

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی

افتخار حافظ

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

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

به نام خدا

معرفی «صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ»

صندوق سرمایه گذاری 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. هم چنین 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 می رساند مجوز فعالیت صندوق از سوی سازمان بورس و اوراق بهادار تا تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۱۱ تمدید گردید.

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری 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 سرمایه گذاری هدف حافظ
متولی	شرکت مشاور سرمایه گذاری آرمان آتی
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مالی آزموده کاران

عملیات اجرایی دوره

طی دوره مالی موردگزارش از تاریخ ۱۳۹۹/۰۳/۰۱ تا ۱۳۹۹/۰۵/۳۱، 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 ۸۱۶,۳۷ واحد و ۱۴,۵۷۶ واحد بوده است که در نتیجه آن تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری صندوق در پایان دوره ۱۳۳,۰۰۸ واحد می باشد.

ترکیب سرمایه گذاران

دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتاز در تاریخ ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ 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 آربن	۵,۰۰۰
۳	شرکت سرمایه گذاری ایران	۱۷,۴۰۰
۴	شرکت مشاور سرمایه گذاری هدف حافظ	۲,۶۰۰
۵	جمع کل	۳۵,۰۰۰

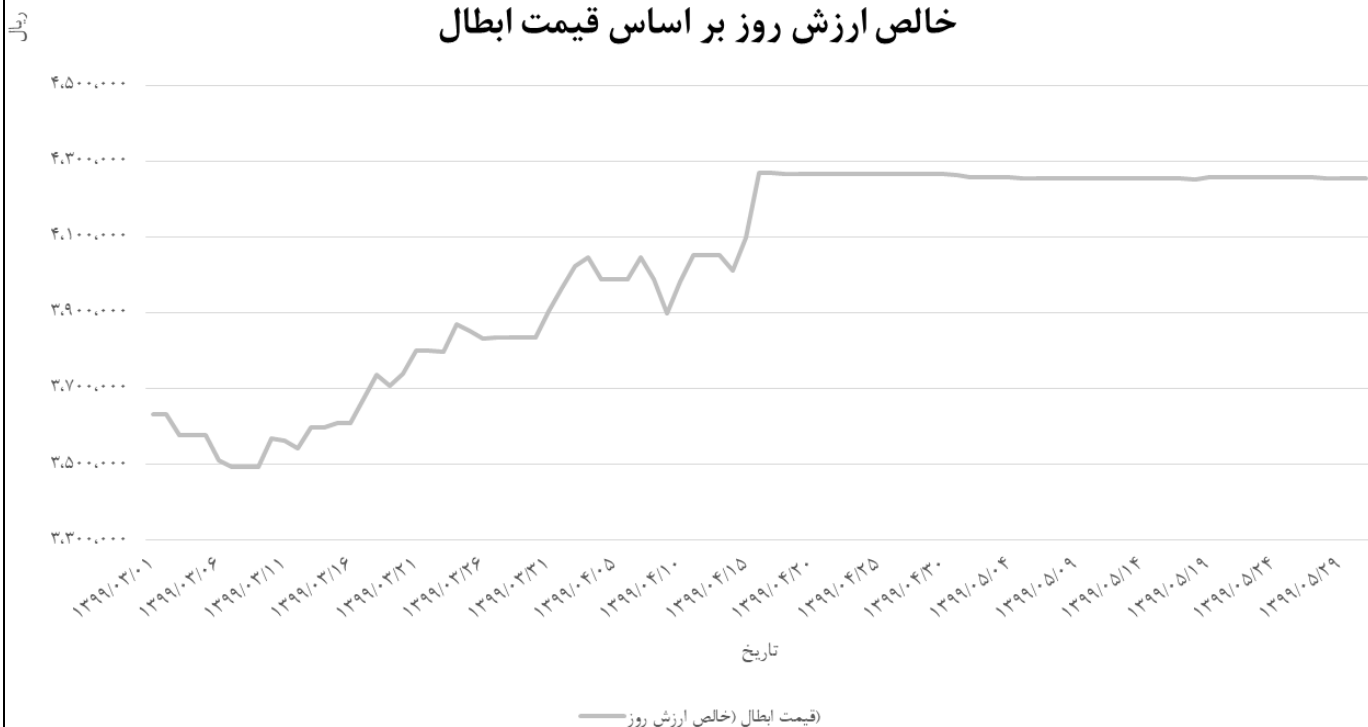
آخرین ترکیب سرمایه گذاران به تفکیک حقیقی و حقوقی در تاریخ ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ به شرح زیر می باشد:

