

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت‌های مالی و یادداشت‌های توضیحی

برای دوره سه ماه و چهار روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹



صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهرماه ۱۳۹۹

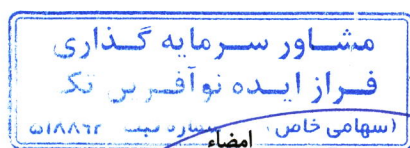
با سلام

به پیوست صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری مربوط به دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰ که در اجرای تبصره ۳ ماده ۵۷ اساسنامه صندوق بر اساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده به شرح زیر تقدیم می گردد.

شماره صفحه	
۲	صورت خالص دارایی ها
۳	صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها
	یادداشت های توضیحی:
۴ و ۵	الف. اطلاعات کلی صندوق
۵	ب. مبنای تهیه صورتهای مالی
۵ الی ۷	پ. خلاصه اهم رویه های حسابداری
۸ الی ۲۱	ت. یادداشت های مربوط به اقلام مندرج در صورتهای مالی و سایر اطلاعات مالی

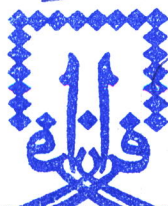
این صورت های مالی در چارچوب استانداردهای حسابداری و با توجه به قوانین و مقررات سازمان بورس و اوراق بهادار در رابطه با صندوق سرمایه گذاری تهیه گردیده است. مدیریت صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری بر این باور است که این صورت های مالی برای ارائه تصویری روشن و منصفانه از وضعیت عملکرد مالی صندوق، در برگیرنده همه اطلاعات مربوط به صندوق، هماهنگ با واقعیت های موجود و اثرات آنها در آینده که به صورت معقول در موقعیت کنونی می توان پیش بینی نموده می باشد و به نحوه درست و به گونه کافی در این صورت های مالی افشاء گردیده اند.

با سپاس



صورت های مالی حاضر در تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۲۵ به تایید ارکان زیر در صندوق رسیده است.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده
مدیر صندوق	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	مهدی فرازمنند
متولی صندوق	موسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور	سعید خاوریبند



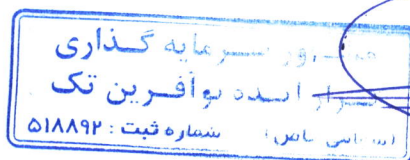
صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت خالص دارایی ها

در تاریخ ۳۰ مهرماه ۱۳۹۹

دارایی ها:	یادداشت	۱۳۹۹/۰۷/۳۰
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام	۵	ریال ۲,۸۶۳,۹۰۶,۶۲۷,۷۶۹
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۶	۱,۲۰۹,۲۴۱,۹۸۸,۱۸۲
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۷	۲۰۸,۱۰۳,۳۲۹,۶۰۴
حساب های دریافتی	۸	۱,۸۸۱,۷۱۸,۵۲۱
سایر دارایی ها	۹	۶۳۷,۹۱۸,۰۶۰
موجودی نقد	۱۰	۸۵۴,۳۱۰,۶۵۴
جمع دارایی ها		۴,۲۸۴,۶۲۵,۸۹۲,۷۹۰
بدهی ها:		
جاری کارگزاران	۱۱	۱,۷۰۸,۳۱۰,۴۷۷
پرداختی به ارکان صندوق	۱۲	۲,۳۰۴,۱۳۰,۲۲۵
سایر حساب های پرداختی و ذخایر	۱۳	۱,۰۱۵,۴۶۲,۳۶۸
جمع بدهی ها		۵,۰۲۷,۹۰۳,۰۷۰
خالص دارایی ها	۱۴	۴,۲۷۹,۵۹۷,۹۸۹,۷۲۰
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری - ریال		۱۰,۶۹۹

یادداشت های توضیحی ، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی می باشد.



صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها

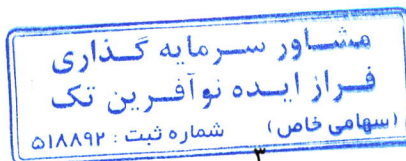
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

درآمدها:	یادداشت	دوره مالی ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰
		ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۵	۲۳۵,۸۴۶,۹۵۱,۵۶۷
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۶	۳۵,۲۵۲,۴۰۸,۴۸۸
سود سهام	۱۷	۴۰۷,۷۰۱,۳۵۲
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۸	۹,۶۵۵,۰۷۹,۶۰۴
سایر درآمدها	۱۹	۱,۱۳۵,۷۵۱,۲۴۲
جمع درآمدها		۲۸۲,۲۹۷,۸۹۲,۲۵۳
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۰	(۲,۳۰۲,۱۴۰,۲۲۵)
سایر هزینه ها	۲۱	(۳۹۷,۷۶۲,۳۰۸)
جمع هزینه ها		(۲,۶۹۹,۹۰۲,۵۳۳)
سود (زیان) خالص		۲۷۹,۵۹۷,۹۸۹,۷۲۰
بازده میانگین سرمایه گذاری		۸.۰۰٪
بازده سرمایه گذاری در پایان دوره		۶.۵۳٪

صورت گردش خالص دارایی ها		
دوره مالی ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰		
تعداد واحدهای	ریال	
سرمایه گذاری		
۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره
-	۲۷۹,۵۹۷,۹۸۹,۷۲۰	سود (زیان) خالص
۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۲۷۹,۵۹۷,۹۸۹,۷۲۰	خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) در پایان دوره

یادداشت های توضیحی ، بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی می باشد.

بازده میانگین سرمایه گذاری =	سود خالص
	میانگین موزون (ریال) وجوه استفاده شده
بازده سرمایه گذاری پایان دوره =	تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال $\pm$ سود (زیان) خالص
	خالص دارایی های پایان دوره



(Handwritten signature)

۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری که صندوقی با سرمایه باز محسوب می‌شود در تاریخ ۱۳۹۹/۰۵/۰۱ تحت شماره ۱۱۷۳۶ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده‌است و همچنین در تاریخ ۱۳۹۹/۰۴/۲۸ نزد اداره ثبت شرکت‌های تهران به شناسه ملی ۱۴۰۰۹۲۹۵۴۶۷ و با شماره ۵۰۰۴۱ به ثبت رسیده‌است. هدف از تشکیل این صندوق جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف صندوق در اوراق بهادار (سهام با درجه ریسک متفاوت، اوراق مشارکت، گواهی سپرده‌های بانکی و...) سرمایه‌گذاری می‌نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه نامحدود است.

شایان ذکر است با توجه به اینکه فعالیت صندوق طبق مجوز اخذشده از سازمان محترم بورس و اوراق بهادار از تاریخ ۱۳۹۹/۰۶/۰۲ آغاز گردیده، لذا صورت خالص دارایی‌ها، صورت سود (زیان) و گردش خالص دارایی‌ها فاقد اقلام مقایسه‌ای است. مرکز اصلی صندوق در از استان تهران - منطقه ۱۴، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، محله شهرک قدس (غرب) - درختی، بلوار شهید برادران نورانی (پارک)، خیابان شهید محمود فخار مقدم، پلاک ۲۴، طبقه دوم واقع شده‌است.

