

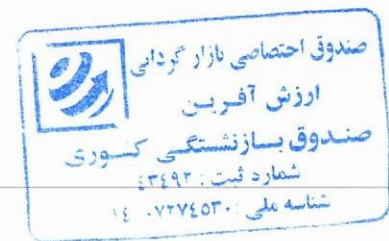
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(سهام)

نام شرکت	۱۳۹۹/۰۱/۳۱			تغییرات طی دوره						۱۳۹۹/۰۲/۳۱		
	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	مبلغ فروش (میلیون ریال)	تعداد	مبلغ فروش (میلیون ریال)					
ملت	۲,۷۲۵,۶۰۵	۲۸,۱۸۰	۳۳,۰۰۶	۱۲,۰۳۰,۴۴۵	۱۸۶,۷۸۳	-۴,۱۰۰,۰۰۰	۶۰,۳۳۸	۱۰,۶۵۶,۰۵۰	۱۵۷,۸۷۹	۱۶۹,۵۷۲	۸,۶۴ %	
جم	۴,۳۸۳,۲۸۴	۵۷,۳۳۵	۱۰۰,۱۰۳	۱,۳۱۵,۷۳۶	۳۷,۳۳۶	-۱,۲۴۰,۲۱۴	۳۵,۸۲۴	۴,۴۵۸,۸۰۶	۷۶,۳۵۵	۱۳۴,۶۰۷	۶,۸۵ %	
جم پیلن	۱۹,۶۸۸,۷۳۷	۵۹۰,۱۲۰	۱,۰۶۹,۳۸۲	۱,۴۱۶,۷۴۰	۹۱,۹۱۳	-۱,۲۶۰,۰۰۰	۸۰,۵۴۷	۱۹,۸۴۵,۴۷۷	۶۱,۵۳۱	۱,۲۱۶,۲۴۰	۶۱,۹۴ %	
ح.س. گوهران	۷۰۶,۴۷۸	۹۵۲	۳,۲۲۲	.	.	.	.	۷۰۶,۴۷۸	۹۵۲	۶,۵۹۹	۰,۳۴ %	
گوهران	۱,۳۱۳,۹۳۳	۵,۴۱۶	۷,۳۰۱	۱,۶۹۷,۱۷۱	۱۴,۴۴۰	-۲,۲۴۰,۰۰۰	۱۷,۴۰۸	۷۷۱,۱۰۴	۶,۸۷۹	۸,۱۳۱	۰,۴۱ %	
وصندوق	۴۴۱,۲۳۷	۲,۵۱۲	۳,۶۲۰	.	.	.	.	۴۴۱,۲۳۷	۱۲,۳۳۶	۵,۴۲۱	۰,۲۸ %	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(تبعی)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱				۱۳۹۹/۰۱/۳۱				نام شرکت
نرخ	تاریخ	قیمت	تعداد اوراق	نرخ	تاریخ	قیمت	تعداد اوراق	
موثر	اعمال	اعمال	تبعی	موثر	اعمال	اعمال	تبعی	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۱/۳۱			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	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	نرخ موثر	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	نام اوراق
					مبلغ فروش (میلیون ریال)	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								
۷,۰۸ %	۱۳۹,۱۱۷	۱۳۸,۶۴۱	۹۴۴,۲۸۳	۱۴۷,۴۳۲	۳۲,۴۰۶	۳۴,۵۰۰	۰	۰	۱۷۰,۸۹۲	۱۷۰,۹۰۳	۱۸۱,۹۳۲	۱۷	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲	۱۳۹۶/۰۹/۲۲	مراجعه سلامت ۶



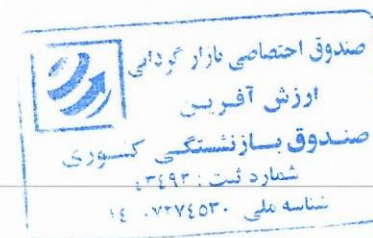
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱						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 پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(گواهی سپرده)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱			تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۱/۳۱			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 فراپورسی	نرخ فروش	نرخ سود	تاریخ سر رسید	سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی
				مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد								