ترکیب سرمایه گذاران	تعداد سرمایه گذاران	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	درصد سرمایه گذاری
سرمایه گذاران حقوقی	۷	۱۳۳,۰۰۸	۱۰۰
جمع	۷	۱۳۳,۰۰۸	۱۰۰

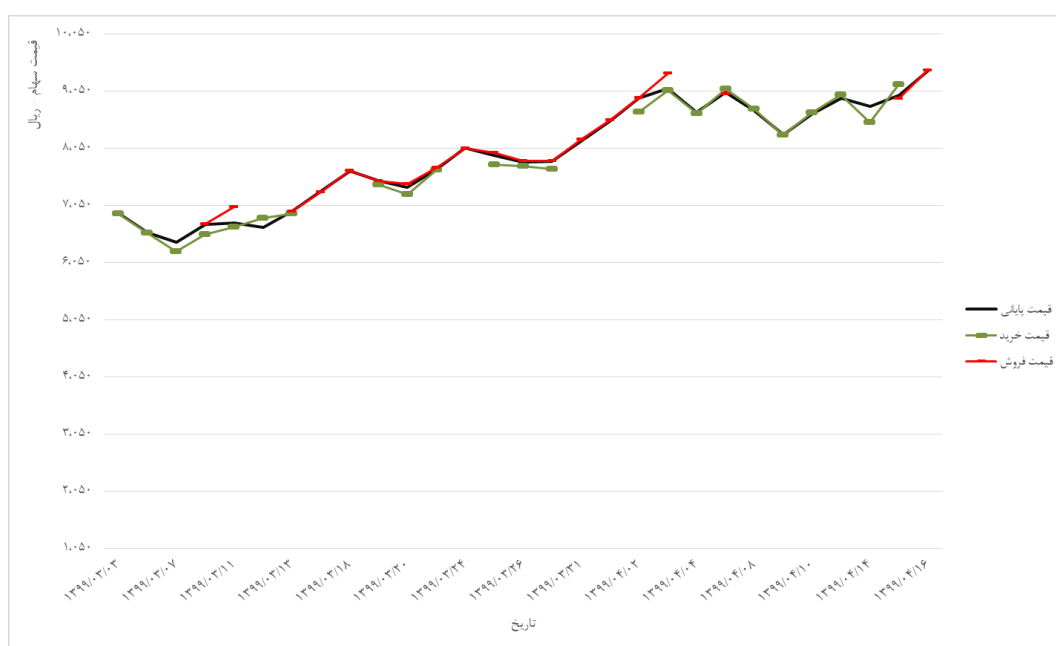
عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ از ۱۳۹۹/۰۳/۰۱ الی ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ در نمادهای سه گانه

عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ از ابتدای ۱۳۹۹/۰۳/۰۱ الی ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ برای نماد ونیرو

