



صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت‌های مالی و یادداشت‌های توضیحی

برای دوره ۶ ماه و چهار روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹



صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری

صورت های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

با سلام

به پیوست صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری مربوط به دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰/۱۰/۱۳۹۹ 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 ۲۰

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 بازنشتگی 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 ۱۳۹۹/۱۱/۲۶ به تایید ارکان زیر در صندوق رسیده است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	مهدی فرازمند	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	مدیر صندوق
	نریمان ایلخانی	موسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور	متولی صندوق

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

صورت خالص دارایی ها

در تاریخ ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

۱۳۹۹/۱۰/۳۰	یادداشت	دارایی ها:
ریال		
۳,۸۳۵,۳۷۱,۵۵۶,۵۱۴	۵	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام
۳۶,۳۰۸,۱۸۲,۸۸۷	۶	سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱۳۰,۷۶۳,۷۷۷,۴۱۴	۷	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۶,۸۳۴,۳۹۵,۰۸۶	۸	حساب های دریافتی
۴۵۰,۲۹۵,۱۵۰	۹	سایر دارایی ها
۴۳,۸۰۰	۱۰	موجودی نقد
۴,۰۰۹,۷۲۸,۲۵۰,۸۵۱		جمع دارایی ها
		بدهی ها:
۱۷۹,۶۲۷,۷۶۲,۸۲۶	۱۱	جاری کارگزاران
۶,۰۶۹,۱۰۲,۳۹۷	۱۲	پرداختنی به ارکان صندوق
۱,۴۰۳,۴۰۵,۲۰۷	۱۳	سایر حساب های پرداختنی و ذخایر
۱۸۷,۱۰۰,۲۷۰,۴۳۰		جمع بدهی ها
۳,۸۲۲,۶۲۷,۹۸۰,۴۲۱	۱۴	خالص دارایی ها
۹,۵۵۷		خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری - ریال

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

مشاور سرمایه گذاری
فراز ایده نوآفرین تک
(سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۱۸۸۹۲

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی ها
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

درآمدها:	یادداشت	دوره مالی ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰
		ریال
سود فروش اوراق بهادار	۱۵	۵۹۲,۴۳۹,۶۸۱,۵۱۰
زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۶	(۷۹۲,۰۹۲,۹۴۶,۸۵۳)
سود سهام	۱۷	۶,۸۳۴,۳۹۵,۰۸۶
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۸	۲۲,۵۸۱,۷۴۰,۴۶۶
سایر درآمدها	۱۹	۲,۰۵۱,۱۲۷,۲۴۶
جمع درآمدها		(۱۶۸,۱۸۶,۰۰۲,۵۴۵)
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۰	(۸,۰۹۱,۲۳۲,۷۷۷)
سایر هزینه ها	۲۱	(۱,۰۹۴,۷۸۴,۲۵۷)
جمع هزینه ها		(۹,۱۸۶,۰۱۷,۰۳۴)
زیان خالص		(۱۷۷,۳۷۲,۰۱۹,۵۷۹)
بازده میانگین سرمایه گذاری		-۴.۵۶٪
بازده سرمایه گذاری در پایان دوره		-۴.۶۴٪

صورت گردش خالص دارایی ها	تعداد واحدهای	ریال
دوره مالی ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰	سرمایه گذاری	
خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول دوره	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
سود (زیان) خالص	-	(۱۷۷,۳۷۲,۰۱۹,۵۷۹)
خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) در پایان دوره	۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۳,۸۲۲,۶۲۷,۹۸۰,۴۲۱

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

۳
مشاور سرمایه گذاری
فراز ایده نوآفرین تک
 (سهامی خاص) شماره ثبت: ۵۱۸۸۹۲

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

یادداشت‌های توضیحی همراه صورت‌های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

متولی صندوق، موسسه حسابرسی فراز مشاور دیلمی پور (حسابداران رسمی) است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ به شماره ثبت ۳۴۹۱ در اداره ثبت شرکت‌ها و مالکیت صنعتی تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت‌است 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 شرکت‌های 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 شرکت‌ها و مالکیت صنعتی تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت‌است از: تهران، سهروردی شمالی، خیابان خرمشهر، خیابان شهید عربعلی، پلاک ۱، واحد ۶.

۳- مبنای تهیه صورت‌های مالی:

صورت‌های مالی صندوق اساساً بر مبنای ارزش‌های جاری تهیه شده است.

۴- خلاصه اهم رویه‌های حسابداری

۴-۱- سرمایه‌گذاری‌ها

سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار شامل سهام و سایر انواع اوراق بهادار در هنگام تحصیل به بهای تمام‌شده ثبت و در اندازه‌گیری‌های بعدی به خالص ارزش فروش طبق دستورالعمل «نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری» مصوب ۱۳۸۶/۱۱/۳۰ هیات مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار اندازه‌گیری می‌شود.

۴-۱-۱- سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی: سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌های بورسی یا فرابورسی به خالص ارزش فروش منعکس می‌شود. خالص ارزش فروش سهام عبارت است از ارزش بازار سهم در پایان روز یا قیمت تعدیل‌شده سهم، منهای کارمزد معاملات و مالیات فروش سهام. با توجه به دستورالعمل «نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری» مدیر صندوق می‌تواند 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 تعدیل‌شده را مبنای محاسبه خالص ارزش فروش قرار دهد.

۴-۱-۲- سرمایه‌گذاری در اوراق مشارکت پذیرفته‌شده در بورس یا فرابورس: خالص ارزش فروش اوراق مشارکت در هر روز با کسر کارمزد فروش از قیمت بازار آنها محاسبه می‌گردد.

۴-۱-۳- سرمایه‌گذاری 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 می‌شود.

۴-۲- درآمد حاصل از سرمایه‌گذاری‌ها

۴-۲-۱- سود سهام: درآمد حاصل از سود سهام شرکت‌ها در زمان تصویب سود توسط مجمع عمومی صاحبان سهام شرکت‌های سرمایه‌پذیر شناسایی می‌شود. همچنین سود سهام متعلق به صندوق سرمایه‌گذاری به ارزش فعلی محاسبه و در حساب‌ها منعکس می‌گردد. برای محاسبه

یادداشت های توضیحی همراه صورت های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی 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 آنها 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

یادداشت‌های توضیحی همراه صورت‌های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

حق پذیرش و عضویت در کانون‌ها	معادل مبلغ تعیین شده توسط کانون‌های مذکور مشروط بر اینکه عضویت در این کانون‌ها 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.
هزینه‌های دسترسی به نرم افزار، تارنما و خدمات پشتیبانی آنها	هزینه‌ی 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 می‌شود.

