

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(سهام)

۱۳۹۹/۰۳/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱			نام نماد
درصد به کل دارایی های صندوق	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده	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				
۵,۶۲ %	۱۳۶,۰۶۲	۸۵,۰۹۱	۲۶,۲۷۰	۵,۲۰۰,۱۰۷	۱۵۶,۹۳۵	-۷,۵۲۱,۲۲۹	۴۱,۱۵۷	۲,۰۶۵,۲۸۶	۱۶۹,۵۷۲	۱۵۷,۸۷۹	۱۰,۶۵۶,۰۵۰	ملت
۶,۹۹ %	۱۶۹,۰۳۷	۸۱,۵۲۴	۳۹,۷۵۰	۴,۲۶۹,۵۴۴	۲۵,۲۲۷	-۷۳۰,۷۶۵	۱۸,۳۹۹	۵۴۱,۵۰۳	۱۳۴,۶۰۷	۷۶,۳۵۵	۴,۴۵۸,۸۰۶	جم
۶۲,۰۳ %	۱,۵۰۰,۴۳۲	۶۶۷,۷۵۳	۷۵,۵۵۰	۱۹,۹۳۹,۶۸۱	۳۵,۴۸۰	-۵۳۱,۱۳۷	۴۲,۲۶۱	۶۲۵,۳۴۱	۱,۲۱۶,۲۴۰	۶۴۲,۸۸۸	۱۹,۸۴۵,۴۷۷	جم پیلن
۱,۴۱ %	۳۳,۹۹۰	۲۴,۳۸۷	۱۴,۶۴۶	۲,۳۳۰,۰۹۰	۱۴,۳۳۴	-۱,۲۴۰,۰۰۰	۲۹,۷۶۸	۲,۷۹۸,۹۸۶	۸,۱۳۱	۶,۸۷۹	۷۷۱,۱۰۴	گوهران
۰,۲۶ %	۶,۳۷۳	۲,۳۴۱	۱۵,۵۶۰	۴۱۱,۲۳۷	۴۶۶	-۳۰,۰۰۰	.	.	۵,۴۲۱	۲,۵۱۲	۴۴۱,۲۳۷	وصندوق



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(تبعی)

۱۳۹۹/۰۳/۳۱				۱۳۹۹/۰۲/۳۱				نام شرکت
نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	نرخ موثر	تاریخ اعمال	قیمت اعمال	تعداد اوراق تبعی	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(اوراق مشارکت)

۱۳۹۹/۰۳/۳۱					تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۲/۳۱			اطلاعات اوراق بهادار با درآمد ثابت			
درصد به کل دارایی‌های صندوق	خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده	قیمت بازار هر ورقه	تعداد	فروش طی دوره		خرید طی دوره		خالص ارزش فروش (میلیون ریال)	بهای تمام شده (میلیون ریال)	تعداد	نرخ سود	تاریخ سر رسید	تاریخ انتشار	نام اوراق
					مبلغ فروش	تعداد	بهای تمام شده	تعداد							
۵,۷۵ %	۱۳۹,۱۱۷	۰	۹۴۴,۲۸۳	۱۴۷,۴۳۲	۰	۰	۰	۰	۱۳۹,۱۱۷	۱۳۸,۶۴۲	۱۴۷,۴۳۲	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 ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(تعدیل قیمت)

۱۳۹۹/۰۳/۳۱						نام شرکت
تعداد	قیمت پایانی	مبلغ پس از تعدیل	درصد تعدیل	ارزش ناشی از تعدیل قیمت	دلایل	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(گواهی سپرده)

اطلاعات اوراق گواهی سپرده				۱۳۹۹/۰۲/۳۱				تغییرات طی دوره				۱۳۹۹/۰۳/۳۱			
سرمایه گذاری در اوراق گواهی سپرده بانکی	تاریخ سر رسید	نرخ سود	نرخ فروش	بورسی یا فراپورسی	تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	خرید طی دوره		فروش طی دوره		تعداد	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها
								تعداد	بهای تمام شده	تعداد	مبلغ فروش				



