

# گزارش عملکرد

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی

افتخار حافظ

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

« ثبت شده به شماره ۱۱۲۸۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

# به نام خدا

## معرفی «صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ»

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ در تاریخ ۱۳۹۳/۰۶/۱۷ تحت شماره ۱۱۲۸۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده و مجوز فعالیت صندوق در تاریخ ۱۳۹۳/۰۶/۱۹ صادر شده است. همچنین، صندوق در تاریخ ۱۳۹۳/۰۶/۱۲ تحت شماره ۳۴۵۳۷ نزد مرجع ثبت شرکت ها به ثبت رسیده است. لازم به ذکر است طی مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار، از تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۰۱ نوع صندوق از در سهام به بازارگردانی تغییر یافت. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، ۳ سال است.

لازم به ذکر است مجوز فعالیت صندوق طی نامه شماره ۱۲۲/۳۷۴۹۲ مورخ ۱۳۹۷/۰۵/۰۳ سازمان بورس و اوراق بهادار، تا تاریخ ۱۳۹۷/۰۵/۳۱ تمدید گردید. هم‌چنین مجدداً مجوز فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۱۱ طی صورتجلسه مجمع مورخ ۱۳۹۷/۰۵/۳۰ از سازمان بورس و اوراق بهادار اخذ گردید. به استحضار می‌رساند مجوز فعالیت صندوق مطابق مصوبات مجمع تاریخ ۱۳۹۷/۱۲/۰۷ از سوی سازمان بورس و اوراق بهادار تا تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۱۱ تمدید گردید.

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ مطابق با مفاد اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس <http://ehafezfund.com> درج گردیده است. ارکان آن نیز مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

مدیر	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری هدف حافظ
متولی	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری آرمان آتی
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مالی آزموده کاران

## عملیات اجرایی دوره

طی دوره مالی موردگزارش از تاریخ ۱۳۹۸/۰۳/۰۱ تا ۱۳۹۹/۰۲/۳۱، درخواست صدور و ابطال از طریق مدیر ثبت صندوق در سیستم عملیاتی صندوق ثبت گردیده است که تعداد واحدهای صادر و ابطال شده به ترتیب برابر ۵۵،۷۱۳ واحد و ۴۴۰ واحد بوده است که در نتیجه آن تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در پایان دوره ۱۰۹،۷۶۸ واحد می باشد.

## ترکیب سرمایه گذاران

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۳۱ به شرح زیر است:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک
۱	شرکت کارگزاری حافظ (سهامی خاص)	۱۰،۰۰۰
۲	توسعه مدیریت آرین	۵،۰۰۰
۳	شرکت سرمایه گذاری ایران	۱۷،۴۰۰
۴	شرکت مشاور سرمایه گذاری هدف حافظ	۲،۶۰۰
۵	جمع کل	۳۵،۰۰۰

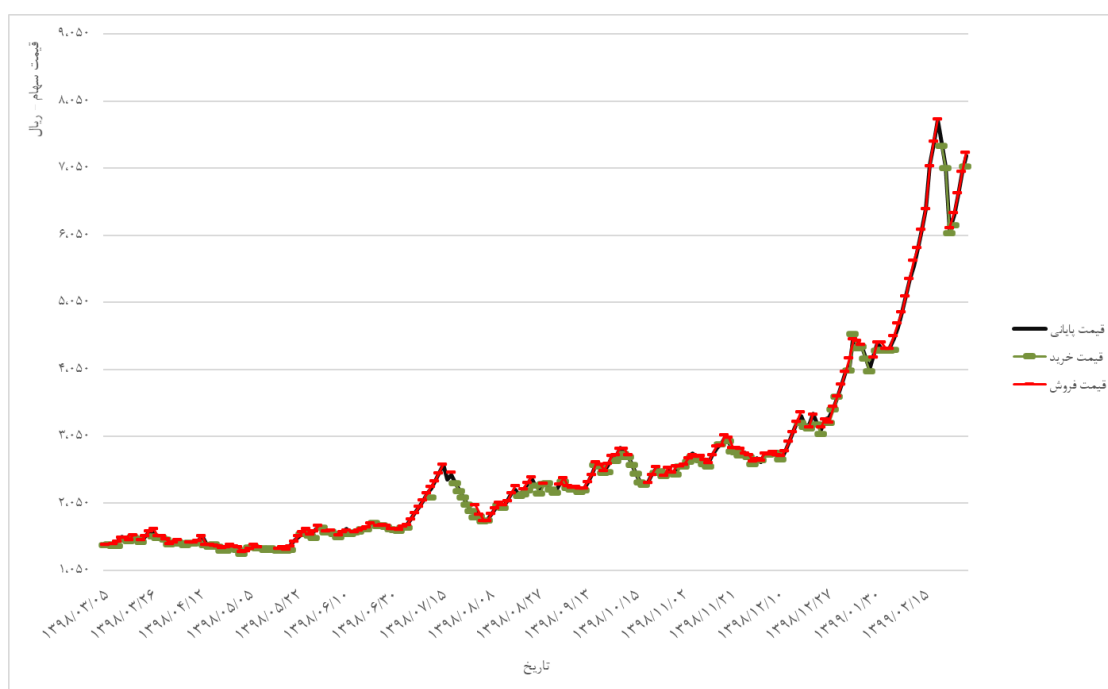
آخرین ترکیب سرمایه‌گذاران به تفکیک حقیقی و حقوقی در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۳۱ به شرح زیر می باشد:

ترکیب سرمایه گذاران	تعداد سرمایه‌گذاران	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	درصد سرمایه‌گذاری
سرمایه‌گذاران حقوقی	۷	۱۰۹،۷۶۸	۱۰۰
جمع	۷	۱۰۹،۷۶۸	۱۰۰

# عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در نماد ونیرو از ابتدای ۱۳۹۸/۰۳/۰۱ الی ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

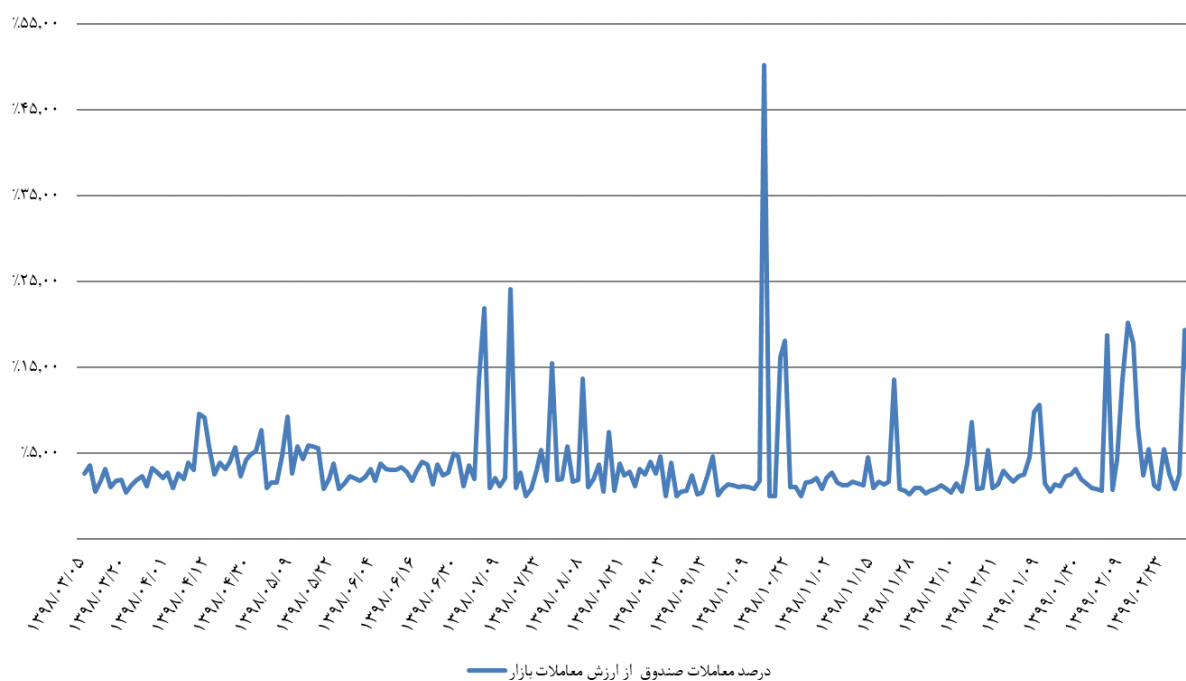


## روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با قیمت پایانی سهم



## نمودار درصد مشارکت در بازار توسط صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در نماد ونیرو

### درصد مشارکت صندوق در ارزش معاملات بازار



## مقایسه اطلاعات معاملاتی بازار و صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

درصد از بازار	صندوق	بازار	
۹۷.۶۷٪	۲۱۰	۲۱۵	تعداد روز معاملاتی
۱.۹۱٪	۲۱۹,۵۴۷,۹۵۷	۱۱,۴۶۹,۵۰۷,۲۵۲	کل حجم معامله سهام طی دوره
۱.۹۶٪	۱,۰۴۵,۴۶۶	۵۳,۳۴۶,۵۴۵	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره

۱۹,۸۰۹,۵۷۴	تعداد تملک سهام ونیرو از ابتدای دوره - ۱۳۹۸/۰۳/۰۱
۵,۱۳۹,۶۵۱	تعداد تملک سهام ونیرو در انتهای دوره - ۱۳۹۹/۰۲/۳۱
۶.۵۲٪	متوسط روزانه معاملات صندوق نسبت به کل سهام صندوق

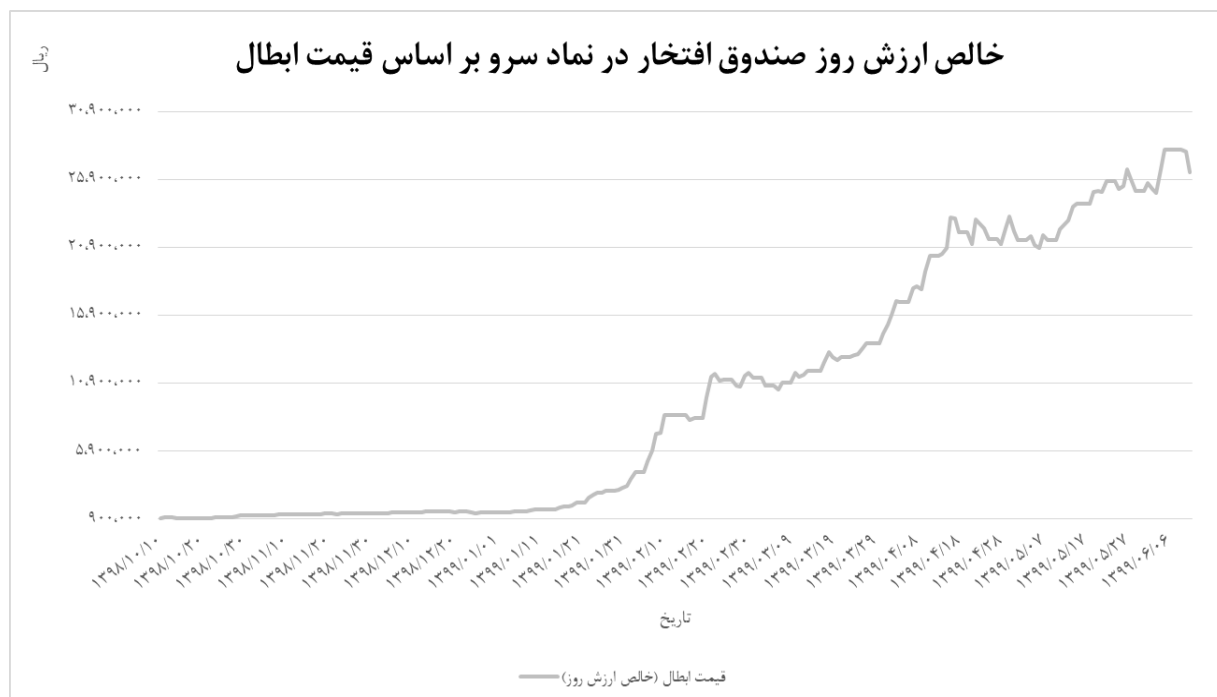
### گزارش خرید و فروش سهام ونیرو در صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