خالص ارزش روز بر اساس قیمت ابطال

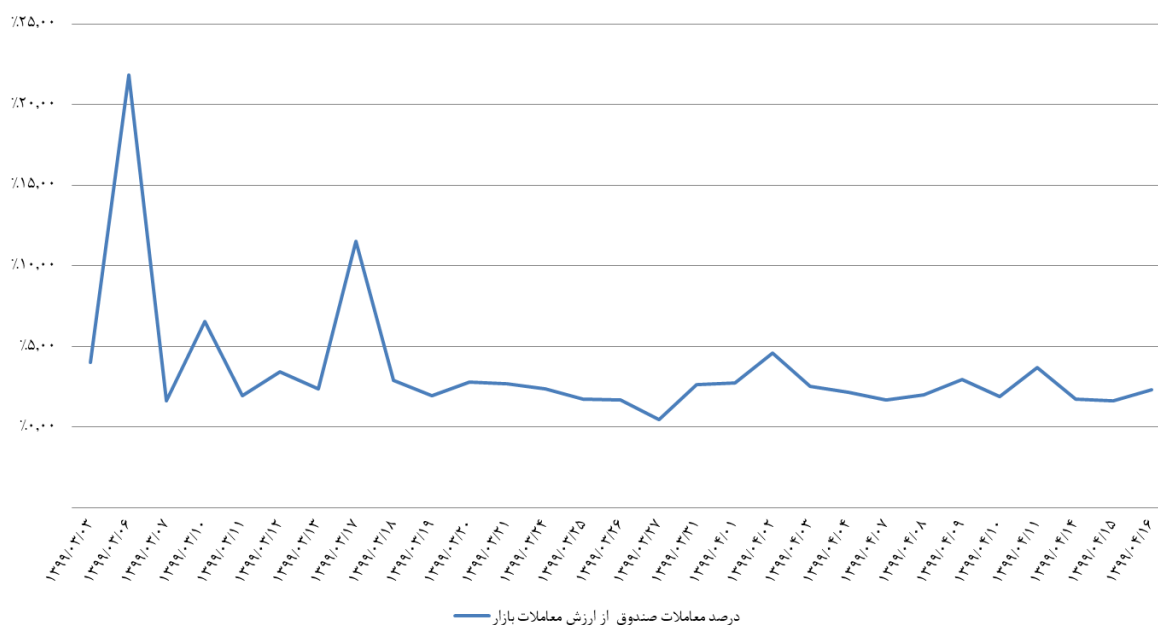


روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با قیمت پایانی سهم



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

درصد مشارکت صندوق در ارزش معاملات بازار

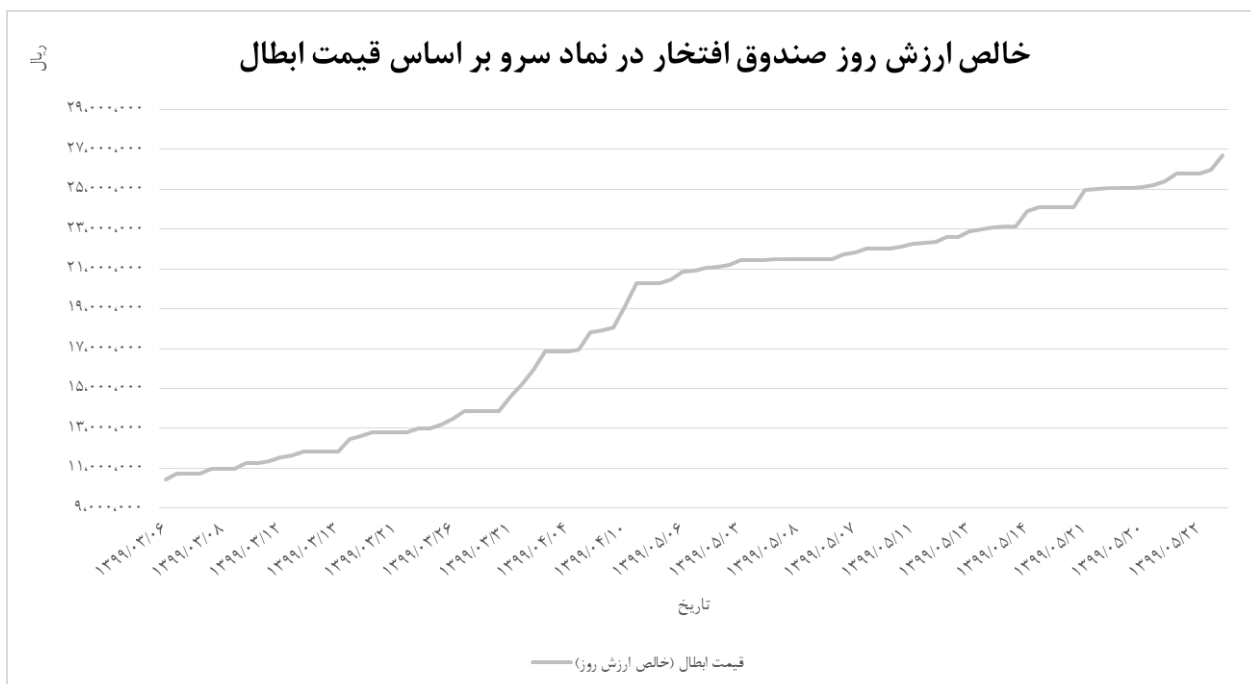


مقایسه اطلاعات معاملاتی بازار و صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