۴-۵- مخارج تأمین مالی

سود و کارمزد تسهیلات دریافتی از بانک‌ها، مؤسسات مالی و اعتباری و خرید اقساطی سهام، مخارج تأمین مالی را دربرمی‌گیرد و در دوره وقوع به عنوان هزینه شناسایی می‌شود.

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

۵- سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم سهام

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰

صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی ها
	ریال	ریال	درصد
محصولات شیمیایی	۹۶۵,۸۳۵,۵۰۰,۷۸۲	۸۱۹,۸۲۴,۱۱۸,۴۵۸	۲۰.۴۵٪
محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۷۸۸,۷۷۸,۱۲۰,۰۵۷	۷۹۸,۷۲۶,۰۰۳,۶۲۷	۱۹.۹۲٪
فلزات اساسی	۸۱۱,۴۴۷,۷۱۵,۶۷۲	۶۳۵,۳۹۵,۹۰۰,۶۶۴	۱۵.۸۵٪
استخراج کانه های فلزی	۴۵۵,۸۴۷,۲۵۸,۹۲۹	۳۴۱,۹۷۴,۱۷۴,۴۵۵	۸.۵۳٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۳۶۱,۳۳۵,۶۸۱,۶۰۰	۲۸۳,۴۵۳,۳۵۷,۵۰۰	۷.۰۷٪
خرده فروشی انواع مواد غذایی، نوشیدنی و غیره	۲۸۹,۲۸۶,۹۳۹,۲۰۳	۲۷۷,۲۲۳,۵۰۵,۶۹۱	۶.۹۱٪
سرمایه گذاریها	۲۲۲,۱۲۵,۸۹۴,۱۸۳	۱۹۰,۲۱۸,۷۶۸,۱۲۱	۴.۷۴٪
بانکها و موسسات اعتباری	۲۳۲,۴۳۶,۰۴۰,۶۲۴	۱۵۱,۸۵۱,۰۷۸,۰۰۰	۳.۷۹٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۱۸۱,۳۳۸,۳۱۲,۰۸۹	۱۱۶,۲۲۲,۲۲۴,۹۷۶	۲.۹۰٪
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۹۸,۲۴۶,۸۶۲,۳۲۰	۹۸,۶۳۶,۸۹۰,۶۲۷	۲.۴۶٪
سیمان، آهک و گچ	۷۱,۷۱۹,۶۵۷,۳۳۹	۶۷,۱۶۳,۹۸۲,۳۰۰	۱.۶۸٪
رایانه و فعالیت‌های وابسته به آن	۲۲,۶۴۳,۸۵۶,۹۶۸	۲۶,۱۵۳,۵۷۴,۳۳۹	۰.۶۵٪
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۲۰,۳۰۰,۴۰۰,۸۰۳	۲۱,۷۷۳,۷۷۶,۴۳۰	۰.۵۴٪
مواد و محصولات دارویی	۶,۷۳۷,۱۰۵,۰۸۵	۶,۷۵۴,۲۰۱,۳۳۵	۰.۱۷٪
جمع	۴,۶۲۸,۰۷۹,۳۴۵,۶۵۴	۳,۸۳۵,۳۷۱,۵۵۶,۵۱۴	۹۵.۶۶٪

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی، صورت‌های مالی،
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

ریال	یادداشت
۶۹۹۰۶۳۵۸۲۴	۶-۱
۲۹۳۱۷۵۴۷۰۶۳	۶-۲
۳۶۳۰۸۱۸۲۸۸۷	

۶- سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی

سپردهای بانکی
 گواهی سپرده بانکی

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

نوع سپرده	مبلغ-ریال	درصد از کل دارایی ها
کوتاه مدت	۱,۱۷۹,۳۰۴,۹۶۸	۰۰.۳٪
کوتاه مدت	۲۶۸۵,۸۲۱,۳۵۸	۰۰.۷٪
کوتاه مدت	۷۴۴,۵۷۹,۱۲۱	۰۰.۲٪
کوتاه مدت	۲,۳۸۱,۰۳۰,۳۷۷	۰۰.۶٪
کوتاه مدت	۶,۹۹۰,۶۳۵,۸۲۴	۰.۱۷٪
آینده - ۰۲/۳۵۸۵۲۵۴۰۰۶		
شهر - ۷۰۰۸۴۶۰۶۷۳۱۵		
پاسارگان - ۲۳۹,۸۱۰۰۰,۱۴۳۰,۱۷۵۷,۱		
صادرات - ۰۲۱۶۳۳۰۸۰۴۰۰۰		

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
۱۴۰۱/۰۷/۲۳	۱۸	۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۴,۷۵۴,۰۹۴	(۹۹۷,۲۰۷,۰۳۱)	۲۹,۳۱۷,۵۴۷,۰۶۳	۰.۷۳٪
اراق گواهی سپرده بانکی، بانک آینده		۳۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۴,۷۵۴,۰۹۴	(۹۹۷,۲۰۷,۰۳۱)	۲۹,۳۱۷,۵۴۷,۰۶۳	۰.۷۳٪

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی 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:

ریال	۱۳۹۹/۱۰/۳۰	یادداشت
۷-۱	۷۸,۸۰۳,۰۳۷,۷۶۲	اوراق مشارکت بورسی و فرابورسی
۷-۲	۵۱,۹۶۰,۷۳۹,۶۵۲	اوراق مرابحه
	۱۳۰,۷۶۳,۷۷۷,۴۱۴	