از تاریخ: ۱۳۹۸/۰۳/۰۱ الی ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

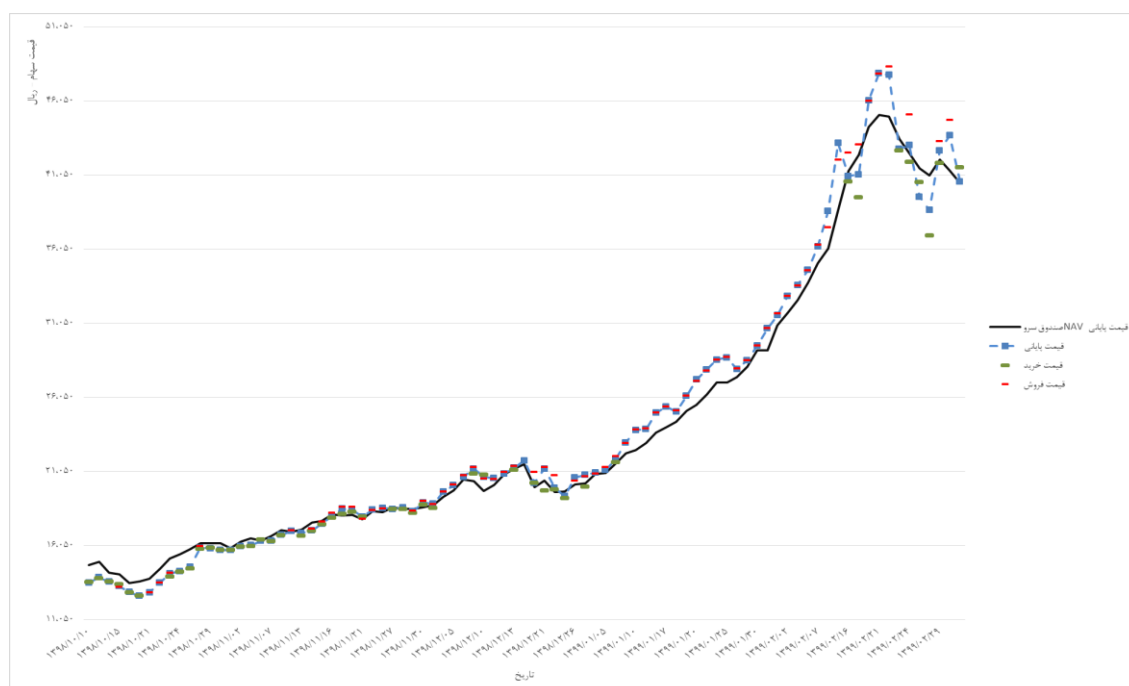
تاریخ تهیه گزارش: ۱۳۹۹/۰۵/۲۶

ارزش کل	تعداد		
۲۵,۵۵۴,۳۵۰,۴۶۰	۱۹,۸۰۹,۵۷۴	ونیرو	ابتدای دوره
۲۶۷,۷۷۵,۱۵۹,۹۳۴	۱۰۴,۴۸۲,۸۴۳	خرید در طی دوره	طی دوره
۳۸۲,۴۷۲,۲۹۸,۷۶۸	۱۲۳,۷۲۹,۸۳۱	فروش در طی دوره	
۴,۵۷۷,۰۶۵,۰۰۰	۴,۵۷۷,۰۶۵	شرکت در افزایش سرمایه	
۳۷,۲۱۶,۲۱۲,۸۹۱	۵,۱۳۹,۶۵۱	ونیرو	انتهای دوره
۱۵,۶۴۶,۱۴۳,۳۱۳	۲,۵۰۶,۹۹۳	ونیروح	
۱۴۷,۶۳۷,۴۴۴,۷۸۷	.	دارایی نقد دارای اوراق با درآمد ثابت	

## عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در نماد سرو در سال مالی ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