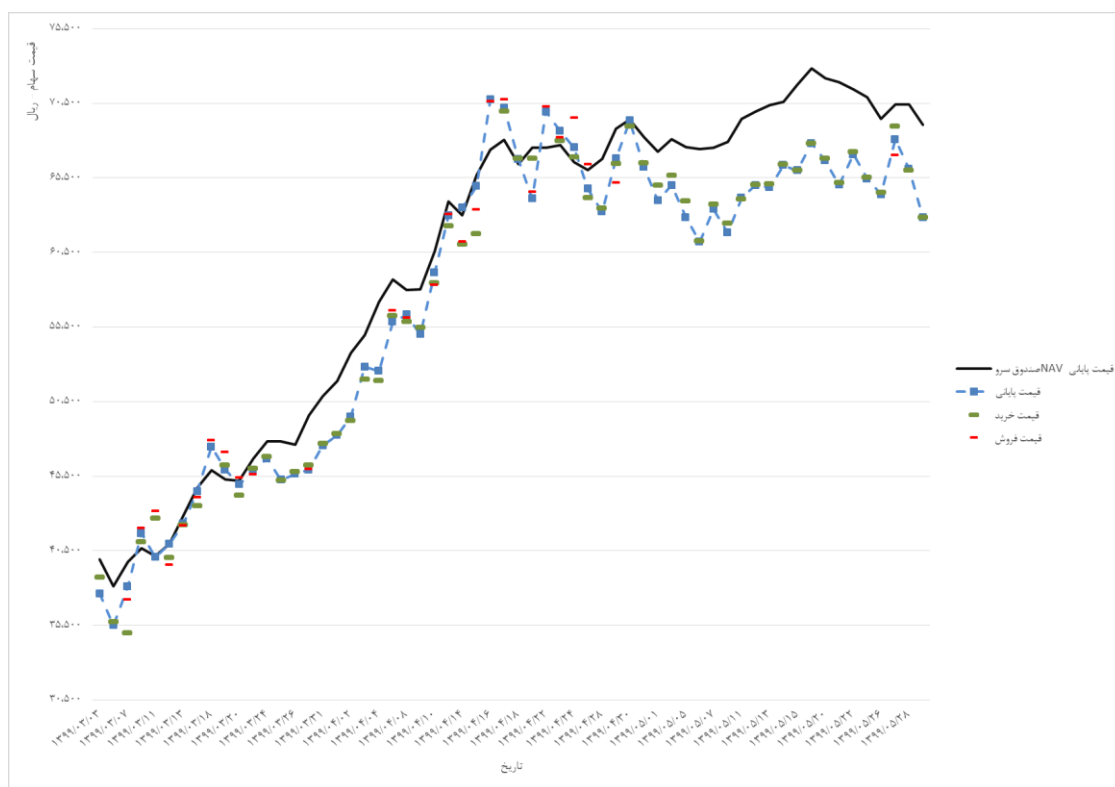
درصد از بازار	صندوق	بازار	
۱۰۰.۰۰٪	۲۹	۲۹	تعداد روز معاملاتی
۲.۴۵٪	۴۶,۲۰۶,۳۳۲	۱,۸۸۴,۲۱۷,۳۹۲	کل حجم معامله سهام طی دوره
۲.۴۵٪	۱,۵۹۳,۳۲۲	۶۴,۹۷۳,۰۱۴	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره

۵,۱۳۹,۶۵۱	تعداد تملک سهام ونیرو از ابتدای دوره - ۱۳۹۹/۰۳/۰۱
۱۹,۷۸۲,۰۸۲	تعداد تملک سهام ونیرو در انتهای دوره - ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در سرو در دوره مالی سه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