۲-۱- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری مطابق با ماده ۵۶ اساسنامه در تارنمای صندوق به تارنمای modirfund.ir درج گردیده‌است.

۲-۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده‌است: مجمع صندوق از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند از حق رأی در مجمع برخوردارند. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده‌اند شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای ممتاز
۱	گروه مدیریت ارزش سرمایه صندوق بازنشتگی کشوری	۵.۰۰۰.۰۰۰	۵۰
۲	شرکت خدمات مدیریت صندوق بازنشتگی کشوری	۳.۰۰۰.۰۰۰	۳۰
۳	کارگزاری صباجهاد	۱.۰۰۰.۰۰۰	۱۰
۴	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک	۱.۰۰۰.۰۰۰	۱۰

مدیر صندوق، شرکت مشاور سرمایه‌گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک) است که در تاریخ ۱۳۹۶/۰۸/۲۹ با شماره ثبت ۵۱۸۸۹۲ در اداره ثبت شرکت‌ها و مالکیت صنعتی تهران به ثبت رسیده‌است. نشانی مدیر عبارت‌است از: تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، محله شهرک قدس (غرب) - درختی، بلوار شهید برادران نورانی (پارک)، خیابان شهید محمود فخار مقدم، پلاک ۲۴، طبقه سوم

متولی صندوق، موسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ به شماره ثبت ۳۴۹۱ در اداره ثبت شرکت ها و مالکیت صنعتی تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان نلسون ماندلا، مجتمع اداری الهیه، طبقه ششم، واحد ۶۰۷.

بازارگردان صندوق، صندوق اختصاصی بازارگردانی صندوق ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری است که در تاریخ ۱۳۹۶/۰۹/۲۲ با شماره ثبت ۴۳۴۹۲ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی بازارگردان عبارت است از: تهران، دانشگاه تهران، خیابان فریمان، خیابان بزرگمهر، پلاک ۳۸، طبقه همکف

حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۷۵/۰۳/۲۸ به شماره ثبت ۸۹۷۷ در اداره ثبت شرکت ها و مالکیت صنعتی تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران، سهروردی شمالی، خیابان خرمشهر، خیابان شهید عربعلی، پلاک ۱، واحد ۶

۳- مبنای تهیه صورت های مالی:

صورت های مالی صندوق اساساً بر مبنای ارزش های جاری تهیه شده است.

۴- خلاصه اهم رویه های حسابداری

۴-۱- سرمایه گذاری ها

سرمایه گذاری در اوراق بهادار شامل سهام و سایر انواع اوراق بهادار در هنگام تحصیل به بهای تمام شده ثبت و در اندازه گیری های بعدی به خالص ارزش فروش طبق دستورالعمل «نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری» مصوب ۱۳۸۶/۱۱/۳۰ هیات مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار اندازه گیری می شود.

۴-۱-۱- سرمایه گذاری در سهام شرکت های بورسی یا فرابورسی: سرمایه گذاری در سهام شرکت های بورسی یا فرابورسی به خالص ارزش فروش منعکس می شود. خالص ارزش فروش سهام عبارت است از ارزش بازار سهم در پایان روز یا قیمت تعدیل شده سهم، منهای کارمزد معاملات و مالیات فروش سهام. با توجه به دستورالعمل «نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های سرمایه گذاری» مدیر صندوق می تواند در صورت وجود شواهد و ارائه مستندات کافی ارزش سهم در پایان هر روز را به میزان حداکثر ۲۰ درصد افزایش یا کاهش دهد و قیمت تعدیل شده را مبنای محاسبه خالص ارزش فروش قرار دهد.

۴-۱-۲- سرمایه گذاری در اوراق مشارکت پذیرفته شده در بورس یا فرابورس: خالص ارزش فروش اوراق مشارکت در هر روز با کسر کارمزد فروش از قیمت بازار آنها محاسبه می گردد.

۴-۱-۳- سرمایه گذاری در اوراق مشارکت و گواهی سپرده بانکی غیربورسی یا غیرفرابورسی: خالص ارزش فروش مشارکت غیربورسی در هر روز مطابق سازوکار بازخرید آنها توسط ضامن تعیین می شود.

۴-۲- درآمد حاصل از سرمایه گذاری ها

۴-۲-۱- سود سهام: درآمد حاصل از سود سهام شرکت ها در زمان تصویب سود توسط مجمع عمومی صاحبان سهام شرکت های سرمایه پذیر شناسایی می شود. همچنین سود سهام متعلق به صندوق سرمایه گذاری به ارزش فعلی محاسبه و در حساب ها منعکس می گردد. برای محاسبه

یادداشت‌های توضیحی همراه صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۳۹۹

ارزش فعلی سود سهام تحقق یافته و دریافت نشده، مبلغ سود دریافتنی باتوجه به برنامه زمان بندی پرداخت سود توسط شرکت سرمایه پذیر و حداکثر ظرف ۸ ماه با استفاده از نرخ سود علی الحساب سالانه آخرین اوراق مشارکت دولتی به علاوه ۵ درصد تنزیل می شود. تفاوت بین ارزش تنزیل شده و ارزش اسمی با گذشت زمان به حساب سایر درآمدها منظور می شود.

۴-۲-۲- سود سپرده بانکی و اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب: سود تضمین شده اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب و گواهی های سپرده بانکی براساس مدت زمان و با توجه به مانده اصل سرمایه گذاری شناسایی می شود. همچنین سود سپرده بانکی به طور روزانه با توجه به کمترین مانده وجوه در حساب سپرده و نرخ سود علی الحساب محاسبه می گردد. مبلغ محاسبه شده سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب، سپرده و گواهی های سپرده بانکی با استفاده از نرخ سود همان اوراق و با در نظر گرفتن مدت باقی مانده تا دریافت سود با همان نرخ قبلی، تنزیل شده و در حساب های صندوق سرمایه گذاری منعکس می شود.