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتنفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(سپرده)

سپرده	مشخصات حساب بانکی				تغییرات طی دوره		۱۳۹۹/۰۳/۳۱	
	شماره حساب	نوع حساب	تاریخ افتتاح	نرخ سود	مبلغ	افزایش (میلیون ریال)	کاهش (میلیون ریال)	مبلغ
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۶۳- ۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	حساب جاری	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۵۰۰,۰۰۰	۱۰۶,۶۵۲	۱۰۶,۶۵۳	۵۰۰,۰۰۰
بانک انصار میدان فاطمی	۱۸۶۹-۸۲۲- ۱۲۳۱۸۹۱۸-۱	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۶/۱۱/۲۸	۰	۱۵۷,۵۴۱,۵۲۷,۹۲۲	۲۹۷,۰۵۴	۴۵۴,۵۹۶	۳۰۶,۹۴۳,۱۸۴,۶۱۹
بانک ملت بورس کالا	۸۶۵۱۴۱۴۹-۸۹	حساب جاری	۱۳۹۸/۰۴/۰۵	۰	۲۵,۱۱۸,۷۹۲	۰	۰	۲۵,۱۱۸,۷۹۲
بانک ملت بورس کالا	۸۶۸۸۳۲۰۲۹۰	سپرده کوتاه مدت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۰	۱۰۰,۰۰۰	۰	۰	۱۰۰,۰۰۰
								درصد به کل دارایی‌ها
								۰,۰۰ %
								۱۲,۶۹ %
								۰,۰۰ %
								۰,۰۰ %



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(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 سر رسید	روز دریافت سود	توضیحات
۳۱,۶۵۶,۵۲۴,۸۵۳		۳۱,۶۵۶,۵۲۴,۸۵۳	۲,۱۰۰,۲۸۰,۰۰۸		۲,۱۰۰,۲۸۰,۰۰۸	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
۱۱,۸۰۱,۹۸۴,۱۱۱	.	۱۱,۸۰۱,۹۸۴,۱۱۱	۱,۰۷۵,۹۱۸,۷۵۲	.	۱,۰۷۵,۹۱۸,۷۵۲	.		۲۸	بانک انصار میدان فاطمی



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(درآمد سود سهام)

نام نماد	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
ملت	۱۳۹۸/۰۴/۲۵	۱۷,۳۳۱,۷۱۶	۲۵۰	.	.	.	۴,۳۳۲,۹۲۹,۰۰۰	.
جم	۱۳۹۸/۰۴/۱۹	۵,۱۹۲,۸۳۳	۱,۶۷۰	.	.	.	۸,۶۷۲,۰۳۱,۱۱۰	.
گوهران	۱۳۹۸/۱۱/۱۹	۱,۶۳۵,۷۸۱	۴۰۰	.	.	.	۶۵۴,۳۱۲,۴۰۰	.
جم پیلن	۱۳۹۹/۰۲/۲۹	۲۰,۰۴۵,۴۷۷	۵۵۰۰	.	.	.	۱۱۰,۲۵۰,۱۲۳,۵۰۰	۱۳,۹۷۹,۰۸۲,۶۴۵
							۹۶,۲۷۱,۰۴۰,۸۵۵	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(درآمد ناشی از تغییر قیمت اوراق)