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

درصد از کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	سود متعلقه	کارمزد فروش	ارزش بازار	ارزش اسمی	نرخ سود	تاریخ سررسید	
۱۵۴٪	۶۱,۵۹۲,۱۷۴,۵۶۹	۲,۰۸۵,۵۳۰,۸۲۱	۱۰,۶۰۶,۲۵۲	۵۸,۵۱۷,۳۵۰,۰۰۰	۶۱,۵۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۴۰۰/۱۲/۲۶	مشارکت دولتی ۱۰- شرایط خالص ۱۲۲۶
۰.۴۳٪	۱۷,۲۱۰,۸۶۳,۱۹۳	۰	۳,۱۲۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۷,۲۱۲,۹۸۳,۲۲۷	۲۰,۸۰۳,۰۰۰,۰۰۰	۱۸	۱۴۰۰/۰۱/۲۳۰	اوراق سلف موازی ورق گرم فولاد
۱.۹۷٪	۷۸,۸۰۳,۰۳۷,۷۶۲	۲,۰۸۵,۵۳۰,۸۲۱	۱۳,۷۲۶,۲۸۶	۷۵,۷۳۱,۲۳۳,۲۲۷	۸۲,۳۰۳,۰۰۰,۰۰۰			

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰ (ریال)

درصد از کل دارایی‌ها	خالص ارزش فروش	سود متعلقه	کارمزد فروش	ارزش بازار	ارزش اسمی	نرخ سود	تاریخ سررسید	
۱.۳۰٪	۵۱,۹۶۰,۷۳۹,۶۵۲	۲,۹۶۹,۶۲۰,۹۰۲	۸,۸۸۱,۲۵۰	۴۹,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵	۱۴۰۰/۰۱/۰۴	مرابحه عام دولت ۴
۱.۳۰٪	۵۱,۹۶۰,۷۳۹,۶۵۲	۲,۹۶۹,۶۲۰,۹۰۲	۸,۸۸۱,۲۵۰	۴۹,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰			

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

۸- حسابهای دریافتی

۱۳۹۹/۱۰/۳۰			
تنزیل نشده	مبلغ تنزیل	تنزیل شده	
ریال	ریال	ریال	
۶۸۳۴,۳۹۵,۰۸۶	(۹۵۶۸۶۰,۹۱۴)	۷,۷۹۱,۲۵۶,۰۰۰	
۶۸۳۴,۳۹۵,۰۸۶	(۹۵۶۸۶۰,۹۱۴)	۷,۷۹۱,۲۵۶,۰۰۰	سود دریافتی سهام

۹- سایر دارایی‌ها

۱۳۹۹/۱۰/۳۰			
مانده در پایان دوره	استهلاک طی دوره	مخارج اضافه شده طی دوره	مانده در ابتدای دوره
ریال	ریال	ریال	ریال
۰	(۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۰
۴۵۰,۲۹۵,۱۵۰	(۳۱۲,۷۰۴,۸۵۰)	۷۶۳,۰۰۰,۰۰۰	۰
۰	(۶۰,۰۰۰,۰۰۰)	۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۰
۴۵۰,۲۹۵,۱۵۰	(۴۳۲,۷۰۴,۸۵۰)	۸۸۳,۰۰۰,۰۰۰	۰

مخارج عضویت در کلون‌ها
 مخارج نرم افزار صندوق
 خدمات سپرده گذاری و نگهداری
 واحدهای سرمایه گذاری

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

۱۰- موجودی نقد

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰	
ریال	
۴۳,۸۰۰	
۴۳,۸۰۰	
	حساب جاری بانک قرض الحسنه رسالت

۱۱- جاری کارگزاران

جاری کارگزاران به تفکیک هر کارگزار به شرح زیر است:

۱۳۹۹/۱۰/۳۰

نام شرکت کارگزاری	مانده ابتدای دوره	گرددش بدهکار	گرددش بستانکار	مانده پایان دوره
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
صبا جهاد	۰	۱۶,۳۵۷,۲۶۹,۳۷۱,۸۷۵	۱۶,۵۳۶,۸۹۷,۱۳۴,۷۰۱	(۱۷۹,۶۲۷,۷۶۲,۸۲۶)
	۰	۱۶,۳۵۷,۲۶۹,۳۷۱,۸۷۵	۱۶,۵۳۶,۸۹۷,۱۳۴,۷۰۱	(۱۷۹,۶۲۷,۷۶۲,۸۲۶)

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

۱۲- بدهی به ارکان صندوق

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰	
ریال	
مدیر صندوق	۴,۹۱۷,۹۰۵,۱۵۱
متولی	۲۵,۰۰۰,۰۰۰
حسابرس	۱۶۲,۸۵۶,۷۲۱
بازارگردان	۹۶۳,۳۴۰,۵۲۵
	<u>۶,۰۶۹,۱۰۲,۳۹۷</u>

۱۳- سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰	
ریال	
ذخیره تصفیه	۶۴۰,۴۰۵,۲۰۷
نرم افزار صندوق	۷۶۳,۰۰۰,۰۰۰
	<u>۱,۴۰۳,۴۰۵,۲۰۷</u>

۱۴- خالص دارایی ها

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

۱۳۹۹/۱۰/۳۰		
ریال	تعداد	
واحدهای سرمایه گذاری عادی	۳۹۰,۰۰۰,۰۰۰	۳,۷۲۷,۰۶۲,۲۸۰,۹۱۰
واحدهای سرمایه گذاری ممتاز	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۵,۵۶۵,۶۹۹,۵۱۱
	<u>۴۰۰,۰۰۰,۰۰۰</u>	<u>۳,۸۲۲,۶۲۷,۹۸۰,۴۲۱</u>

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری

یادداشت های توضیحی صورت های مالی

دوره ۴ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

۱۵- سود (زیان) فروش اوراق بهادار

سود (زیان) اوراق بهادار به شرح زیر است:

دوره ۴ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱/۳۰	یادداشت
ریال	
۵۸۷,۰۵۳,۸۶۹,۷۰۰	۱۵-۱
۵,۳۸۵,۸۱۱,۸۱۱	۱۵-۲
۵۹۲,۴۳۹,۶۸۱,۵۱۰	

سود حاصل از فروش سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس با فالورس

سود ناشی از فروش اوراق مشارکت

۱۵-۱- سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس با فالورس به شرح زیر است:

دوره ۴ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱/۳۰	دوره ۴ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱/۳۰	ارزش دفتری	کارمزد	مبایات	سود (زیان) فروش	تعداد
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	
۱۴۷,۶۲۱,۳۷۱,۶۷۰	۲,۴۴۳,۷۰۲,۰۷۳	۳۳۶,۲۳۲,۰۴۴,۴۵۱	۴۶۲,۳۸۹,۱۱۶	۲,۴۴۳,۷۰۲,۰۷۳	۴۸۶,۷۴۰,۴۰۷,۳۱۰	۱۹۱,۹۴۹,۳۲۵
۶,۸۵۱,۹۹۶,۱۵۹	۱۳۴,۷۳۵,۹۹۹	۱۹,۹۳۲,۸۸۰,۳۵۷	۲۵,۵۹۷,۴۸۵	۱۳۴,۷۳۵,۹۹۹	۲۶,۹۴۵,۲۰۰,۰۰۰	۱,۲۴۰,۰۰۰
۶۰,۶۶۱,۰۹۲,۶۱۹	۸۳۲,۹۹۲,۳۴۳	۱۰۲,۹۵۸,۰۲۰,۹۶۷	۱۵۶,۳۶۶,۵۳۳	۸۳۲,۹۹۲,۳۴۳	۱۶۴,۵۹۸,۴۷۲,۴۶۲	۷,۱۰۲,۲۱۱
۲۵۳,۱۰۰,۵۶۶,۶۷۳	۷,۶۴۱,۵۰۰,۵۹۱	۱,۴۵۱,۸۵۳,۷۶۲	۱,۴۵۱,۸۵۳,۷۶۲	۷,۶۴۱,۵۰۰,۵۹۱	۱,۵۲۸,۳۰۰,۰۹۷,۴۹۳	۱۲۵,۷۸۸,۰۰۰
۲۷,۹۴۸,۳۰۴,۸۶۷	۲۸۲,۳۷۷,۰۳۹	۲۸,۱۹۱,۱۷۴,۳۶۲	۵۳,۶۵۱,۶۰۴	۲۸۲,۳۷۷,۰۳۹	۵۶,۴۷۵,۴۰۷,۸۷۲	۱,۱۲۶,۶۲۴
(۱۰۰۹۱۲۰۶۵,۶۶۵)	۱۶۵,۰۲۶,۵۰۰	۴۳,۷۷۰,۹۶۲,۸۴۲	۲۱,۳۵۴,۷۵۳	۱۶۵,۰۲۶,۵۰۰	۳۳,۰۰۵,۲۹۹,۶۳۰	۲,۰۰۰,۰۰۰
۳۶,۷۹۵,۶۴۰,۸۴۰	۸۹۸,۸۳۱,۳۸۳	۱۴۱,۹۰۱,۰۲۶,۶۷۳	۱۷۰,۷۷۷,۲۹۱	۸۹۸,۸۳۱,۳۸۳	۱۷۹,۷۶۶,۳۷۶,۱۸۷	۹۴۹,۳۸۲
۴۵,۱۹۵,۱۳۶,۷۴۴	۹۹۲,۳۴۶,۲۵۶	۱۵۲,۰۹۲,۲۴۲,۸۱۱	۱۸۸,۵۴۴,۵۶۹	۹۹۲,۳۴۶,۲۵۶	۱۹۸,۴۶۹,۳۷۰,۴۸۰	۷۸۰,۰۰۰
۹,۷۰۱,۸۷۳,۳۰۰	۲۷۵,۳۷۰,۱۸۱	۵۲,۳۰۰,۸۴۰	۵۲,۳۰۰,۸۴۰	۲۷۵,۳۷۰,۱۸۱	۵۵,۰۵۴,۰۳۶,۲۸۰	۱,۳۱۸,۱۴۸
۱,۴۹۶,۱۶۷,۴۲۹	۱۳۰,۸۱۰,۱۲۴	۲۲,۹۵۳,۷۶۰	۲۲,۹۵۳,۷۶۰	۱۳۰,۸۱۰,۱۲۴	۲۴,۱۶۲,۰۲۳,۸۲۰	۲۱۵,۰۰۰
۱۳,۲۹۶,۸۱۶,۳۷۶	۲۵۲,۹۱۸,۰۰۰	۳۶,۹۸۷,۸۰۰,۳۶۰	۴۸,۰۵۵,۳۶۴	۲۵۲,۹۱۸,۰۰۰	۵۰,۵۸۵,۶۰۰,۰۰۰	۲۵۶,۰۰۰
(۴,۷۰۲,۸۵۱,۵۱۳)	۱۰۵,۳۰۰,۰۰۰	۲۵,۶۷۷,۵۴۴,۷۳۶	۲۰,۰۰۰,۶۷۷	۱۰۵,۳۰۰,۰۰۰	۲۱,۰۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۳۰۰,۰۰۰
۵۸۷,۰۵۳,۸۶۹,۷۰۰	۱۴,۱۲۵,۸۱۰,۵۸۹	۲,۳۲۱,۲۹۸,۵۵۹,۳۹۱	۲,۶۸۳,۸۵۱,۸۵۴	۱۴,۱۲۵,۸۱۰,۵۸۹	۲,۸۲۵,۱۶۲,۰۹۱,۵۳۴	۳۳۲,۳۲۸,۵۹۰

توسعه صنایع بهشتی (هلدینگ)

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشتگی کشوری

یادداشت های توضیحی صورت های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ماه ۱۳۹۹