۴-۳- محاسبه کارمزد ارکان و تصفیه

کارمزد ارکان و تصفیه صندوق سرمایه گذاری به صورت روزانه به شرح جدول زیر محاسبه و در حساب ها ثبت می شود:

عنوان هزینه	شرح نحوه محاسبه هزینه
هزینه های تأسیس	معادل پنج دهم درصد (۰.۰۰۵) از وجوه جذب شده در پذیره نویسی اولیه حداکثر تا مبلغ ۵۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت به تصویب مجمع صندوق.
هزینه های برگزاری مجامع صندوق	حداکثر تا مبلغ ۴۰ میلیون ریال برای برگزاری مجامع در طول یک سال مالی با ارائه مدارک مثبت به تصویب مجمع صندوق.
کارمزد مدیر	سالانه نیم درصد از متوسط روزانه ارزش سهام و حق تقدم سهام تحت تملک صندوق به علاوه سه دهم درصد (۰.۰۰۳) از متوسط روزانه اوراق بهادار با درآمد ثابت تحت تملک صندوق و سالانه نیم درصد (۰.۰۰۵) سود حاصل از گواهی سپرده بانکی و سپرده بانکی و تا میزان نصاب مجاز سرمایه گذاری در آن ها به علاوه ۵ درصد از درآمد حاصل از تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار.
کارمزد متولی	سالانه یک دهم درصد (۰.۰۰۱) از متوسط روزانه ارزش خالص دارایی های صندوق که حداقل ۱۰۰ میلیون ریال و حداکثر ۲۵۰ میلیون ریال خواهد بود.
کارمزد بازارگردان	سالانه ۰.۱ درصد متوسط روزانه ارزش سهام و حق تقدم سهام تحت تملک صندوق.
حق الزحمه حسابرس	سالانه مبلغ ثابت ۱۵۰ میلیون ریال به ازای هر سال مالی
حق الزحمه و کارمزد تصفیه صندوق	معادل یک دهم درصد ارزش خالص روز دارایی های صندوق در آغاز دوره اولیه تصفیه است.

صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت های توضیحی همراه صورت های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ماه ۱۳۹۹

حق پذیرش و عضویت در کانون ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانون های مذکور مشروط بر اینکه عضویت در این کانون ها طبق مقررات اجباری باشد.
هزینه سپرده گذاری واحدهای سرمایه گذاری صندوق	مطابق با قوانین و مقررات شرکت سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه.
هزینه های دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی آنها	هزینه ی دسترسی به نرم افزار صندوق، نصب و راه اندازی تارنمای آن و هزینه پشتیبانی آن ها سالانه تا سقف ۷۰۰ میلیون ریال با ارائه مدارک مثبت و با تصویب مجمع صندوق.

۴-۴- بدهی به ارکان صندوق

با توجه به تبصره ۳ ماده ۵۵ اساسنامه کارمزد مدیر ، متولی و بازارگردان صندوق هر ۳ ماه یکبار تا سقف ۹۰ درصد قابل پرداخت است و باقیمانده در پایان هر سال پرداخت می شود.

۴-۵- مخارج تأمین مالی

سود و کارمزد تسهیلات دریافتی از بانک ها، مؤسسات مالی و اعتباری و خرید اقساطی سهام، مخارج تأمین مالی را در بر می گیرد و در دوره وقوع به عنوان هزینه شناسایی می شود.

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۵- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

۵-۱- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس به تفکیک صنعت به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰

صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
	ریال	ریال	درصد
سرمایه گذاریها	۶۸۷,۰۶۶,۲۳۷,۷۴۱	۸۲۷,۰۳۴,۱۹۲,۲۲۵	۱۹.۳۰٪
محصولات شیمیایی	۷۷۱,۴۸۷,۱۴۵,۸۲۱	۷۱۵,۷۹۴,۵۱۷,۲۵۵	۱۶.۷۱٪
انبوه سازی املاک و مستغلات	۲۰۴,۹۴۰,۰۰۷,۹۶۰	۳۵۷,۰۵۲,۸۱۹,۵۰۰	۸.۳۳٪
فلزات اساسی	۳۹۹,۳۲۵,۱۰۴,۳۰۲	۳۲۰,۰۸۱,۵۱۵,۴۷۰	۷.۴۷٪
بانکها و موسسات اعتباری	۲۱۳,۲۹۸,۲۹۷,۷۸۳	۱۸۳,۴۰۲,۲۲۵,۰۰۰	۴.۲۸٪
استخراج و کانه های فلزی	۲۰۵,۰۳۲,۷۲۲,۴۰۸	۱۸۰,۴۸۲,۷۰۰,۱۵۰	۴.۲۱٪
شرکت های چند رشته ای صنعتی	۱۵۳,۳۶۲,۳۷۴,۶۸۷	۱۱۹,۸۰۸,۳۵۳,۳۹۴	۲.۸۰٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۰۰,۸۹۴,۵۶۳,۳۱۷	۸۱,۴۲۲,۹۴۵,۷۸۲	۱.۹۰٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۵۰,۵۶۶,۸۸۱,۹۷۳	۳۷,۳۵۱,۷۱۹,۱۵۱	۰.۸۷٪
بیمه و صندوق بازنشتگی به جزء تامین اجتماعی	۳۶,۹۸۷,۸۰۰,۲۶۰	۳۵,۳۴۶,۸۲۷,۵۲۰	۰.۸۲٪
مواد و محصولات دارویی	۶,۷۳۷,۱۰۵,۰۸۵	۶,۱۲۸,۸۱۲,۳۲۲	۰.۱۴٪
جمع	۲,۸۲۹,۶۹۸,۲۴۱,۳۳۷	۲,۸۶۳,۹۰۶,۶۲۷,۷۶۹	۶۶.۸۴٪

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۶- سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی

یادداشت	۱۳۹۹/۰۷/۳۰
ریال	
۶-۱	۵۲۷,۱۲۷,۳۳۴,۱۰۹
۶-۲	۶۸۲,۱۱۴,۷۵۴,۰۷۳
	<u>۱,۲۰۹,۲۴۱,۹۸۸,۱۸۲</u>

سپردههای بانکی
گواهی سپرده بانکی

۶-۱- سپردههای بانکی کوتاه مدت و بلند مدت به شرح زیر می‌باشد:

نوع سپرده	تاریخ سپرده گذاری	تاریخ سررسید	نرخ سود	مبلغ-ریال	درصد از کل دارایی ها
کوتاه مدت			۰	۱,۵۲۵,۴۸۵,۱۶۳	۰.۰۴٪
بلند مدت	۱۳۹۹/۰۶/۲۹	۱۴۰۱/۰۶/۲۹	۱۸	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲.۳۳٪
کوتاه مدت				۹۰۵,۰۰۰	۰.۰۰٪
بلند مدت	۱۳۹۹/۰۷/۰۱	۱۴۰۱/۰۷/۰۱	۱۸	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲.۳۳٪
کوتاه مدت			۰	۳۲۵,۵۹۹,۸۴۲,۹۴۶	۷.۶۰٪
کوتاه مدت			۰	۱,۰۰۰,۰۰۰	۰.۰۰٪
				<u>۵۲۷,۱۲۷,۳۳۴,۱۰۹</u>	<u>۱۲.۳۰٪</u>