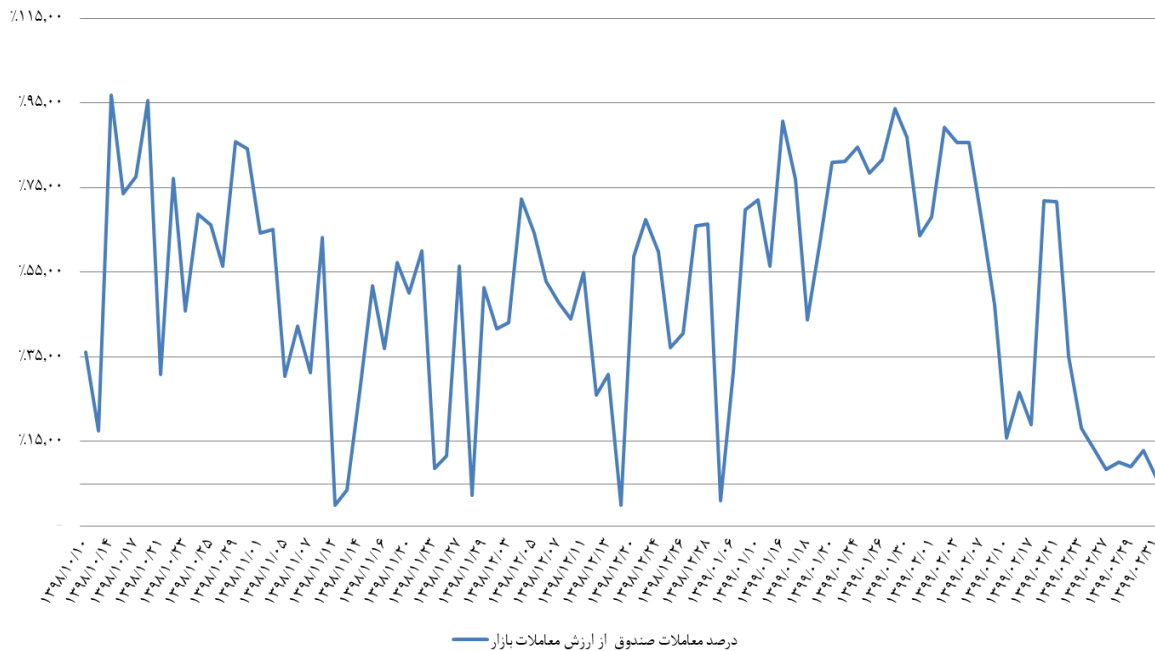


## روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با Nav صندوق سرو



## نمودار درصد مشارکت در بازار توسط صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در نماد سرو

درصد مشارکت صندوق در ارزش معاملات بازار

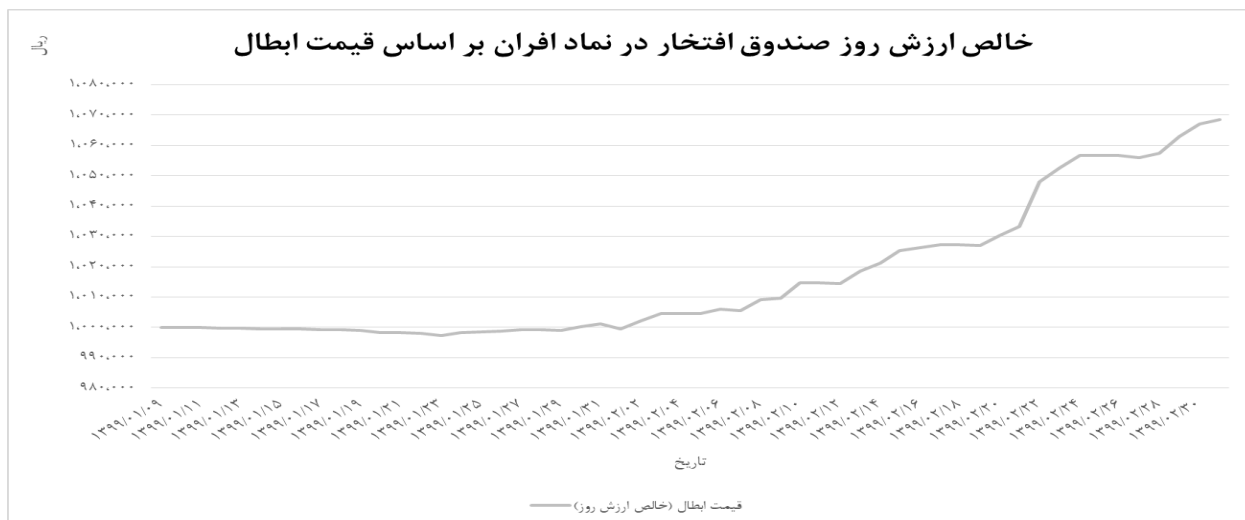


## مقایسه اطلاعات معاملاتی بازار و صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

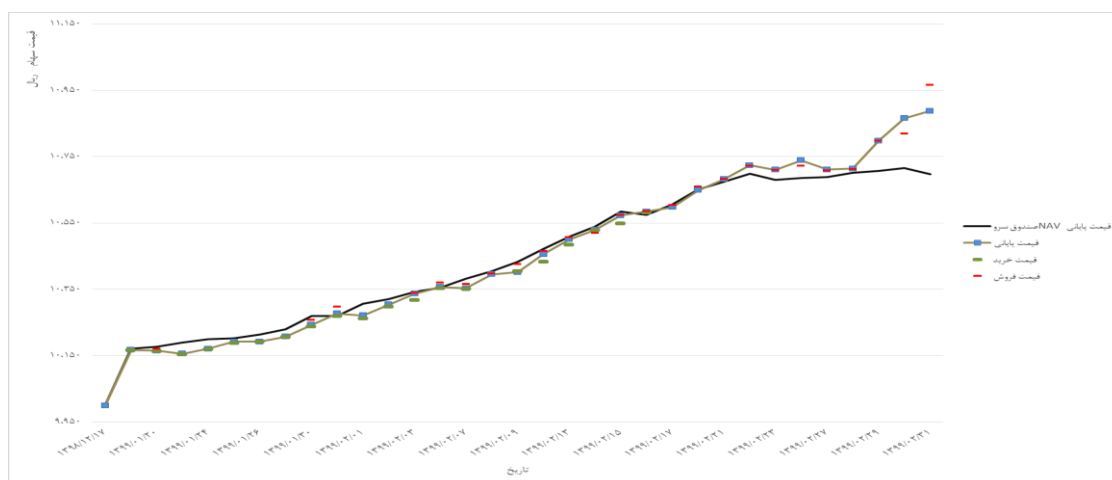
درصد از بازار	صندوق	بازار	
۹۸.۸۵٪	۸۶	۸۷	تعداد روز معاملاتی
۴۷.۹۰٪	۱۲۱,۹۷۸,۶۴۸	۲۵۴,۶۵۹,۶۴۴	کل حجم معامله سهام طی دوره
۴۸.۴۶٪	۱,۴۱۸,۳۵۶	۲,۹۲۷,۱۲۲	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره



## عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در افران در سال مالی ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