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

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
۴۰	۲۸,۸۴۰,۶۰۹	۳۹,۹۶۷,۲۳۶	۷,۰۳۴	.	(۱,۱۳۳,۶۶۱)
۹۱,۶۰۰	۹۰,۸۶۷,۳۰۰,۰۰۰	۹۰,۸۴۴,۳۰۲,۵۴۱	۱۶,۴۶۹,۶۸۰	.	۶,۴۲۷,۷۷۹
۶,۴۰۰	۴,۸۷۰,۰۸۶,۴۰۰	۴,۸۰۷,۰۶۵,۳۰۵	۸۸۲,۷۰۱	.	۶۲,۱۳۸,۳۹۴
۳۳,۵۸۷	۳۳,۵۸۷,۰۰۰,۰۰۰	۳۳,۰۱۰,۲۵۳,۶۳۱	.	.	۵۷۶,۷۴۶,۳۶۹
۲۷,۱۷۹	۲۳,۲۷۸,۶۴۱,۳۸۸	۲۲,۵۰۸,۲۹۰,۸۸۶	۴,۲۱۹,۲۴۸	.	۷۶۶,۱۳۱,۲۵۴
۱,۰۸۰	۹۶۷,۶۸۲,۱۶۰	۹۴۲,۹۷۴,۱۵۸	۱۷۵,۳۹۱	.	۲۴,۵۳۲,۶۱۱
۱۲۱	۱۰۲,۱۹۰,۹۱۳	۹۸,۷۵۲,۶۸۴	۱۸,۵۲۰	.	۲,۴۱۹,۷۰۹
۳,۳۱۰	۲,۸۳۲,۸۳۷,۰۲۰	۲,۷۳۲,۵۳۸,۸۷۷	۵۱۲,۴۵۰	.	۹۹,۷۸۴,۶۹۳
۴,۳۰۰	۳,۸۳۶,۳۰۱,۶۷۸	۳,۷۲۸,۵۶۰,۶۶۳	۶۹۵,۳۲۶	.	۱۰۷,۰۶۵,۶۳۹
۶۰۰	۵۲۷,۰۱۷,۳۰۰	۵۱۲,۴۹۲,۸۷۲	۹۵,۵۲۰	.	۱۴,۴۲۸,۸۰۸
	۱۶۰,۹۰۷,۷۹۷,۳۱۸	۱۵۹,۲۲۵,۱۹۸,۸۵۳	۲۳,۰۷۶,۸۷۰	.	۳,۷۲۶,۳۹۰,۲۱۶
					۵,۳۸۵,۸۱۱,۸۱۱

ص مرحله خودرو ۴۱۲-۳ ماهه ۷/۸٪
مشارکت دولتی ۹ شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹
استان خزانه ۳۱ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۱۰۲۱۹
استان خزانه ۲ بودجه ۹۷-۹۸ ۹۹۰۷۲۱
استان خزانه ۱ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۰۷۱۹۹
استان خزانه ۱۶ بودجه ۹۷-۹۸ ۰۰۰۴۰۷
استان خزانه ۱۷ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۰۰۸۱۷
استان خزانه ۱۸ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۰۰۷۲۸
استان خزانه ۱۹ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۰۰۴۲۱
استان خزانه ۲۰ بودجه ۹۸-۹۹ ۰۰۰۵۱۹
اوراق گواهی سپرده بانکی بانک آینده

۱۶- زیان تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار

یادداشت	دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰	ریال
۱۶-۱	(۹۹۲۷۰۷۷۸۹,۱۴۰)	
۱۶-۲	۶۱۴,۸۴۲,۷۸۷	
	(۹۹۲۰۹۲,۹۴۶,۸۵۳)	