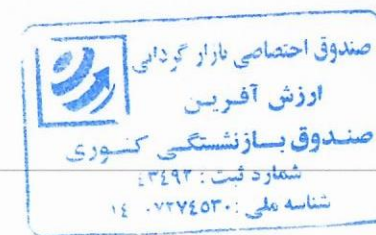
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنوی P

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(سپرده)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱		تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۱/۳۱	مشخصات حساب بانکی				سپرده
درصد به کل دارایی‌ها	مبلغ	کاهش (میلیون ریال)	افزایش (میلیون ریال)	مبلغ	نرخ سود	تاریخ افتتاح	نوع حساب	شماره حساب	
۰,۰۰ %	۵۰۰,۰۰۰	۲۷۱,۳۷۲	۲۷۱,۳۷۲	۵۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	جاری	۱۸۶۹-۶۳-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۸,۰۲ %	۱۵۷,۵۴۱,۵۲۷,۹۲۲	۲۸۹,۲۹۴	۲۰۱,۲۶۴	۲۴۵,۵۷۲,۱۶۷,۱۲۵	۰	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	کوتاه مدت	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	بانک انصار میدان فاطمی
۰,۰۰ %	۲۵,۱۱۸,۷۹۲	۰	۰	۲۵,۱۱۸,۷۹۲	۰	۱۳۹۸/۰۴/۰۵	جاری	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	بانک ملت بورس کالا
۰,۰۰ %	۱۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	کوتاه مدت	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	بانک ملت بورس کالا



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(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
۲۹,۵۵۶,۲۴۴,۸۴۵		۲۹,۵۵۶,۲۴۴,۸۴۵	۲,۵۸۷,۸۸۷,۵۲۹		۲,۵۸۷,۸۸۷,۵۲۹	۱۷	۱۴۰۰/۰۹/۲۲		مراجعه سلامت ۶
۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰		۱۴۸,۳۴۲,۴۲۰	.		.	۲۱	۱۳۹۹/۰۲/۱۴		صکوک رایتل
۱۴۵,۲۹۲	.	۱۴۵,۲۹۲	.	.	.	.		۴	بانک سامان سی تیر
۱۰,۷۲۶,۰۶۵,۳۵۹	.	۱۰,۷۲۶,۰۶۵,۳۵۹	۱۰,۷۳۰,۰۴۵,۶۴۸	.	۱۰,۷۳۰,۰۴۵,۶۴۸	.		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(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
ملت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۱۷,۳۳۱,۷۱۶	۲۵۰	.	.	.	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰	.	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰
جم	۱۳۹۸/۰۴/۱۹	۵,۱۹۲,۸۳۳	۱,۶۷۰	.	.	.	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰	.	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰
گوهران	۱۳۹۸/۱۱/۱۹	۱,۶۳۵,۷۸۱	۴۰۰	.	.	.	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰	.	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰
جم پیلن	۱۳۹۹/۰۲/۲۹	۲۰,۰۴۵,۴۷۷	۵,۵۰۰	۱۱۰,۲۵۰,۱۲۳,۵۰۰	۱۵,۷۳۱,۵۲۰,۸۵۲	۹۴,۵۱۸,۶۰۲,۶۴۸	۱۱۰,۲۵۰,۱۲۳,۵۰۰	۱۵,۷۳۱,۵۲۰,۸۵۲	۹۴,۵۱۸,۶۰۲,۶۴۸



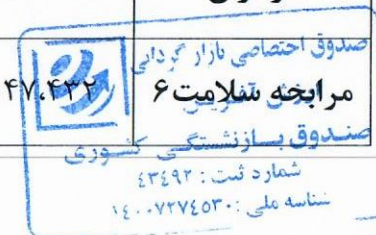
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