آینده - ۲۰۲۵۸۵۲۵۴۰۰۶
آینده - ۴۰۱۵۰۷۰۰۹۰۰۷
شهر - ۷۰۰۸۴۶۰۶۷۳۱۵
شهر - ۷۰۰۸۴۶۱۳۳۹۸۵
پاسارگاد - ۲۳۹۸۱۰۰۰۱۴۳۰۱۷۵۷۰۱
صادرات - ۰۲۱۶۳۲۰۸۰۴۰۰۰
جمع

۶-۲- گواهی سپردههای بانکی به شرح زیر می‌باشد:

تاریخ سررسید	نرخ سود	مبلغ اسمی	سود متعلقه	ذخیره برگشت سود	خالص ارزش فروش	درصد از کل دارایی ها
	درصد	ریال	ریال	ریال	ریال	درصد
۱۴۰۰/۰۷/۰۷	۱۶	۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۰۰۵,۴۶۴,۴۵۸	۰	۱۰۱,۰۰۵,۴۶۴,۴۵۸	۲.۳۶٪
۱۴۰۱/۰۷/۲۳	۱۸	۵۸۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۹۹۶,۷۲۱,۳۰۷	(۸۸۷,۳۳۱,۶۹۲)	۵۸۱,۰۰۹,۲۸۹,۶۱۵	۱۳.۵۶٪
جمع		<u>۶۸۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰</u>	<u>۳,۰۰۲,۱۸۵,۷۶۵</u>	<u>(۸۸۷,۳۳۱,۶۹۲)</u>	<u>۶۸۲,۱۱۴,۷۵۴,۰۷۳</u>	<u>۱۵.۹۳٪</u>

اوراق گواهی سپرده بانکی بانک صادرات
اوراق گواهی سپرده بانکی بانک آینده

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۷- سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب سرمایه گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب به تفکیک به شرح زیر است:

یادداشت	۱۳۹۹/۰۷/۳۰
ریال	
اوراق مشارکت بورسی و فرابورسی	۷-۱ ۱۵۸,۵۱۳,۵۴۸,۶۲۳
اوراق مباحه	۷-۲ ۴۹,۵۸۹,۷۸۰,۹۸۲
	۲۰۸,۱۰۳,۳۲۹,۶۰۴

۷-۱- سرمایه گذاری در اوراق مشارکت بورسی و فرابورسی به شرح زیر است:

(ریال) ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

درصد از کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	سود متعلقه	کارمزد فروش	ارزش بازار	ارزش اسمی	نرخ سود	تاریخ سررسید	
۰.۱۱٪	۴,۲۴۴,۷۲۵,۲۶۰	.	۸۷۴,۶۴۰	۴,۲۵۶,۰۰۰,۰۰۰	۶,۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۱/۰۲/۱۹	اسناد خزانه م-۱۳ بودجه ۹۸-۹۹ ۰.۱۰۲۱۹
۰.۰۳٪	۹۷۱,۸۱۳,۰۲۶	.	۱۷۶,۱۷۳	۹۷۱,۹۸۹,۲۰۰	۱,۰۸۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۴/۰۷	اسناد خزانه م-۱۶ بودجه ۹۷-۹۸ ۰.۰۰۴۰۷
۰.۰۷٪	۲,۸۱۲,۵۷۶,۳۷۸	.	۵۰۹,۸۷۲	۲,۸۱۳,۰۸۶,۲۵۰	۳,۳۱۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۷/۲۸	اسناد خزانه م-۲۱ بودجه ۹۷-۹۸ ۰.۰۰۷۲۸
۰.۰۹٪	۳,۸۰۴,۴۴۹,۱۱۸	.	۶۸۹,۶۸۱	۳,۸۰۵,۱۳۸,۸۰۰	۴,۳۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۴/۲۱	اسناد خزانه م-۴ بودجه ۹۸-۹۹ ۰.۰۰۴۲۱
۰.۰۱٪	۵۲۰,۴۰۵,۶۵۹	.	۹۴,۳۴۱	۵۲۰,۵۰۰,۰۰۰	۶۰۰,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۵/۱۹	اسناد خزانه م-۹۸ بودجه ۹۸-۹۹ ۰.۰۰۵۱۹
۰.۵۴٪	۳۳,۰۹۵,۹۷۹,۰۲۷	.	۴,۱۸۶,۹۰۵	۳۳,۱۰۰,۱۶۵,۹۳۳	۳۷,۱۷۹,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۷/۱۹	اسناد خزانه م-۷ بودجه ۹۸-۹۹ ۰.۰۰۷۱۹
۰.۰۰٪	۱۰۱,۰۸۱,۸۹۴	.	۱۸,۳۲۴	۱۰۱,۱۰۰,۲۱۹	۱۲۱,۰۰۰,۰۰۰	.	۱۴۰۰/۰۸/۱۷	اسناد خزانه م-۸ بودجه ۹۸-۹۹ ۰.۰۰۸۱۷
۰.۰۶٪	۲۵,۸۸۵,۸۳۴,۱۱۸	۳۵۷,۹۷۶,۸۸۱	۴,۶۲۷,۷۶۳	۲۵,۵۳۲,۴۸۵,۰۰۰	۲۶,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۴۰۰/۱۲/۲۶	مشارکت دولتی ۱۰-شرایط خاص ۱۳۹۶ ۰.۰۱۲۲۶
۲.۲۵٪	۹۶,۴۹۶,۶۸۴,۰۴۳	۵,۳۷۱,۱۱۱,۹۴۸	۱۶,۵۱۹,۵۰۴	۹۱,۱۴۲,۰۹۱,۵۹۹	۹۱,۶۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۳۹۹/۰۹/۰۹	مشارکت دولتی ۹-شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹ ۹۹۰۹۰۹
۳.۷۰٪	۱۵۸,۵۱۳,۵۴۸,۶۲۳	۵,۷۲۹,۰۸۸,۸۲۹	۲۷,۶۹۷,۲۰۳	۱۵۲,۸۱۲,۱۵۷,۰۰۱	۱۶۱,۰۹۰,۰۰۰,۰۰۰			

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۷-۲- اوراق مرابحه به تفکیک ناشر به شرح زیر است:

(ریال) ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

درصد از کل دارایی ها	خالص ارزش فروش	سود متعلقه	کارمزد فروش	ارزش بازار	ارزش اسمی	نرخ سود	تاریخ سررسید	صکوک مرابحه خودرو
۰.۰۰٪	۴۰,۸۷۸,۱۱۲	۱,۰۸۵,۳۲۶	۷,۲۱۴	۳۹,۸۰۰,۰۰۰	۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۸	۱۴۰۰/۱۲/۰۵	
۱.۱۶٪	۴۹,۵۴۸,۹۰۲,۸۷۰	۱,۱۰۷,۶۸۴,۴۲۲	۸,۷۸۱,۵۶۳	۴۸,۴۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵		مرابحه علم دولت ۴
۱.۱۶٪	۴۹,۵۸۹,۷۸۰,۹۸۲	۱,۱۰۸,۷۶۹,۷۵۸	۸,۷۸۸,۷۷۶	۴۸,۴۸۹,۸۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۴۰,۰۰۰,۰۰۰			جمع