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

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

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

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹/۱۰/۳۰					
تعداد	ارزش بازار یا قیمت تعدیل شده	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
توسعه و عمران امید	۱۱,۵۸۹,۴۷۴	۲۱,۹۰۴,۱۰۵,۸۶۰	۲۰,۳۰۰,۴۰۰,۸۰۳	۲۰,۸۰۸,۹۰۱	۱,۴۷۳,۳۷۵,۶۲۷
ملی صنایع مس ایران	۱۷,۹۰۹,۲۷۰	۱۸۴,۲۸۶,۳۸۸,۳۰۰	۲۲۹,۲۳۷,۹۷۴,۳۱۰	۱۷۵,۰۷۲,۰۶۹	(۴۶,۰۴۸,۰۸۹,۹۲۱)
داروسازی جابرین حیان	۳۲۶,۸۲۲	۶,۷۹۴,۶۲۹,۳۸۰	۶,۷۳۷,۱۰۵,۰۸۵	۶,۴۵۴,۸۹۸	۱۷,۰۹۶,۲۵۰
مدیریت سرمایه گذاری کوثر بهمن	۶۰,۰۰۰	۱۰,۷۴۳,۰۰۰,۰۰۰	۸۶۹,۷۹۶,۹۱۴	۱,۰۲۰,۵۸۵	۱۹۸,۱۱۱,۰۰۱
سرمایه گذاری ملی ایران	۱,۸۶۰,۰۰۰	۲۳,۳۹۸,۸۰۰,۰۰۰	۲۹,۸۹۹,۱۲۰,۵۲۴	۲۲,۲۲۸,۸۶۰	(۶,۶۳۹,۷۴۳,۳۸۴)
سرمایه گذاری خوارزمی	۱۸,۷۰۸,۹۹۶	۱۶۶,۸۸۴,۲۴۴,۳۲۰	۱۹۱,۳۵۶,۷۷۶,۷۴۵	۱۵۸,۵۴۰,۰۳۲	(۲۵,۴۶۵,۴۹۳,۶۷۹)
سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی	۵,۷۵۰,۰۰۰	۷۰,۳۸۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۶,۱۵۳,۵۳۸,۷۲۳	۶۶,۸۶۱,۰۰۰	(۳۶,۱۹۲,۲۹۹,۷۲۳)
سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)	۴,۷۲۹,۴۶۰	۴۶,۵۳۷,۸۸۶,۴۰۰	۷۵,۱۸۴,۷۷۳,۳۶۶	۴۴,۲۱۰,۹۹۲	(۲۸,۹۲۳,۷۸۷,۲۹۰)
بانک ملت	۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۴,۷۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۹,۱۳۷,۷۴۲,۸۴۱	۱۴,۰۲۲,۰۰۰	(۴,۴۶۵,۵۶۴,۸۴۱)
بانک پارسیان	۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۳۸,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۱۳,۲۹۸,۲۹۷,۷۸۳	۱۳۱,۱۰۰,۰۰۰	(۷۶,۱۱۹,۳۹۷,۷۸۳)
معدنی و صنعتی گل گهر	۹,۷۴۰,۰۰۰	۱۵۴,۷۶۸,۶۰۰,۰۰۰	۱۸۳,۹۵۵,۳۵۵,۸۳۷	۱۴۷,۰۳۰,۱۷۰	(۳۰,۱۰۷,۶۲۹,۰۰۷)
فولاد خوزستان	۵۵,۱۲۰,۱۸۸	۶۹,۹۴۹,۶۶۵,۷۲۰	۹۹,۹۸۹,۷۰۰,۰۰۴	۶۶,۴۵۲,۱۸۲	(۳۰,۴۵۶,۲۳۴,۷۹۵)
فولاد مبارکه اصفهان	۱۶,۶۴۰,۱۰۵	۱۷۱,۳۹۳,۰۸۱,۵۰۰	۲۳۲,۹۱۶,۵۵۰,۹۶۳	۱۶۲,۸۲۳,۴۲۷	(۶۲,۵۴۳,۲۵۸,۲۹۸)
فولاد کاوه جنوب کیش	۱۲,۶۰۰,۰۰۰	۲۱۳,۵۷۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۴۹,۳۰۳,۴۹۰,۴۹۵	۲۰۲,۸۹۱,۵۰۰	(۳۷,۰۰۴,۲۳۱,۹۹۵)
سپیدار سیستم آسیا	۵۶۸,۴۲۵	۲۶,۳۱۰,۱۱۹,۵۵۰	۲۲,۶۴۳,۸۵۶,۹۶۸	۲۴,۹۹۴,۶۱۴	۳,۵۰۹,۷۱۷,۳۷۰
کشتیرانی جمهوری اسلامی ایران	۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۲۸۵,۱۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۶۱,۳۳۵,۶۸۱,۶۰۰	۲۷۰,۸۹۲,۵۰۰	(۷۷,۸۸۲,۳۲۴,۱۰۰)
توسعه معادن و فلزات	۱۸,۲۵۰,۰۰۰	۱۸۹,۲۵۲,۵۰۰,۰۰۰	۲۷۱,۸۹۱,۹۰۳,۰۹۲	۱۷۹,۷۸۹,۸۷۵	(۸۳,۷۶۵,۴۵۵,۴۶۷)
پتروشیمی زاگرس	۱۷۶,۸۴۷	۳۲۰,۳۳۵,۱۹۲	۲۷,۱۶۸,۵۹۰,۵۵۹	۳۰,۴۳۱,۶۹۰	۴,۶۷۴,۱۶۹,۱۵۲
پتروشیمی بوعلی سینا	۲,۶۸۳,۸۲۰	۱۱۸,۸۲۹,۵۴۹,۶۰۰	۱۱۱,۲۸۴,۳۴۵,۰۸۱	۱۱۲,۸۹۷,۵۷۲	۶,۸۴۸,۱۰۹,۱۹۹
س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین	۱۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۴۸,۵۴۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۰۰,۰۹۱,۰۱۰,۷۳۶	۱۴۱,۱۱۳,۰۰۰	(۱۵۲,۳۳۴,۸۲۳,۷۳۶)
پتروشیمی شازند	۵۵۰,۰۰۰	۱۱۰,۳۸۵,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۰,۱۷,۲۷۷,۷۱۲	۱۰۴,۸۶۵,۷۵۰	(۲۸۹,۰۶۸,۴۶۲)
پتروشیمی خارک	۳,۷۴۰,۸۹۴	۱۴۸,۸۱۲,۷۶۳,۳۲۰	۱۳۸,۶۷۸,۲۱۱,۲۷۸	۱۴۱,۳۷۲,۱۲۵	۹,۲۴۹,۱۱۶,۱۰۰
پتروشیمی جم	۴,۳۰۰,۰۰۰	۱۷۳,۰۳۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۶۵,۸۸۹,۲۲۹,۳۰۳	۱۶۴,۳۸۰,۴۰۰	۶,۱۱۳,۲۳۰,۲۹۷
پالایش نفت اصفهان	۱۰,۶۳۵,۲۹۴	۹۹,۲۲۷,۲۹۳,۰۲۰	۱۹۸,۲۴۶,۸۶۲,۳۲۰	۹۴,۲۶۵,۹۲۸	(۹۹,۶۰۹,۹۷۱,۶۹۳)
پتروشیمی پردیس	۱۰,۷۵۰,۹۲۰	۹۳,۰۸۸,۵۹۸,۴۰۰	۱۱۲,۷۰۶,۸۳۶,۱۱۳	۸۸,۴۳۴,۱۶۸	(۲۰,۱۷۲,۱۱۴,۸۷۳)
سرمایه گذاری سیمان تأمین	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۵,۷۵۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۸۵۸,۷۶۳,۵۵۲	۴۳,۴۶۲,۵۰۰	(۵,۳۸۰,۹۷۶,۰۵۲)
بین المللی ساروج بوشهر	۹۰۰,۰۰۰	۲۱,۸۱۶,۰۰۰,۰۰۰	۲۰,۸۶۰,۸۹۳,۷۸۷	۲۰,۷۲۵,۲۰۰	۸۲۵,۳۰۱,۰۱۳
صنعتی مینو	۵۰,۳۶,۳۷۳	۴۱۵,۴۰۰,۰۴۵,۰۴۰	۳۳۳,۳۳۶,۰۵۱,۰۵۵	۳۹۴,۶۳۰,۰۴۳	۷۹,۵۹۲,۳۶۳,۷۱۷
توسعه صنایع بهشهر (هلدینگ)	۴,۷۱۲,۸۷۱	۶۳,۶۷۰,۸۸۷,۲۱۰	۹۲,۹۴۳,۴۱۶,۲۵۰	۶۰,۴۸۷,۳۴۳	(۲۹,۶۵۱,۳۷۰,۸۱۹)
شوگو پارس	۲۶۰,۶۴۳	۱۲,۲۷۸,۱۰۹,۸۰۱	۱۱,۶۳۴,۸۰۳,۳۰۲	۱۱,۶۶۴,۲۰۴	۵۷۰,۲۵۱,۷۴۶
پارس مینو	۱۱,۴۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۶۶۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۶,۶۹۱,۳۱۲,۶۲۳	۹۵,۶۲۸,۹۰۰	(۱۶,۶۲۸,۲۵۱,۵۲۳)
شرکت صنایع غذایی مینو شرق	۶,۴۱۳,۸۷۷	۱۰۸,۰۷۳,۸۲۷,۴۵۰	۱۱۴,۱۹۲,۰۹۳,۶۰۸	۱۰۲,۶۷۰,۱۳۶	(۶,۷۶۱,۳۰۵,۴۳۱)
اقتصادی و خودکفایی آزادگان	۳۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۳,۴۲۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۱۹,۹۸۰,۴۴۳,۲۱۹	۹۸,۲۵۰,۹۰۰	(۱۷,۱۷۳,۸۰۴,۱۱۹)
قاسم ایران	۱۷,۰۲۰,۶۲۰	۲۷۸,۸۸۲,۸۵۸,۷۰۰	۲۸۹,۲۸۶,۹۳۹,۲۰۳	۲۶۴,۹۳۸,۷۱۶	(۱۲,۰۶۳,۴۳۳,۵۱۳)
	۲۸۷,۱۰۱,۸۹۹	۳,۸۵۸,۳۲۸,۶۱۱,۷۶۳	۴,۶۲۸,۰۷۹,۳۴۵,۶۵۴	۳,۶۶۵,۴۱۲,۱۸۰	(۷۹۲,۷۰۷,۷۸۹,۱۴۰)
				۱۹,۲۹۱,۶۴۳,۰۶۱	