نام شرکت	طی ماه			از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				
	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت (میلیون ریال)
ح گوهران	۷۰۶,۴۷۸	۶,۵۹۹	۳,۲۲۲	۳,۳۷۷	۷۰۶,۴۷۸	۶,۵۹۹	۹۵۲	۵,۶۴۶
وصندوق	۴۴۱,۲۳۷	۵,۴۲۱	۳,۶۲۰	۱,۸۰۱	۴۴۱,۲۳۷	۵,۴۲۱	۲,۵۱۲	۲,۹۰۹
ملت	۱۰,۶۵۶,۰۵۰	۱۶۹,۵۷۲	۱۶۲,۷۰۵	۶,۸۶۸	۱۰,۶۵۶,۰۵۰	۱۶۹,۵۷۲	۱۵۷,۸۷۹	۱۱,۶۹۳
جم پیلن	۱۹,۸۴۵,۴۷۷	۱,۲۱۶,۲۴۰	۱,۱۲۲,۱۵۰	۹۴,۰۹۰	۱۹,۸۴۵,۴۷۷	۱,۲۱۶,۲۴۰	۶۴۲,۸۹۲	۵۷۳,۳۴۸
جم	۴,۴۵۸,۸۰۶	۱۳۴,۶۰۷	۱۱۷,۲۴۸	۱۷,۳۵۹	۴,۴۵۸,۸۰۶	۱۳۴,۶۰۷	۸۲,۰۰۲	۵۲,۶۰۵
گوهران	۷۷۱,۱۰۴	۸,۱۳۱	۸,۷۶۲	-۶۳۱	۷۷۱,۱۰۴	۸,۱۳۱	۶,۸۸۰	۱,۲۵۲
سندوق احتیاطی بازار مودایی مراجعه سلامت ۶ مدرسه دانش	۱۴۷,۴۳۲	۱۳۹,۱۱۶	۱۳۷,۹۱۳	۱,۲۰۴	۱۴۷,۴۳۲	۱۳۹,۱۱۶	۱۳۹,۹۴۹	-۸۳۲



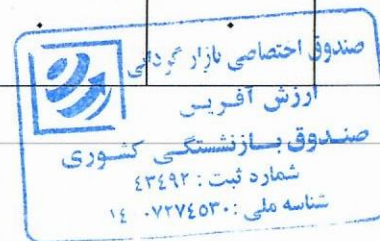
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(درآمد ناشی از فروش)

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری	سود و زیان ناشی از فروش	تعداد	بهای فروش (میلیون ریال)	ارزش دفتری (میلیون ریال)	سود و زیان ناشی از فروش (میلیون ریال)
جم	۱,۲۴۰,۲۱۴	۳۵,۸۲۴	۲۰,۱۹۱	۱۵,۶۳۲	۴,۲۵۰,۰۲۳	۸۳,۵۲۵	۶۲,۶۴۹	۲۰,۸۷۶
جم پیلن	۱,۲۶۰,۰۰۰	۸۰,۵۴۷	۳۹,۱۴۶	۴۱,۴۰۱	۵,۰۴۵,۹۵۹	۲۱۷,۸۷۲	۱۴۸,۸۹۲	۶۸,۹۸۰
گوهران	۲,۲۴۰,۰۰۰	۱۷,۴۰۸	۱۲,۹۷۹	۴,۴۲۹	۲۶,۶۶۶,۸۷۶	۹۰,۹۹۳	۷۱,۷۵۴	۱۹,۲۳۸
ملت	۴,۱۰۰,۰۰۰	۶۰,۳۳۸	۵۷,۰۸۴	۳,۲۵۴	۵۴,۴۵۲,۵۶۱	۳۵۲,۹۵۷	۳۰۱,۵۳۵	۵۱,۴۲۲
وصندوق	.	.	.	.	۱,۶۴۲,۲۰۰	۸,۷۷۱	۸۰,۳۴۰	۷۳۷
مراجعه سلامت ۶	۳۴,۵۰۰	۳۲,۴۰۶	۳۲,۹۷۹	-۵۷۳	۶۷,۱۰۰	۶۲,۸۵۶	۶۳,۲۶۸	-۴۱۲
اخزام ۱۲	.	.	.	.	۱۹,۰۰۰	۱۹,۰۰۰	۱۶,۸۵۷	۲,۱۴۳