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۸- حسابهای دریافتنی

۱۳۹۹/۰۷/۳۰			
تجزیل نشده	مبلغ تجزیل	تجزیل نشده	تجزیل نشده
ریال	ریال	ریال	ریال
۴۰۷,۷۰۱,۳۵۲	(۶۷,۲۹۸,۶۴۸)	۴۷۵,۰۰۰,۰۰۰	
۱,۴۷۴,۰۱۷,۱۶۹	(۱,۳۹۲,۶۴۱)	۱,۴۷۵,۴۰۹,۸۱۰	
۱,۸۸۱,۷۱۸,۵۲۱	(۶۸,۶۹۱,۲۸۹)	۱,۹۵۰,۴۰۹,۸۱۰	

سود دریافتی سهام
سود دریافتی سپرده‌های بانکی

۹- سایر دارایی‌ها

۱۳۹۹/۰۷/۳۰

مانده در پایان سال مالی	استهلاک سال مالی	مخارج اضافه شده طی سال	مانده در ابتدای سال
ریال	ریال	ریال	ریال
۶۳۷,۹۱۸,۰۶۰	(۱۲۵,۰۸۱,۹۴۰)	۷۶۳,۰۰۰,۰۰۰	۰
۶۳۷,۹۱۸,۰۶۰	(۱۲۵,۰۸۱,۹۴۰)	۷۶۳,۰۰۰,۰۰۰	۰

مخارج نرم افزار

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماهه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۰- موجودی نقد

موجودی نقد صندوق در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰	
ریال	
۸۵۴,۳۱۰,۶۵۴	
۸۵۴,۳۱۰,۶۵۴	

حساب جاری بانک قرض الحسنه رسالت

۱۱- جاری کارگزاران

جاری کارگزاران به تفکیک هر کارگزار به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰

نام شرکت کارگزاری	مانده ابتدای دوره	گردش بدهکار	گردش بستانکار	مانده پایان دوره
صیاجهاد	ریال	ریال	ریال	ریال
	.	۱۲,۵۵۳,۱۴۸,۶۰۳,۸۴۶	۱۲,۵۵۴,۸۵۶,۹۱۴,۳۲۳	(۱,۷۰۸,۳۱۰,۴۷۷)
	.	۱۲,۵۵۳,۱۴۸,۶۰۳,۸۴۶	۱۲,۵۵۴,۸۵۶,۹۱۴,۳۲۳	(۱,۷۰۸,۳۱۰,۴۷۷)

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۲- بدهی به ارکان صندوق

بدهی به ارکان صندوق در تاریخ صورت خالص دارایی ها به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰	
ریال	
۱,۶۷۲,۹۱۲,۳۴۲	مدیر صندوق
۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	متولی
۶۵,۴۰۰,۰۰۰	حسابرس
۳۱۵,۸۱۷,۸۸۳	بازارگردان
۲,۳۰۴,۱۳۰,۲۲۵	

۱۳- سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر

سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر در تاریخ صورت خالص دارایی ها به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰	
ریال	
۲۵۲,۴۶۲,۳۶۸	ذخیره تصفیه
۷۶۳,۰۰۰,۰۰۰	نرم افزار صندوق
۱,۰۱۵,۴۶۲,۳۶۸	

۱۴- خالص دارایی ها

خالص دارایی‌ها در تاریخ صورت خالص دارایی ها به تفکیک واحدهای سرمایه گذاری عادی و ممتاز به شرح ذیل است:

۱۳۹۹/۰۷/۳۰		
ریال	تعداد	
۴,۱۷۲,۶۰۸,۰۳۹,۹۷۷	۳۹۰,۰۰۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری عادی
۱۰۶,۹۸۹,۹۴۹,۷۴۳	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۴,۲۷۹,۵۹۷,۹۸۹,۷۲۰	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۵- سود (زیان) فروش اوراق بهادار
سود (زیان) اوراق بهادار به شرح زیر است:

یادداشت	دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰
ریال	
۱۵-۱	۲۳۵,۲۷۰,۲۰۵,۱۹۸
۱۵-۲	۵۷۶,۷۴۶,۳۶۹
	۲۳۵,۸۴۶,۹۵۱,۵۶۷

سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس
سود (زیان) ناشی از فروش اوراق مشارکت

۱۵-۱- سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس به شرح زیر است:

تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
توسعه و عمران امید	۸۶,۵۳۸,۷۹۹	۲۳۸,۸۷۰,۸۵,۲۴۰	(۲۲۶,۸۹۵,۸۲۵)	(۱,۱۹۲,۳۳۵,۲۴۰)	۸۵,۸۴۲,۵۱۶,۶۶۱
سرمایه گذاری مالی سپهر صادرات	۷۳,۲۸۸,۰۰۰	۸۹۲,۴۱۰,۳۳۶,۰۰۰	(۸۴۷,۷۶۹,۴۹۱)	(۴,۴۶۲,۰۵۱,۷۸۸)	۱۴۹,۳۲۷,۶۸۸,۵۳۷
	۱۵۹,۸۲۶,۷۹۹	۱,۱۳۱,۲۵۷,۲۴۱,۲۴۰	(۱,۰۷۴,۶۶۵,۳۱۶)	(۵,۶۵۴,۳۸۷,۲۲۸)	۲۳۵,۲۷۰,۲۰۵,۱۹۸

۱۵-۲- سود (زیان) ناشی از فروش اوراق مشارکت به شرح زیر است:

تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
استاد خواجه ۳ بودجه ۹۷-۹۶-۹۵-۹۴-۹۳-۹۲-۹۱-۹۰	۳۳,۵۸۷	۳۳,۵۸۷,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۵۷۶,۷۴۶,۳۶۹
	۳۳,۵۸۷	۳۳,۵۸۷,۰۰۰,۰۰۰	.	.	۵۷۶,۷۴۶,۳۶۹

۱۶- سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار

یادداشت	دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰
ریال	
۱۶-۱	۳۴,۲۰۸,۳۸۶,۴۳۲
۱۶-۲	۱,۰۴۴,۰۲۲,۰۵۶
	۳۵,۲۵۲,۴۰۸,۴۸۸

خالص سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت و اجاره

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۶-۱- خالص سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام به شرح زیر است:

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری	مالیات	کارمزد	ارزش دفتری	ارزش بازار یا قیمت تعدیل شده	تعداد	
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال		
(۱,۶۴۰,۹۷۲,۷۴۰)	(۱۷۷,۷۹۲,۰۰۰)	(۳۳,۷۸۰,۴۸۰)	(۳۶,۹۸۷,۸۰۰,۲۶۰)	۲۵,۵۵۸,۴۰۰,۰۰۰	۲,۵۶۰,۰۰۰	نیمه ملت
(۱۸,۳۱۲,۱۷۳,۵۹۵)	(۴۷۷,۲۵۵,۷۰۶)	(۹۰,۶۷۸,۵۸۴)	(۱۱۳,۰۹۵,۳۸۰,۵۴۵)	۹۵,۴۵۱,۱۴۱,۲۴۰	۱,۰۳۷,۷۳۸	پتروشیمی پردیس
(۵,۴۶۶,۴۶۳,۱۳۱)	(۷۳۴,۲۸۰,۰۰۰)	(۱۳۷,۶۱۳,۲۰۰)	(۱۴۹,۴۶۰,۵۶۹,۹۳۱)	۱۴۴,۸۵۶,۰۰۰,۰۰۰	۷,۶۰۰,۰۰۰	فولاد کوه جنوب کیش
۱۶,۲۸۶,۳۳۷,۹۹۷	(۹۱۶,۳۳۰,۰۰۰)	(۱۷۴,۱۰۲,۷۰۰)	(۱۶۵,۸۸۹,۲۲۹,۳۰۳)	۱۸۳,۲۶۶,۰۰۰,۰۰۰	۴,۳۰۰,۰۰۰	پتروشیمی جم
۷,۲۳۸,۰۱۰-۸۴۱	(۸۶۴,۳۰۹,۳۳۰)	(۱۶۴,۳۱۸,۷۵۴)	(۱۶۴,۵۹۵,۳۰۷,۱۶۵)	۱۷۲,۸۶۱,۸۴۵,۹۹۰	۱,۱۰۱,۱۰۱	پتروشیمی زاگرس
۱۵۲,۱۱۲,۸۱۱,۵۴۰	(۱,۷۹۵,۹۵۰,۰۰۰)	(۳۴۱,۳۳۰,۵۰۰)	(۳۰۴,۹۴۰,۰۰۷,۹۶۰)	۳۵۹,۱۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۷,۰۰۰,۰۰۰	توسعه و عمران امید
۱۵۵,۴۸۵,۴۷۵,۳۴۲	(۳,۴۴۰,۰۶۲,۵۰۰)	(۶۵۳,۶۱۱,۸۷۵)	(۵۲۸,۴۳۳,۳۵۰,۲۸۳)	۶۸۸,۰۱۲,۵۰۰,۰۰۰	۵۲,۵۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری مالی سپهر صادرات
(۳۰,۳۳۰,۷۶۶,۵۷۷)	(۵۳۲,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۰۱,۰۸۰,۰۰۰)	(۱۰۸,۰۰۰,۶۸۶,۵۷۷)	۱۰۶,۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۹,۵۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری خوارزمی
(۲۹,۸۹۶,۰۷۲,۷۸۳)	(۹۲۲,۵۰۰,۰۰۰)	(۱۷۵,۳۷۵,۰۰۰)	(۲۱۳,۳۸۸,۳۹۷,۷۸۳)	۱۸۴,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	بانک پارسیان
(۱۹,۴۷۱,۶۱۷,۵۳۵)	(۴۰۹,۵۵۱,۵۶۱)	(۷۷,۸۱۴,۷۹۷)	(۱۰۰,۸۹۴,۵۶۳,۳۱۷)	۸۱,۹۱۰,۳۱۲,۱۴۰	۵,۰۱۲,۸۷۱	توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)
(۲۱,۶۱۷,۰۴۱,۵۹۸)	(۴۲۵,۲۱۲,۵۰۰)	(۸۰,۷۹۰,۳۷۵)	(۱۰۶,۱۵۳,۵۳۸,۷۳۳)	۸۵,۰۴۲,۵۰۰,۰۰۰	۵,۷۵۰,۰۰۰	سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی
(۱۲,۴۸۳,۷۵۴,۲۸۱)	(۱۸۷,۸۶۰,۰۰۰)	(۳۵,۶۹۳,۴۰۰)	(۴۹,۸۳۲,۲۰۰,۸۸۱)	۳۷,۵۷۲,۰۰۰,۰۰۰	۱,۲۴۰,۰۰۰	سرمایه گذاری ملی ایران
(۱۱,۹۳۶,۹۷۹,۶۹۵)	(۱۷۷,۴۱۴,۹۰۰)	(۳۳,۷۰۰,۸۸۳۱)	(۴۷,۲۰۰,۸۳۵,۹۶۴)	۳۵,۴۸۲,۹۸۰,۰۰۰	۲,۷۲۹,۴۶۰	سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)
(۲۹,۳۸۴,۴۹۳,۱۹۵)	(۳۵۳,۵۷۷,۰۰۰)	(۶۷,۱۷۹,۶۳۰)	(۹۹,۶۷۹,۱۳۶,۵۶۵)	۷۰,۷۱۵,۴۰۰,۰۰۰	۲,۹۸۰,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
(۳,۵۵۵,۵۴۱,۰۳۰)	(۲۶۱,۵۲۵,۰۰۰)	(۴۹,۶۸۹,۷۵۰)	(۵۵,۵۴۹,۳۲۶,۲۸۰)	۵۲,۳۰۵,۰۰۰,۰۰۰	۳,۳۰۰,۰۰۰	توسعه صنایع و فلزات
(۱۳,۳۱۵,۱۶۲,۸۳۲)	(۱۸۷,۸۷۶,۴۶۱)	(۳۵,۶۹۶,۵۲۸)	(۵۰,۵۶۶,۸۸۱,۹۷۳)	۳۷,۵۷۵,۲۹۲,۱۴۰	۲,۳۲۵,۲۹۴	پالایش نفت اصفهان
(۲۰,۹۹۴,۴۸۱,۳۲۸)	(۶۴۶,۲۹۰,۰۰۰)	(۱۲۲,۷۹۵,۱۰۰)	(۱۴۹,۴۸۳,۳۹۶,۱۲۸)	۱۲۹,۲۵۸,۰۰۰,۰۰۰	۷,۷۴۰,۰۰۰	معنای و صنعتی گل گهر
(۱۳,۰۸۱,۸۴۷,۰۰۲)	(۱۸۶,۶۸۰,۰۰۰)	(۳۵,۴۶۹,۲۰۰)	(۵۰,۱۹۵,۶۹۷,۸۰۲)	۳۷,۳۳۶,۰۰۰,۰۰۰	۲,۶۰۰,۰۰۰	فولاد مبارکه اصفهان
(۳۱,۳۱۰,۷۸۵,۵۰۴)	(۳۴۵,۴۵۰,۰۰۰)	(۶۵,۶۳۵,۵۰۰)	(۹۹,۹۸۹,۷۰۰,۰۰۴)	۶۹,۰۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۲,۱۰۰,۰۰۰	فولاد خوزستان
(۶۰۸,۳۹۲,۷۶۲)	(۳۰,۸۲۷,۴۸۵)	(۵۸۵,۷۳۲۲)	(۶,۳۷۷,۱۰۰,۵۰۸۵)	۶,۱۶۵,۴۹۷,۰۳۰	۱۶۳,۴۱۱	داروسازی جابرین حیاح
(۶۱,۰۰۰,۴۸۰,۳۸۰۸)	(۱,۳۴۲,۵۰۰,۰۰۰)	(۲۵۵,۰۷۵,۰۰۰)	(۳۲۷,۹۰۰,۷۲۸,۸۰۸)	۲۶۸,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵,۰۰۰,۰۰۰	مس نفت و گاز و پتروشیمی تأمین
۳۴,۳۰۸,۲۸۶,۴۳۲	(۱۴,۴۰۵,۲۴۴,۳۴۳)	(۲,۷۳۶,۹۹۶,۴۲۶)	(۲,۸۲۹,۶۹۸,۲۴۱,۳۳۷)	۲,۸۸۱,۰۰۴,۸۶۸,۵۴۰	۲۹۶,۴۴۹,۸۷۵	