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

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

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت	مالیات	کاربرد	ارزش دفتری	ارزش بازار یا قیمت تعدیل شده	تعداد	تاریخ تشکیل	نام شرکت
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	
۵۳۴۶۳۸,۱۸۴	۰	۳,۱۲۰,۰۳۴	۱۶,۶۷۶,۲۲۵,۱۰	۱۷,۱۲۹,۸۳۲,۲۷۸	۲۰۸۰۳	۱۳۹۹/۰۹/۲۵	اوراق سلف موازی ورق گرم فولاد
(۳۲۲,۱۲۷,۶۴۶)	۰	۱۰,۶۰۶,۲۵۲	۵۸,۹۲۸,۷۷۱,۳۹۴	۵۸,۵۱۷,۲۵۰,۰۰۰	۶۱,۵۰۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	مشارکت دولتی ۱۰ شرایط
۵۰۲,۳۳۱,۷۵۰	۰	۸,۸۸۱,۲۵۰	۴۸,۴۸۸,۷۸۷,۰۰۰	۴۹,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۵۰,۰۰۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	مراجعه عام دولت ۴ ش.خ. ۰۰۰۸
۶۱۴,۸۴۲,۲۸۷	۰	۲۲,۶۰۷,۵۲۶	۱۲۴,۰۹۳,۷۸۳,۴۰۴	۱۲۴,۰۹۳,۲۳۲,۲۲۸	۱۳۲,۲۰۳	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	

۱۷- سود سهام

خالص درآمد سود سهام	هزینه توزیع	جمع درآمد سود سهام	سود متعلق به هر سهم	تعداد سهام متعلقه در زمان مجمع	تاریخ تشکیل مجمع	نام شرکت
ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال	
۶,۴۰۳,۹۱۷,۱۲۲	(۹۱۲,۳۳۸,۸۷۸)	۷,۳۱۶,۲۵۶,۰۰۰	۶,۸۰۰	۱,۰۷۵,۹۲۰	۱۳۹۹/۰۹/۲۵	پتروشیمی پردیس
۴۳۰,۴۷۷,۹۶۴	(۴۴,۵۲۲,۰۲۶)	۴۷۵,۰۰۰,۰۰۰	۵۰	۹,۵۰۰,۰۰۰	۱۳۹۹/۰۷/۲۹	سرمایه گذاری خوارزمی
۶,۸۳۴,۳۹۵,۰۸۶	(۹۵۶,۸۶۰,۹۱۲)	۷,۷۹۱,۲۵۶,۰۰۰				

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

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹/۱۰/۳۰	یادداشت	سود اوراق مشارکت
ریال		
۲,۹۵۷,۳۲۵,۲۲۱	۱۸-۱	سود اوراق مشارکت
۲,۸۱۸,۸۰۳,۳۸۱	۱۸-۱	سود اوراق مرابحه
۱۵,۸۰۵,۶۱۱,۸۶۴	۱۸-۲	سود سیرده و گواهی سیرده بانکی
۲۳,۵۸۱,۷۴۰,۴۶۶		

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری

یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی

دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

تاریخ سرمایه گذاری	تاریخ سررسید	مبلغ اسمی	نرخ سود	سود	هزینه تنزیل	خالص سود اوراق
ریال	ریال	درصد	ریال	ریال	ریال	ریال
۱۴۰۰/۱۱/۲۶	۱۳۹۹/۹/۰۹	۲۶.۵۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۵	۱.۴۰۴.۴۸۲.۶۹۸	۰	۱.۴۰۴.۴۸۲.۶۹۸
		۹۱.۶۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۵	۲.۵۵۲.۸۴۲.۵۲۳	۰	۲.۵۵۲.۸۴۲.۵۲۳
				۲.۹۵۷.۳۲۵.۲۲۱	۰	۲.۹۵۷.۳۲۵.۲۲۱
۱۴۰۰/۱۰/۰۴	۱۴۰۰/۱۱/۰۵	۵۰.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۵	۲.۸۱۷.۵۰۳.۴۱۶	۰	۲.۸۱۷.۵۰۳.۴۱۶
		۴۰.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۸	۱.۳۹۹.۹۶۵	۰	۱.۳۹۹.۹۶۵
				۲.۸۱۸.۸۰۳.۳۸۱	۰	۲.۸۱۸.۸۰۳.۳۸۱

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

تاریخ سرمایه گذاری	تاریخ سررسید	مبلغ اسمی	نرخ سود	سود	هزینه تنزیل	هزینه برگشت سود	سود خالص
ریال	ریال	درصد	ریال	ریال	ریال	ریال	ریال
۱۳۹۹/۰۴/۲۹	۱۳۹۹/۰۶/۲۹	۰	۰	۱.۶۸۱.۹۸۰.۹۸۳	۰	۰	۱.۶۸۱.۹۸۰.۹۸۳
		۰	۰	۷.۱۴۰.۷۶۲	۰	۰	۷.۱۴۰.۷۶۲
۱۳۹۹/۰۶/۲۹	۱۳۹۹/۰۶/۲۹	۰	۱۸	۲.۳۸۹.۲۳۸.۱۹۵	۰	۰	۲.۳۸۹.۲۳۸.۱۹۵
		۰	۰	۲۱.۹۰۲.۶۶۰	۰	۰	۲۱.۹۰۲.۶۶۰
۱۳۹۹/۰۷/۰۱	۱۳۹۹/۰۷/۰۱	۰	۱۸	۲.۶۶۳.۰۱۳.۶۹۸	۰	۰	۲.۶۶۳.۰۱۳.۶۹۸
		۰	۰	۱۹.۳۷۴.۴۳۲	۰	۰	۱۹.۳۷۴.۴۳۲
۱۳۹۹/۰۷/۰۶	۱۳۹۹/۰۷/۰۶	۰	۰	۶.۷۸۲.۶۶۰.۷۳۰	۰	۰	۶.۷۸۲.۶۶۰.۷۳۰