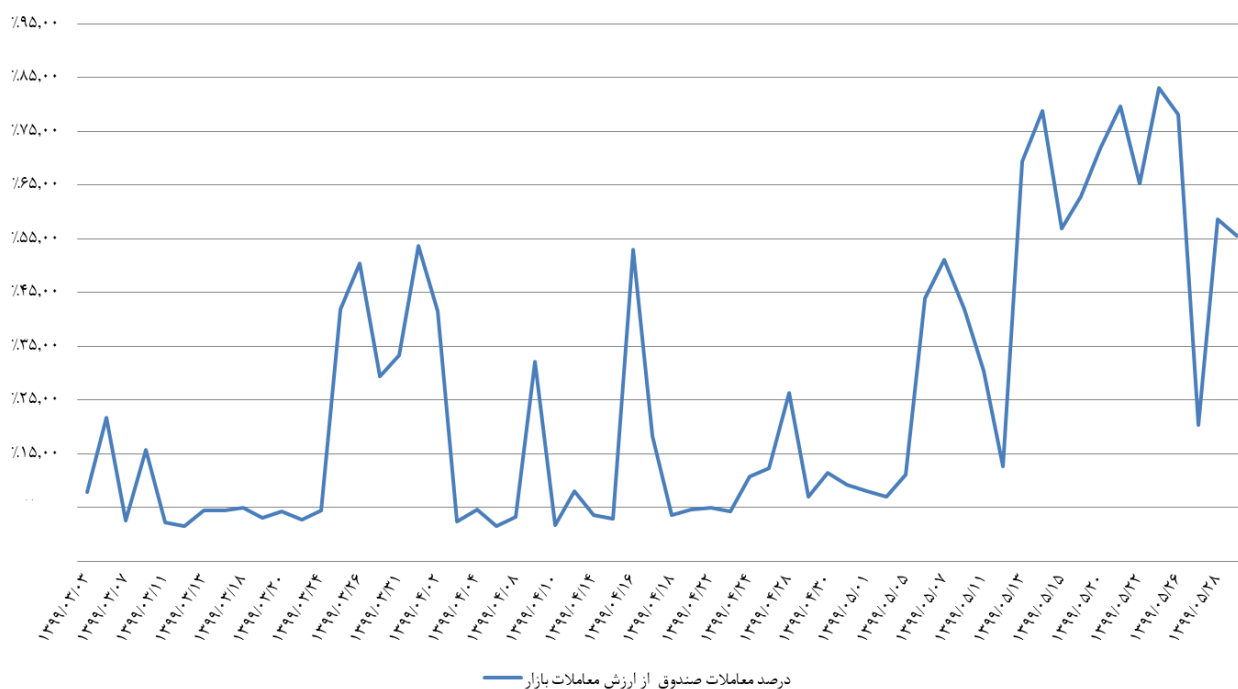


روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با Nav صندوق سرو



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

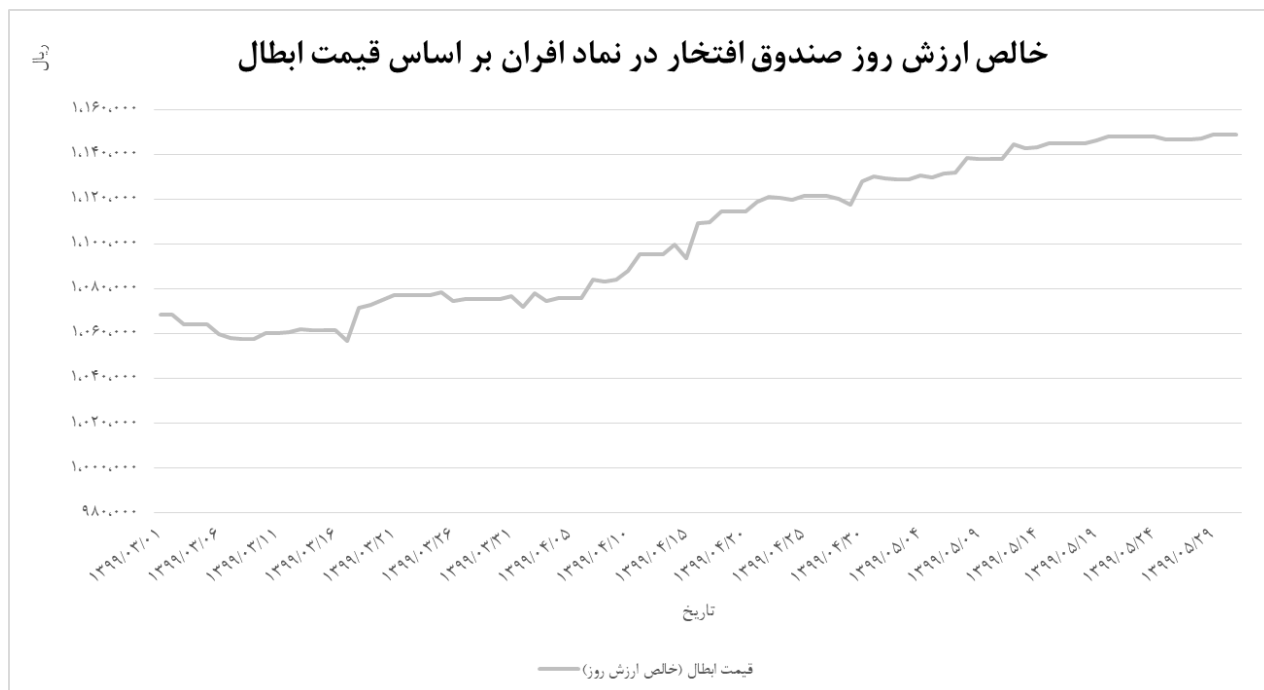
درصد مشارکت صندوق در ارزش معاملات بازار



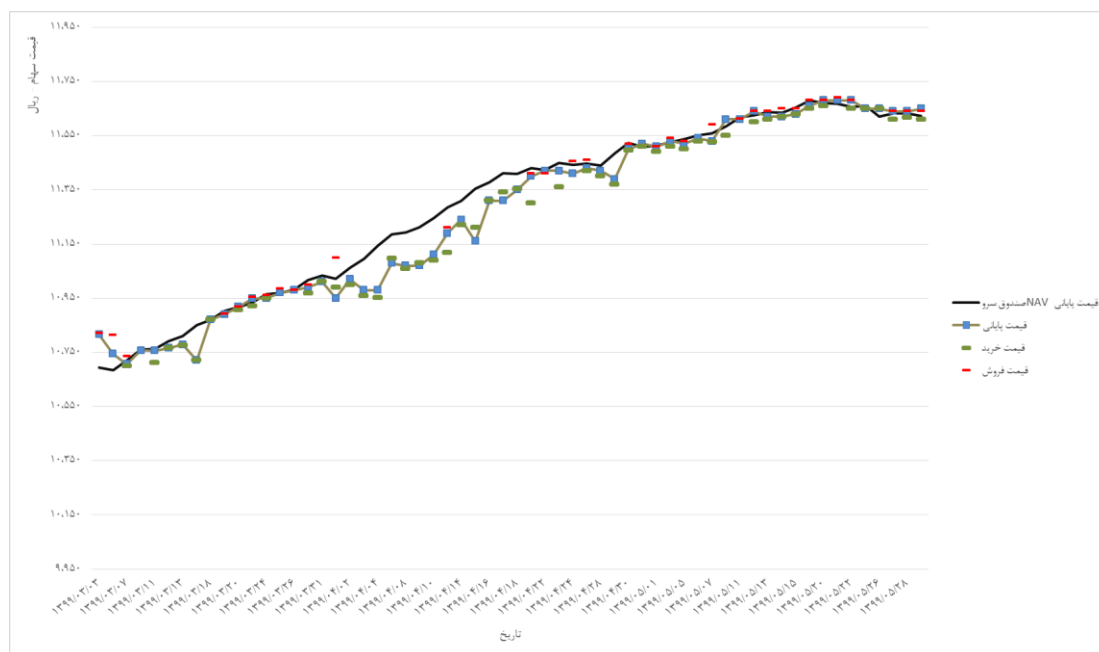
مقایسه اطلاعات معاملاتی بازار و صندوق بازارگردانی افتخار حافظ

درصد از بازار	صندوق	بازار	
۱۰۰.۰۰٪	۶۰	۶۰	تعداد روز معاملاتی
۲۱.۴۷٪	۷۳,۳۵۰,۸۱۹	۳۴۱,۵۷۶,۳۹۳	کل حجم معامله سهام طی دوره
۲۱.۴۷٪	۱,۲۲۲,۵۱۴	۵,۶۹۲,۹۴۰	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره

عملکرد صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در افران از ۱۳۹۹/۰۳/۰۱ الی ۱۳۹۹/۰۵/۳۱