نام نماد	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)	سود و زیان ناشی از تغییر قیمت
وصندوق	۴۱۱,۲۳۷	۶,۳۷۳	۵,۲۵۶	۱,۱۲۳	۴۱۱,۲۳۷	۶,۳۷۳	۲,۳۴۱	۴,۰۳۲
ملت	۵,۲۰۰,۱۰۷	۱۳۶,۰۶۲	۹۶,۷۸۴	۳۹,۲۷۷	۵,۲۰۰,۱۰۷	۱۳۶,۰۶۲	۸۵,۰۹۱	۵۰,۹۷۱
جم پیلن	۱۹,۹۳۹,۶۸۱	۱,۵۰۰,۴۳۲	۱,۲۴۱,۱۰۵	۲۵۹,۳۲۷	۱۹,۹۳۹,۶۸۱	۱,۵۰۰,۴۳۲	۶۶۷,۷۵۷	۸۳۲,۶۷۶
جم	۴,۲۶۹,۵۴۴	۱۶۹,۰۳۷	۱۳۸,۹۰۵	۳۰,۱۳۲	۴,۲۶۹,۵۴۴	۱۶۹,۰۳۷	۸۶,۳۰۰	۸۲,۷۳۷
گوهران	۲,۳۳۰,۰۹۰	۳۳,۹۹۰	۲۵,۶۳۹	۸,۳۵۲	۲,۳۳۰,۰۹۰	۳۳,۹۹۰	۲۴,۳۸۷	۹,۶۰۳
مراجعه سلامت ۶	.	.	.	.	۱۴۷,۴۳۲	۱۳۹,۱۱۷	۱۳۹,۹۴۹	-۸۳۲,۲۳۱,۰۶۷



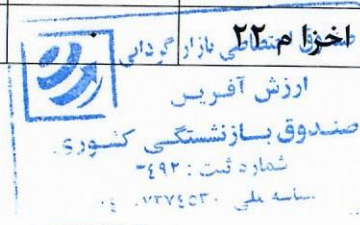
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(درآمد ناشی از فروش)

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه			
	تعداد	بهای فروش (م.ریال)	ارزش دفتری (م.ریال)	سود و زیان ناشی از فروش (م.ریال)	تعداد	بهای فروش (م.ریال)	ارزش دفتری (م.ریال)	سود و زیان ناشی از فروش (م.ریال)
ح. گوهران	۷۰۶,۴۷۸	۵,۰۰۲	۹۵۲	۴,۰۵۰	۷۰۶,۴۷۸	۵,۰۰۲	۹۵۲	۴,۰۵۰
جم پیلن	۵۳۱,۱۳۷	۳۵,۴۸۰	۱۷,۳۹۶	۱۸,۰۸۴	۵,۵۷۷,۰۹۶	۲۵۳,۳۵۲	۱۶۶,۲۸۷	۸۷,۰۶۵
جم	۷۳۰,۷۶۵	۲۵,۲۲۷	۱۴,۱۰۱	۱۱,۱۲۶	۴,۹۸۰,۷۸۸	۱۰۸,۷۵۲	۷۶,۷۵۰	۳۲,۰۰۲
گوهران	۱,۲۴۰,۰۰۰	۱۴,۳۳۴	۱۲,۲۶۰	۲,۰۷۴	۲۷,۹۰۶,۸۷۶	۱۰۵,۳۲۷	۸۴,۰۱۵	۲۱,۳۱۲
وصندوق	۳۰,۰۰۰	۴۶۶	۱۷۱	۲۹۵	۱,۶۷۲,۲۰۰	۹,۲۳۷	۸,۲۰۵	۱,۰۳۲
ملت	۷,۵۲۱,۲۲۹	۱۵۶,۹۳۴	۱۱۳,۹۴۵	۴۲,۹۹۰	۶۱,۹۷۳,۷۹۰	۵۰۹,۸۹۲	۴۱۵,۴۸۰	۹۴,۴۱۳
اخزام ۸	.	.	.	.	۶۰	۶۰	۶۰	.
مراجعه سلامت ۶	.	.	.	.	۶۷,۱۰۰	۶۲,۸۵۶	۶۳,۲۶۸	-۴۱۲
اخزام ۱۲	.	.	.	.	۱۹,۰۰۰	۱۹,۰۰۰	۱۶,۸۵۷	۲,۱۴۳
صکوک رایتل	.	.	.	.	۱۰,۳۰۹	۱۰,۴۱۶	۱۰,۴۴۵	-۲۹
اخزام ۴	.	.	.	.	۱۰,۰۳۴	۱۰,۰۳۴	۹,۲۸۶	۷۴۸
اخزام ۲۲	.	.	.	.	۵۲۷	۵۲۷	۵۱۱	۱۶