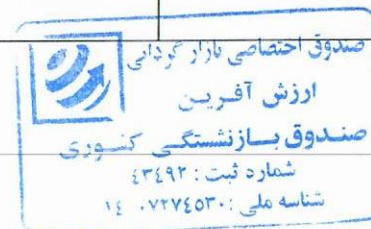
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(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 (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)
جم	۰	۱۷,۳۶۰	۱۵,۶۳۳	۳۲,۹۹۲	۱۰,۸۹ %	۸,۶۷۲	۵۲,۶۰۵	۲۰,۸۷۶
جم پیلن	۹۴,۵۱۸,۶۰۲,۶۴۸	۹۴,۰۹۰	۴۱,۴۰۱	۲۳۰,۰۰۹	۷۵,۹۳ %	۹۴,۵۱۹	۵۷۳,۳۴۸	۶۸,۹۸۰
گوهران	۰	-۶۳۰	۴,۴۲۹	۳,۷۹۸	۱,۲۵ %	۶۵۴	۱,۲۵۲	۱۹,۲۳۸
ملت	۰	۶,۸۶۸	۳,۲۵۴	۱۰,۱۲۱	۳,۳۴ %	۴,۳۳۳	۱۱,۶۹۳	۵۱,۴۲۲
وصندوق	۰	۱,۸۰۱	۰	۱,۸۰۱	۰,۵۹ %	۰	۲,۹۰۹	۷۳۷
ح. گوهران	۰	۳,۳۷۷	۰	۳,۳۷۷	۱,۱۱ %	۰	۵,۶۴۷	۰



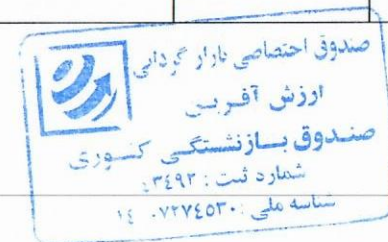
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				توضیحات
جمع	درآمد فروش (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود اوراق (میلیون ریال)	جمع (میلیون ریال)	درآمد فروش (میلیون ریال)	درآمد تغییر ارزش (میلیون ریال)	درآمد سود اوراق (میلیون ریال)	
۲۸,۳۱۲	-۴۱۲	-۸۳۲	۲۹,۵۵۶	۳,۲۱۹	-۵۷۳	۱,۲۰۴	۲,۵۸۸	مراجعه سلامت ۶
۲,۱۴۳	۲,۱۴۳	.	.	.	.	.	.	اخزا م ۱۲
.	.	.	.	.	.	.	.	اخزا م ۸
۱۱۹	-۳۰	.	۱۴۸	.	.	.	.	صکوک اجاره رایتل
۷۴۸	۷۴۸	.	.	.	.	.	.	اخزا م ۴
۱۶	۱۶	.	.	.	.	.	.	اخزا م ۲۲



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(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	۸۴۹-۸۱۰-۲۶۶۲۶۵۱-۱	.		۱۴۵,۲۹۲	
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲-۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	۱,۰۷۳,۰۴۵,۶۴۸		۱۰,۷۲۶,۰۶۵,۳۵۹	



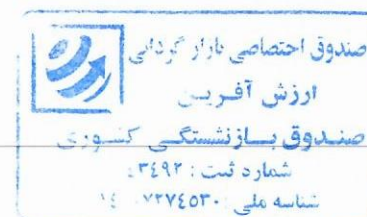
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(سایر درآمدها)

۱۳۹۹/۰۲/۳۱	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 ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۲۸۲,۱۰۰,۰۳۵,۰۵۹	۹۳,۱۳ %	۱۴,۳۷ %
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۳,۲۱۸,۹۴۱,۹۴۲	۱,۰۶ %	۰,۱۶ %
درآمد سپرده بانکی	۱,۰۷۳,۰۴۵,۶۴۸	۰,۳۵ %	۰,۰۵ %