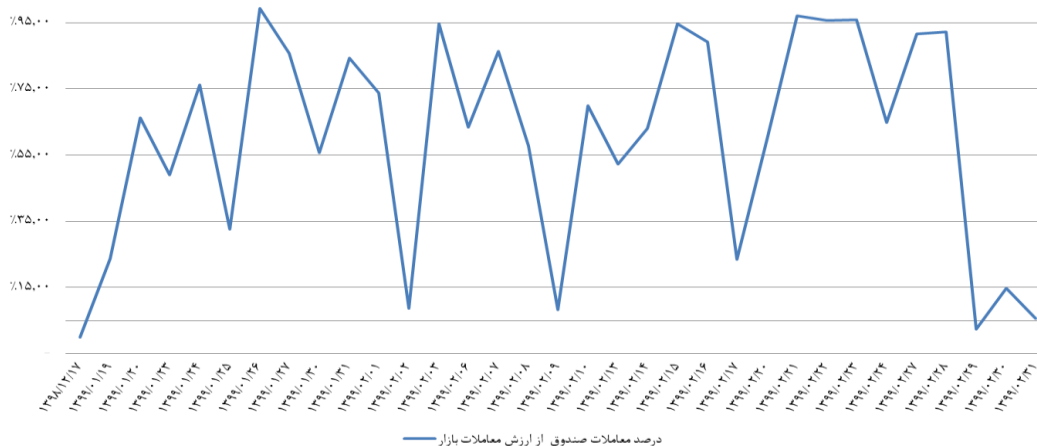


## روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با Nav صندوق افران



## نمودار درصد مشارکت در بازار توسط صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در نماد افران

درصد مشارکت صندوق در ارزش معاملات بازار



## مقایسه اطلاعات معاملاتی بازار و صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

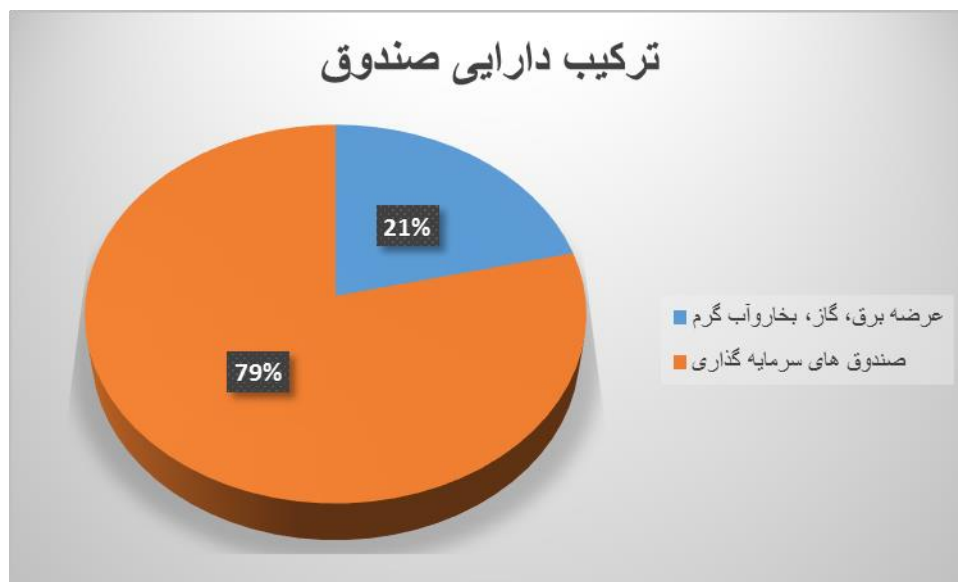
درصد از بازار	صندوق	بازار	
۹۶.۹۷٪	۳۲	۳۳	تعداد روز معاملاتی
۶۱.۸۲٪	۶۰,۸۱۳,۵۴۲	۹۸,۳۶۸,۴۱۲	کل حجم معامله سهام طی دوره
۶۳.۷۵٪	۱,۹۰۰,۴۲۳	۲,۹۸۰,۸۶۱	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره

## عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در ۳ نماد فعال طی سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱



## ترکیب صنایع صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ در تاریخ ۱۳۹۹/۰۲/۳۱

از آنجایی که اوراق بهادار تحت عملیات بازارگردانی در پرتفوی صندوق، نمادهای "نیرو"، "سرو" و "افران" می باشد لذا ترکیب دارایی صندوق به شرح نمودار ذیل ارائه می گردد:



ترکیب صنایع تحت عملیات بازارگردانی در صندوق		
صنعت	خالص ارزش فروش (ریال)	نسبت به کل دارایی ها (درصد)
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۵۲,۰۶۸,۲۶۷,۳۹۱	۱۰,۰۷
صندوق های سرمایه گذاری	۱۹۲,۸۶۶,۲۷۲,۷۸۳	۳۷,۲۹
جمع	۲۴۴,۹۳۴,۵۴۰,۱۷۴	۴۷,۳۵

### صورت های مالی

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ برای سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱ مطابق جداول ذیل می باشد:

صورت خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱	
ریال	دارایی‌ها:
۲۴۴,۹۳۴,۵۴۰,۱۷۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۲۲۵,۰۹۸,۳۹۹,۱۴۶	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی
۷,۰۰۰,۰۰۰	حسابهای دریافتی
۲۳۲,۸۸۷,۷۰۳	سایر دارایی‌ها
۲۴۸,۳۳۲,۲۱۹	موجودی نقد
۴۶,۷۵۲,۲۴۵,۸۰۴	جاری کارگزاران
۵۱۷,۲۷۳,۴۰۵,۰۴۶	جمع دارایی‌ها
بدهی‌ها:	
۱,۴۵۶,۵۵۵,۷۸۵	پرداختی به ارکان صندوق
۱,۰۴۰,۷۳۲,۸۱۹	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۲,۴۹۷,۲۸۸,۶۰۴	جمع بدهی‌ها
۵۱۴,۷۷۶,۱۱۶,۴۴۲	خالص دارایی‌ها:
۴,۶۸۹,۶۷۴	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۰۲/۳۱	
ریال	درآمدها:
۳۳۱,۳۱۷,۹۹۶,۰۷۰	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۸,۹۵۵,۴۳۰,۶۷۹	(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱,۸۹۰,۳۹۶,۷۵۰	سود سهام
۵,۵۹۰,۵۴۰,۶۶۹	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱,۶۵۶,۵۴۱,۳۴۰	سایر درآمدها
۳۵۹,۴۱۰,۹۰۵,۵۰۸	جمع درآمدها
	هزینه ها:
(۱,۷۴۳,۲۷۶,۸۶۳)	هزینه کارمزد ارکان
(۶۷۴,۶۱۷,۰۶۵)	سایر هزینه ها
(۲,۴۱۷,۸۹۳,۹۲۸)	جمع هزینه ها
۲۵۶,۹۹۳,۰۱۱,۵۸۰	سود (زیان) خالص