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۶-۲ - سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت و اوراق اجاره به شرح زیر است:

دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۳۰/۷/۱۳۹۹

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری	مالیات	کارمزد	ارزش دفتری	ارزش بازار یا قیمت تعدیل شده	تعداد	ص
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال		مشارکت دولتی-۹-شرایط مشارکت دولتی-۱۰-شرایط اسناد خزانه-۱۶-بودجه ۹۷-۴۰۷-۰۰۰ اسناد خزانه-۲۱-بودجه ۹۷-۷۲۸-۰۰۰ اسناد خزانه-۷-بودجه ۹۸-۷۱۹-۰۰۰ اسناد خزانه-۴-بودجه ۹۸-۵۱۹-۰۰۰ اسناد خزانه-۳-بودجه ۹۸-۴۲۱-۰۰۰ اسناد خزانه-۸-بودجه ۹۸-۸۱۷-۰۰۰
(۱۷۴,۴۵۰)	.	(۷,۲۱۴)	(۳۹,۹۶۷,۲۳۶)	۳۹,۸۰۰,۰۰۰	۴۰	۱۸٪
۲۸۱,۳۶۹,۵۵۵	.	(۱۶,۵۱۹,۵۵۴)	(۹۰,۸۴۴,۳۰۲,۵۴۱)	۹۱,۱۴۲,۹۱۶,۰۰۰	۹۱,۶۰۰	شرایط
۱۰,۱۴۰,۴۹۸	.	(۴,۶۲۷,۷۶۳)	(۲۵,۵۱۷,۷۱۶,۷۳۹)	۲۵,۵۳۲,۴۸۵,۰۰۰	۲۶,۵۰۰	شرایط
۲۸,۸۳۸,۸۶۹	.	(۱۷۶,۱۷۳)	(۹۴۲,۹۷۴,۱۵۸)	۹۷۱,۹۸۹,۲۰۰	۱,۰۸۰	بودجه ۹۷-۴۰۷-۰۰۰
۸۰,۰۳۷,۵۰۱	.	(۵۰۹,۸۷۲)	(۲,۷۳۲,۵۳۸,۸۷۷)	۲,۸۱۳,۰۸۶,۲۵۰	۳,۳۱۰	بودجه ۹۷-۷۲۸-۰۰۰
۵۸۷,۶۸۸,۱۴۲	.	(۴,۱۸۶,۹۰۵)	(۲۲,۵۰۸,۲۹۰,۸۸۶)	۲۳,۱۰۰,۱۶۵,۹۳۳	۲۷,۱۷۹	بودجه ۹۸-۷۱۹-۰۰۰
۷,۹۱۲,۷۸۷	.	(۹۴,۳۴۱)	(۵۱۲,۴۹۲,۸۷۲)	۵۲۰,۵۰۰,۰۰۰	۶۰۰	بودجه ۹۸-۵۱۹-۰۰۰
۷۵,۸۸۸,۴۵۶	.	(۶۸۹,۶۸۱)	(۳,۷۲۸,۵۶۰,۶۶۳)	۳,۸۰۵,۱۳۸,۸۰۰	۴,۳۰۰	بودجه ۹۸-۴۲۱-۰۰۰
۱۷,۶۶۰,۰۵۵	.	(۸۷۴,۶۴۰)	(۴,۸۰۷,۰۶۵,۳۰۵)	۴,۸۲۵,۶۰۰,۰۰۰	۶,۴۰۰	بودجه ۹۸-۸۱۷-۰۰۰
۲,۳۲۹,۲۱۱	.	(۱۸,۳۲۴)	(۹۸,۷۵۲,۶۸۴)	۱۰۱,۱۰۰,۲۱۹	۱۲۱	
(۴۷,۵۶۸,۵۶۳)	.	(۸,۷۸۱,۵۶۳)	(۴۸,۴۸۸,۷۸۷,۰۰۰)	۴۸,۴۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	مراجعه عام دولت-۴-ش.خ. ۰۰۰۸
۱,۰۴۴,۰۲۲,۰۵۶	.	(۳۶,۴۸۵,۹۸۰)	(۲۰,۰۲۲۱,۴۴۸,۹۶۱)	۲۰,۱۳۰,۱۹۵۷,۰۰۲	۲۱۱,۱۳۰	

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰ سود سهام					
خالص درآمد سود	هزینه تنزیل	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در	تاریخ تشکیل	نام شرکت
سهام	ریال	ریال	زمان مجمع	مجمع	سال مالی
ریال	ریال	ریال	ریال	۱۳۹۹/۰۷/۳۹	سرمایه گذاری خوارزمی
۴۰,۷۰۰,۱۳۵۲	(۶۷,۲۹۸,۶۴۸)	۵۰	۹,۵۰۰,۰۰۰		
۴۰,۷۰۰,۱۳۵۲	(۶۷,۲۹۸,۶۴۸)				

۱۸- سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب شامل سود اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق رهنی به شرح زیر تفکیک می‌شود:

یادداشت	دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰	ریال
۱۸-۱	۱,۹۲۵,۴۶۹,۵۱۲	
۱۸-۱	۹۵۶,۴۴۳,۹۶۵	
۱۸-۲	۶,۷۷۳,۱۶۶,۱۲۷	
	۹,۶۵۵,۰۷۹,۶۰۴	

سود اوراق مشارکت
سود اوراق مرابحه
سود سپرده و گواهی سپرده بانکی

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱- سود اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق رهنی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