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(سرمایه‌گذاری در سهام)

نام شرکت	طی ماه				از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				
	درآمد سود سهام	درآمد تغییر ارزش (م.ریال)	درآمد فروش (م.ریال)	مبلغ (م.ریال)	درصد از کل درآمدها	درآمد سود سهام (م.ریال)	درآمد تغییر ارزش	درآمد فروش	مبلغ
ح. گوه‌ران	.	-۵,۶۴۷	۴,۰۵۰	-۱,۵۹۷	-۰,۳۸ %	.	.	۴,۰۵۰	۴,۰۵۰
جم پیلن	.	۲۵۹,۳۲۷	۱۸۰,۰۸۴	۲۷۷,۴۱۲	۶۶,۸۰ %	۹۶,۲۷۱	۸۳۲,۶۷۶	۸۷,۰۶۵	۱,۰۱۶,۰۱۱
جم	.	۳۰,۱۳۲	۱۱,۱۲۶	۴۱,۲۵۸	۹,۹۳ %	۸,۶۷۲	۸۲,۷۳۷	۳۲,۰۰۲	۱۲۳,۴۱۱
گوه‌ران	.	۸,۳۵۲	۲,۰۷۴	۱۰,۴۲۶	۲,۵۱ %	۶۵۴	۹,۶۰۳	۲۱,۳۱۲	۳۱,۵۷۰
وصندوق	.	۱,۱۲۳	۲۹۵	۱,۴۱۷	۰,۳۴ %	.	۴,۰۳۲	۱,۰۳۲	۵,۰۶۴
ملت	.	۳۹,۲۷۷	۴۲,۹۹۰	۸۲,۲۶۷	۱۹,۸۱ %	۴,۳۳۳	۵۰,۹۷۱	۹۴,۴۱۳	۱۴۹,۷۱۶
وملی	.	.	.	.	۰,۰۰ %	.	-۱۹	۳۱,۲۴۲	۳۱,۲۴۳



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتهوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(سرمایه گذاری در اوراق بهادار)

از ابتدای سال مالی تا پایان ماه				طی ماه				توضیحات
جمع	درآمد فروش (م.ریال)	درآمد تغییر ارزش (م.ریال)	درآمد سود اوراق (م.ریال)	جمع (م.ریال)	درآمد فروش	درآمد تغییر ارزش	درآمد سود اوراق (م.ریال)	
۴۶۷,۵۷۳	.	.	.	.	.	.	.	اخزا ۶
۳۰,۴۱۲,۲۱۶,۶۴۹	-۴۱۲	-۸۳۲	۷۳۱,۶۵	۲,۱۰۰	.	.	۲,۱۰۰	مراجعه سلامت ۶



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورته‌فوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(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	۱.۰۷۵.۹۱۸.۷۵۲		۱۱.۸۰۱.۹۸۴.۱۱۱	



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(سایر درآمدها)

۱۳۹۹/۰۳/۳۱	طی ماه	سایر درآمدها
مبلغ	مبلغ	
۴,۴۸۶,۹۸۸	.	سایر درآمدها
.	.	معین برای سایر درآمدهای تنزیل سود بانک
.	.	تعدیل کارمزد کارگزار



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشتگی کشوری

صورت وضعیت پورتفوی

برای ماه منتهی به ۱۳۹۹/۰۳/۳۱

(جمع درآمدها)

توضیحات	مبلغ	درصد از کل درآمدها	درصد به کل دارایی‌های صندوق
سرمایه‌گذاری در سهام	۴۱۱,۱۸۳,۴۸۸,۹۷۲	۹۹,۰۱ %	۱۷,۰۰ %
سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار	۲,۱۰۰,۲۸۰,۰۰۸	۰,۵۱ %	۰,۰۹ %
درآمد سپرده بانکی	۱,۰۷۵,۹۱۸,۷۵۲	۰,۲۶ %	۰,۰۴ %