سپرده بانکی:

سپرده کوتاه مدت ۲۳۹.۸۱۰.۱۴۳.۱۷۵۷.۱ بانک پارسا کد
سپرده کوتاه مدت ۰۲.۳۵۸۵۲۵۴۰.۶ بانک آینده
سپرده بلند مدت ۰۴.۱۵۰۷۰۰۹۰۰۷ بانک آینده
سپرده کوتاه مدت ۷۰۰.۸۴۶.۶۷۲۱۵ بانک شهر
سپرده بلند مدت ۷۰۰.۸۴۶.۱۳۲۹۵ بانک شهر
سپرده کوتاه مدت ۰۲۱.۶۳۲.۸۰۴۰۰ بانک صادرات

گواهی سپرده بانکی:

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

۲.۳۶۰.۶۵۵.۹۴۵	۰	۲.۳۶۰.۶۵۵.۹۴۵	۱۶	۱.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۴۰۰/۰۷/۰۷	۱۳۹۹/۰۷/۰۷
۶.۶۶۲.۲۹۵.۱۸۹	(۴.۵۲۳.۴۹۷.۲۴۷)	۱۱.۱۸۵.۷۹۲.۴۴۶	۲۰	۱.۰۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۱۴۰۰/۰۷/۲۳	۱۳۹۹/۰۷/۲۳
۹.۰۲۲.۹۵۱.۱۳۴	(۴.۵۲۳.۴۹۷.۲۴۷)	۱۳.۵۴۶.۴۴۸.۳۸۱				
۱۵.۸۰۵۶۱۱.۸۶۴	(۴.۵۲۳.۴۹۷.۲۴۷)	۲۰.۳۲۹.۱۰۹.۱۱۱				
		۱۸				

۱۸-۱- سود اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق رهنی

اوراق مشارکت پورسی:

مشارکت دولتی ۱۰- شرایط خاص ۲۲۶
مشارکت دولتی ۹- شرایط خاص ۹۹۰۹۰۹

اوراق مرابحه:

ص مرابحه عام دولت ۴
ص مرابحه خودرو ۴۱۲- ۳ ماهه ۱/۱۸

۱۸-۲- سود سپرده و گواهی سپرده بانکی

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

۱۹- سایر درآمدها

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

ریال
۲,۰۵۱,۱۲۷,۲۴۶
۲,۰۵۱,۱۲۷,۲۴۶

تعدیل کارمزد کارگزاری

۲۰- هزینه‌های کارمزد ارکان

هزینه‌های کارمزد ارکان به شرح زیر می‌باشد:

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

ریال
۶,۴۳۰,۷۹۹,۴۳۷
۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰
۱۶۲,۸۵۶,۷۲۱
۱,۲۴۷,۵۷۶,۶۱۹
۸,۰۹۱,۲۳۲,۷۷۷

مدیر صندوق

متولی صندوق

حسابرس

بازارگردان

۲۱- سایر هزینه‌ها

دوره ۶ ماه و ۴ روز منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰

ریال
۶۰,۰۰۰,۰۰۰
۲۰,۰۰۰,۰۰۰
۶۰,۰۰۰,۰۰۰
۳۱۲,۷۰۴,۸۵۰
۱,۶۷۴,۲۰۰
۶۴۰,۴۰۵,۲۰۷
۱,۰۹۴,۷۸۴,۲۵۷

حق پذیرش و عضویت در کانون‌ها

سایر هزینه‌ها

هزینه خدمات سپرده گذاری و نگهداری واحده

هزینه آبونمان نرم افزار

هزینه کارمزد بانکی

هزینه تصفیه

۲۲- تعهدات و بدهی‌های احتمالی

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

صندوق مدیریت ثروت صندوق بازنشستگی کشوری
یادداشت‌های توضیحی صورت‌های مالی
دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۳۰ دی ۱۳۹۹

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

اشخاص وابسته	نام	دوره ۶ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۳۹۹/۱۰/۳۰	
		نوع واحدهای سرمایه گذاری	تعداد واحدهای سرمایه گذاری
مدیر و اشخاص وابسته به وی	مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	ممتاز	۱,۰۰۰,۰۰۰
اشخاص وابسته به متولی	موسسه حسابرسی فراز مشاور دلیلی پور	عادی	۰
کارگزار و اشخاص وابسته به وی	صبا جهاد	۰	۰
مدیر سرمایه گذاری و اشخاص	سمیرا سلیمانی	عادی	۴۰,۰۰۰
مدیر سرمایه گذاری و اشخاص	معمومه میرمحمدی	عادی	۴۰,۰۰۰
مدیر سرمایه گذاری و اشخاص	حسین عبدی	عادی	۴۰,۰۰۰
جمع			۱,۱۲۰,۰۰۰

۲۴- معاملات با ارکان و اشخاص وابسته به آن‌ها

طرف معامله	نوع وابستگی	شرح معامله	
		ارزش معامله	مانده طلب (بدهی) - ریال
صبا جهاد	کارگزار مدیر صندوق	۲۲,۸۹۴,۱۶۶,۵۰۶,۵۷۶	(۱۷۹,۶۲۷,۷۶۲,۸۲۶)
مشاور سرمایه گذاری فراز ایده نوآفرین تک (فاین تک)	مدیر صندوق	۴,۹۱۷,۹۰۵,۱۵۱	(۴,۹۱۷,۹۰۵,۱۵۱)
صندوق اختصاصی بازارگردانی ارزش آفرین صندوق بازنشستگی کشوری	بازارگردان صندوق	۱۶۲,۸۵۶,۷۲۱	(۹۶۳,۳۴۰,۵۲۵)
موسسه حسابرسی فراز مشاور دلیلی پور	متولی	۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰	(۲۵۰,۰۰۰,۰۰۰)
موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهبین	حسابرس	۱۶۲,۸۵۶,۷۲۱	۱۶۲,۸۵۶,۷۲۱

۲۵- رویدادهای بعد از تاریخ ترازنامه

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