تاریخ سرمایه گذاری	تاریخ سررسید	مبلغ اسمی	درصد	سود	هزینه تنزیل	خالص سود اوراق
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
۱۴۰۰/۱۲/۲۶	۲۶۵۰۰۰۰۰۰۰۰	۱۵	۱,۷۲۱,۱۷۶,۰۲۸	۰	۱,۷۲۱,۱۷۶,۰۲۸	
۱۳۹۹/۰۹/۰۹	۹۱۶۰۰۰۰۰۰۰۰۰	۱۵	۲۰۴,۲۹۳,۴۸۴	۰	۲۰۴,۲۹۳,۴۸۴	
			۱,۹۲۵,۴۶۹,۵۱۲	۰	۱,۹۲۵,۴۶۹,۵۱۲	
			۹۵۵,۵۶۶,۹۲۶	۰	۹۵۵,۵۶۶,۹۲۶	
			۸۷۲,۰۱۹	۰	۸۷۲,۰۱۹	
			۹۵۶,۴۴۳,۹۶۵	۰	۹۵۶,۴۴۳,۹۶۵	

اوراق مشارکت بورسی:

مشارکت دولتی ۱۰-شرایط خاص ۱۲۲۶-۰۰

مشارکت دولتی ۹-شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹

اوراق مرابحه:

ص مرابحه عام دولت ۴

ص مرابحه خودرو ۴۱۲-۳-امعه ۱۸٪

۱۸-۲- سود سپرده و گواهی سپرده بانکی

دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

تاریخ سرمایه گذاری	تاریخ سررسید	مبلغ اسمی	درصد	سود	هزینه تنزیل	هزینه برگشت سود	سود خالص
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
۱۴۰۰/۰۶/۲۹	۱۰۰۰۰۰۰۰۰۰۰۰	۱۸	۱,۵۷۳,۷۷۰,۴۹۰	(۶۹۱,۵۶۱)	۰	۱,۵۷۳,۷۷۰,۴۹۰	
۱۴۰۰/۰۷/۰۱	۱۰۰۰۰۰۰۰۰۰۰۰	۱۸	۱,۴۲۶,۳۲۹,۴۸۳	(۷۰۱,۰۸۰)	۰	۱,۴۲۶,۳۲۹,۴۸۳	
			۴,۶۵۹,۸۰۴,۶۹۵	(۱,۳۹۲,۶۴۱)	۰	۴,۶۵۹,۸۰۴,۶۹۵	
			۱,۰۰۵,۴۶۴,۴۵۸	۰	۰	۱,۰۰۵,۴۶۴,۴۵۸	
۱۴۰۰/۰۷/۳۳	۵۸۰۰۰۰۰۰۰۰۰۰	۱۸	۱,۹۹۶,۷۲۱,۳۰۷	۰	(۸۸۷,۴۳۱,۶۹۲)	۱,۱۰۹,۲۸۹,۶۱۵	
			۳,۰۰۰,۲۰۱,۸۵,۷۶۵	۰	(۸۸۷,۴۳۱,۶۹۲)	۲,۱۱۲,۷۵۴,۰۷۳	

سپرده بانکی:

کوتاه مدت-۱-۱۷۵۷۰۱-۴۳۰۰۰۰-۲۳۹۸۱۰-پسارگاد

بلند مدت-۷۰۰۰۷-۴۰۱۵۰۷۰۰-آینده

بلند مدت-۷۰۰۸۴۶۱۳۳۹۸۵-شهر

گواهی سپرده بانکی:

سود اوراق گواهی سپرده بانکی بانک صادرات

سود اوراق گواهی سپرده بانکی بانک آینده

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۱۹- سایر درآمدها

دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

ریال
۱,۱۳۵,۷۵۱,۲۴۲
۱,۱۳۵,۷۵۱,۲۴۲

تعديل کارمزد کارگزاری

۲۰- هزینه‌های کارمزد ارکان

هزینه‌های کارمزد ارکان به شرح زیر می‌باشد:

دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

ریال
۱,۶۷۰,۹۲۲,۳۴۲
۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰
۶۵,۴۰۰,۰۰۰
۳۱۵,۸۱۷,۸۸۳
۲,۳۰۲,۱۴۰,۲۲۵

مدیر صندوق

متولی صندوق

حسابرس

بازارگردان

۲۱- سایر هزینه‌ها

دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰

ریال
۲۵۲,۴۶۲,۳۶۸
۲۰,۰۰۰,۰۰۰
۱۲۵,۰۸۱,۹۴۰
۲۱۸,۰۰۰
۳۹۷,۷۶۲,۳۰۸

هزینه تصفیه

سایر هزینه‌ها

هزینه نرم افزار

هزینه خدمات بانکی

۲۲- تعهدات و بدهی‌های احتمالی

در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها صندوق هیچ گونه تعهدات و بدهی احتمالی ندارد.

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۳ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ مهر ۱۳۹۹

۲۳- سرمایه گذاری ارکان و اشخاص وابسته به آن‌ها در صندوق

درصد تملک	دوره ۳ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۰۷/۳۰		نوع وابستگی	نام	اشخاص وابسته
	تعداد واحدهای	نوع واحدهای			
	سرمایه گذاری	سرمایه گذاری			
۰.۲۵٪	۱,۰۰۰,۰۰۰	ممتاز		مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	مدیر و اشخاص وابسته به وی
۰.۰۰٪	۰	عادی		مؤسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور	اشخاص وابسته به متولی
۰					کارگزار و اشخاص وابسته به وی
۰.۰۱٪	۴۰,۰۰۰	عادی		سمیرا سلیمانی	مدیر سرمایه گذاری و اشخاص
۰.۰۱٪	۴۰,۰۰۰	عادی		معصومه میر محمدی	مدیر سرمایه گذاری و اشخاص
۰.۰۱٪	۴۰,۰۰۰	عادی		حسین عبدی	مدیر سرمایه گذاری و اشخاص
۰.۲۸٪	۱,۱۲۰,۰۰۰				جمع

۲۴- معاملات با ارکان و اشخاص وابسته به آن‌ها

مانده طلب (بدهی) - ریال	شرح معامله		نوع وابستگی	طرف معامله	
	ارزش معامله	ارزش معامله			
(۱,۷۰۸,۳۱۰,۴۷۷)	۲۵,۱۰۸,۰۰۵,۵۱۸,۱۶۹		کارگزار مدیر صندوق	صبا جهاد	
(۱,۶۷۲,۹۱۲,۳۴۲)	۱,۶۷۲,۹۱۲,۳۴۲		مدیر صندوق	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	
(۳۱۵,۸۱۷,۸۸۳)	۳۱۵,۸۱۷,۸۸۳		بازگردان صندوق	صندوق اختصاصی بازارگردانی آفرین صندوق بازنشتگی کشوری	
(۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰)	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰		متولی	مؤسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور	
(۶۵,۴۰۰,۰۰۰)	۶۵,۴۰۰,۰۰۰		حسابرس	مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین	

۲۵- رویدادهای بعد از تاریخ ترازنامه

هیچگونه رویداد با اهمیتی که بعد از تاریخ صورت صورت‌های مالی اتفاق افتاده و مستلزم تعدیل اقلام صورت‌های مالی و یا افشا در یادداشت‌های همراه بوده وجود نداشته است.