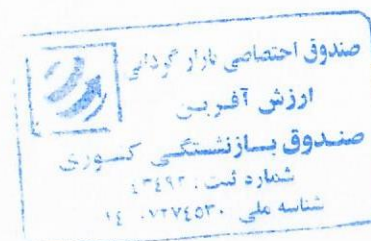
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(درآمد ناشی از فروش)

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	فروش (میلیون ریال)	بهای (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	سود و زیان ناشی از فروش (میلیون ریال)	تعداد	فروش (میلیون ریال)	بهای (میلیون ریال)
گوهران	۱,۶۸۰,۰۰۰	۸,۰۷۵	۶,۳۶۰	۱,۷۱۴	۲۴,۴۲۶,۸۷۶	۷۳,۵۸۴	۵۸,۷۷۵	۱۴,۸۱۰
ملت	۲,۰۲۰,۰۰۰	۱۸,۱۹۵	۱۶,۱۴۷	۲,۰۴۷	۵۰,۳۵۲,۵۶۱	۲۹۲,۶۲۰	۲۴۴,۴۵۱	۴۸,۱۶۸
جم پیلن	۷۵۰,۰۰۰	۳۴,۹۱۰	۲۲,۲۵۱	۱۲,۶۵۹	۳,۷۸۵,۹۵۹	۱۳۷,۳۲۵	۱۰۹,۷۴۶	۲۷,۵۷۹
جم	۵۶۰,۰۰۰	۱۱,۰۵۶	۸,۱۲۳	۲,۹۳۳	۳,۰۰۹,۸۰۹	۴۷,۷۰۱	۴۲,۴۵۷	۵,۲۴۳
وصندوق	۱۰۰,۰۰۰	۶۷۴	۵۶۷	۱۰۶	۱,۶۴۲,۲۰۰	۸,۷۷۱	۸,۰۳۴	۷۳۷



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(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	
۲,۴۵ %	۱۷,۲۷۷	۱۴,۸۰۹	۱,۸۸۲	۵۸۵	۰,۸۸ %	۳,۱۴۶	۱,۷۱۴	۱,۴۳۱	۰	گوهران امید
۸,۱۱ %	۵۷,۳۲۷	۴۸,۱۶۸	۴,۸۲۶	۴,۳۳۳	۱,۹۸ %	۷,۰۵۸	۲,۰۴۷	۵,۰۱۰	۰	ملت
۷۱,۷۴ %	۵۰۶,۸۳۷	۲۷,۵۷۹	۴۷۹,۲۵۸	۰	۸۷,۷۷ %	۳۱۳,۶۱۵	۱۲,۶۵۹	۳۰۰,۹۵۵	۰	جم پیلن
۶,۹۶ %	۴۹,۱۶۱	۵,۲۴۳	۳۵,۲۴۶	۸,۶۷۲	۷,۴۴ %	۲۶,۵۸۸	۲,۹۳۳	۲۳,۶۵۵	۰	جم
۰,۲۶ %	۱,۸۴۵	۷۳۷	۱,۱۰۸	۰	۰,۳۲ %	۱,۱۴۲	۱۰۶	۱,۰۳۶	۰	وصندوق
۰,۳۲ %	۲,۲۷۰	۰	۲,۲۷۰	۰	۰,۳۳ %	۱,۱۹۶	۰	۱,۱۹۶	۰	ح. گوهران



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(سرمایه‌گذاری 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 تغییر ارزش	درآمد سود اوراق (میلیون ریال)	
۲۵،۰۹۳	۱۶۱	۲،۰۳۶	۲۶،۹۶۸	۲،۶۸۱	۰	۲۰۸،۲۷۸	۲،۶۸۱	مراجعه سلامت ۶
۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزام ۸
۱۱۹	۲۹	۰	۱۴۸	۰	۰	۰	۰	صکوک رایتل
۷۴۸	۷۴۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزام ۴
۱۶	۱۶	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزام ۲۲
۲،۱۴۳	۲،۱۴۳	۰	۰	۰	۰	۰	۰	اخزام ۱۲



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(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	۰		۰	
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	۰		۱۴۵،۲۹۲	
بانک سامان سی تیر	۸۴۹-۴۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	۰		۰	
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	۰		۰	
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	۱،۶۰۴،۸۷۴،۵۸۷		۹،۶۵۳،۰۱۹،۷۱۱	
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	۰		۰	
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	۰		۰	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(سایر درآمدها)

۱۳۹۹/۰۱/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۴,۴۸۶,۹۸۸	۰	سایر درآمدها
۰	۰	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
۰	۰	تعدیل کارمزد کارگزار
۴,۴۸۶,۹۸۸	۰	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۱/۳۱

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۳۵۲,۷۴۵,۸۶۸,۳۶۹	۹۸,۷۲ %	۲۱,۴۵ %
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲,۶۸۱,۵۱۲,۶۴۶	۰,۷۵ %	۰,۱۶ %
درآمد سپرده بانکی	۱,۶۰۴,۸۷۴,۵۸۷	۰,۴۵ %	۰,۱۰ %