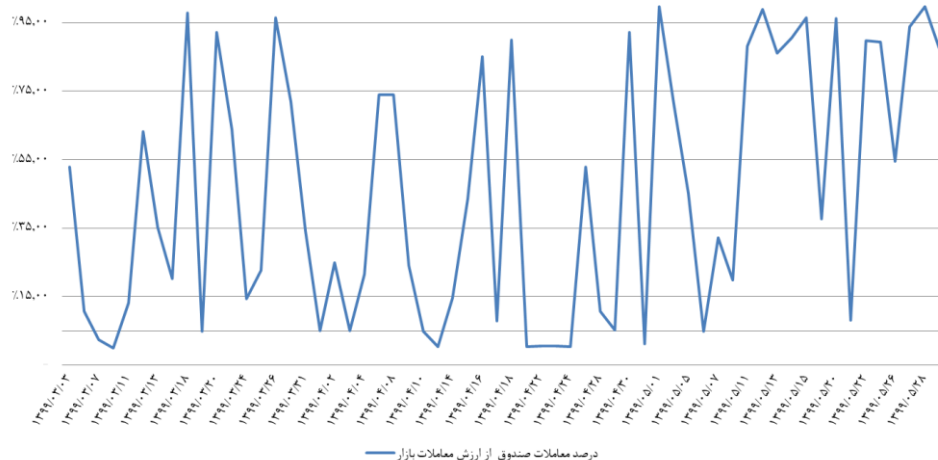


روند معاملاتی صندوق بازارگردانی افتخار حافظ در مقایسه با Nav صندوق سرو



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	
۹۸.۳۳٪	۵۹	۶۰	تعداد روز معاملاتی
۶۵.۳۵٪	۸۸,۹۳۲,۸۴۶	۱۳۶,۰۹۲,۱۲۴	کل حجم معامله سهام طی دوره
۶۶.۴۶٪	۱,۵۰۷,۳۳۶	۲,۲۶۸,۲۰۲	میانگین روزانه حجم معاملات در طی دوره

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

ترکیب صنایع تحت عملیات بازارگردانی در صندوق

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	۱۸۵,۵۵۵,۲۰۲,۷۶۱	۱۶,۷۶
صندوق های سرمایه گذاری	۷۰۵,۹۸۴,۹۳۳,۴۸۹	۶۳,۷۵
جمع	۲۴۴,۹۳۴,۵۴۰,۱۷۴	۸۰,۵۱

صورت های مالی

خلاصه صورت های مالی صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی افتخار حافظ برای دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱ مطابق جداول ذیل می باشد:

صورت خالص دارایی ها

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	
دارایی ها:	ریال
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۸۹۱,۵۴۰,۱۳۶,۲۵۰
سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی	۲۰۹,۷۹۵,۵۸۱,۲۴۹
حسابهای دریافتی	۷,۰۰۰,۰۰۰
سایر دارایی ها	۱۷۲,۲۵۹,۳۷۶
موجودی نقد	۲۴۷,۹۸۵,۵۲۸
جمع دارایی ها	۱,۰۱۰,۷۶۲,۹۶۲,۴۰۳
بدهی ها:	
جاری کارگزاری	۳۰,۱۵۰,۰۰۷,۶۳۱
پرداختنی به ارکان صندوق	۵,۰۲۱,۶۲۰,۴۹۴
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۱,۱۹۰,۶۵۰,۴۶۳
جمع بدهی ها	۳۶,۳۶۲,۲۷۸,۵۸۸
خالص دارایی ها:	۱,۰۶۵,۴۰۰,۶۸۳,۸۱۵
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۸,۰۱۰,۰۵۰

صورت سود و زیان

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۵/۳۱	
درآمدها:	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۴۵۸,۸۰۷,۶۷۶,۳۳۵
(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۱۲,۷۰۸,۸۵۷,۸۵۶)
سود سهام	.
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱,۹۲۵,۸۰۷,۰۶۹
سایر درآمدها	۵۲۶,۱۴۳,۸۴۹
جمع درآمدها	۴۴۸,۵۵۰,۷۶۹,۳۹۷
هزینه ها:	
هزینه کارمزد ارکان	(۳,۵۶۵,۰۶۴,۷۰۹)
سایر هزینه ها	(۳۶۸,۴۸۱,۴۵۱)
جمع هزینه ها	(۳,۹۳۳,۵۴۶,۱۶۰)
سود (زیان) خالص	۴۴۴,۶۱۷,۲۲۳,۲۳۷