

گزارش عملکرد

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری حافظ

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

« ثبت شده به شماره ۱۰۵۹۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار »

معرفی «صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری حافظ»

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری حافظ که صندوقی با سرمایه باز در اندازه کوچک محسوب می شود، در تاریخ ۱۳۸۶/۱۲/۲۸ تحت شماره ۱۰۵۹۱ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۲/۱۱/۱۵ به شماره ۳۳۳۲۹ نزد مرجع ثبت شرکتها به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع آوری سرمایه از سرمایه گذاران و تشکیل سبدی از دارایی های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در اوراق مشارکت و سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس سرمایه گذاری می نماید. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه ۳ سال است. مرکز اصلی صندوق در تهران به نشانی تهران، سعادت آباد، خیابان علامه طباطبایی، خیابان ۱۸ غربی، پلاک ۳۰، طبقه ۳.

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه گذاری مشترک حافظ مطابق با مفاد اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس <http://mutualfund.hafezbourse.com> درج گردیده است. ارکان آن نیز مطابق جدول ذیل در مجمع عمومی مؤسس انتخاب شده و قبول سمت نمودند.

| | |
|--------|---|
| مدیر | مشاور سرمایه گذاری هدف حافظ |
| متولی | مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهیافت و همکاران |
| حسابرس | مؤسسه حسابرسی رازدار |

عملیات اجرایی دوره

طی سال مالی مورد گزارش از تاریخ ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ تا ۱۴۰۳/۰۳/۳۱، مجموعاً ۱۶ درخواست صدور برای ۳۸۳ واحد سرمایه گذاری عادی و ۴۰ درخواست ابطال برای ۳,۹۸۹ واحد سرمایه گذاری عادی از طریق شعب منتخب کارگزاری حافظ و درخواست‌های اینترنتی در سیستم عملیاتی صندوق به ثبت رسیده است که در نتیجه آن تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق از ۹۰,۶۰۷ واحد در ابتدای سال به ۸۷,۰۰۱ واحد در پایان دوره رسیده است. تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری طی سال مورد بررسی به تفکیک ماه در جدول زیر ارائه شده است:

| ماه | تعداد واحدهای ممتاز | تعداد واحدهای عادی صادر شده | تعداد واحدهای عادی ابطال شده | تعداد کل واحدهای موجود |
|-------------|---------------------|-----------------------------|------------------------------|------------------------|
| ابتدای دوره | ۱,۰۰۰ | ۰ | ۰ | ۹۰,۶۰۷ |
| فروردین | ۱,۰۰۰ | ۳۶۶ | ۲۵۸ | ۹۰,۷۱۵ |
| اردیبهشت | ۱,۰۰۰ | ۱۴ | ۳,۵۱۱ | ۸۷,۲۱۸ |
| خرداد | ۱,۰۰۰ | ۳ | ۲۲۰ | ۸۷,۰۰۱ |

ترکیب سرمایه گذاران

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به شرح زیر است:

| نام دارندگان واحدهای ممتاز | تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک | درصد واحدهای ممتاز تحت تملک |
|---|------------------------------|-----------------------------|
| مؤسسه صندوق حمایت و بازنشستگی کارکنان فولاد | ۸۰۰ | ۸۰ |
| شرکت کارگزاری حافظ | ۱۵۰ | ۱۵ |
| شرکت مشاور سرمایه گذاری هدف حافظ | ۵۰ | ۵ |
| جمع | ۱,۰۰۰ | ۱۰۰ |

باتوجه به سهولت ورود و خروج سرمایه گذاران به صندوق های سرمایه گذاری، ترکیب سرمایه گذاران در این صندوق ها دائماً در حال تغییر است، آخرین ترکیب سرمایه گذاران به تفکیک حقیقی و حقوقی در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به شرح زیر می باشد:

| ترکیب سرمایه گذاران | تعداد سرمایه گذاران | تعداد واحدهای سرمایه گذاری | درصد سرمایه گذاری |
|---------------------|---------------------|----------------------------|-------------------|
| سرمایه گذاران حقوقی | ۹ | ۷۸,۳۰۱ | ۹۱ |
| سرمایه گذاران حقیقی | ۳۴۳ | ۷,۷۰۰ | ۹ |
| جمع | ۳۵۲ | ۸۶,۰۰۱ | ۱۰۰ |

بازدهی صندوق

بازده صندوق سرمایه گذاری مشترک حافظ در دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ برابر ۳.۶- % درصد و بازده بازار ۶.۸۸- % درصد بوده است.

خالص ارزش دارایی‌ها

روند خالص ارزش دارایی‌های صندوق از تاریخ ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ تا تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به شرح نمودار زیر است:

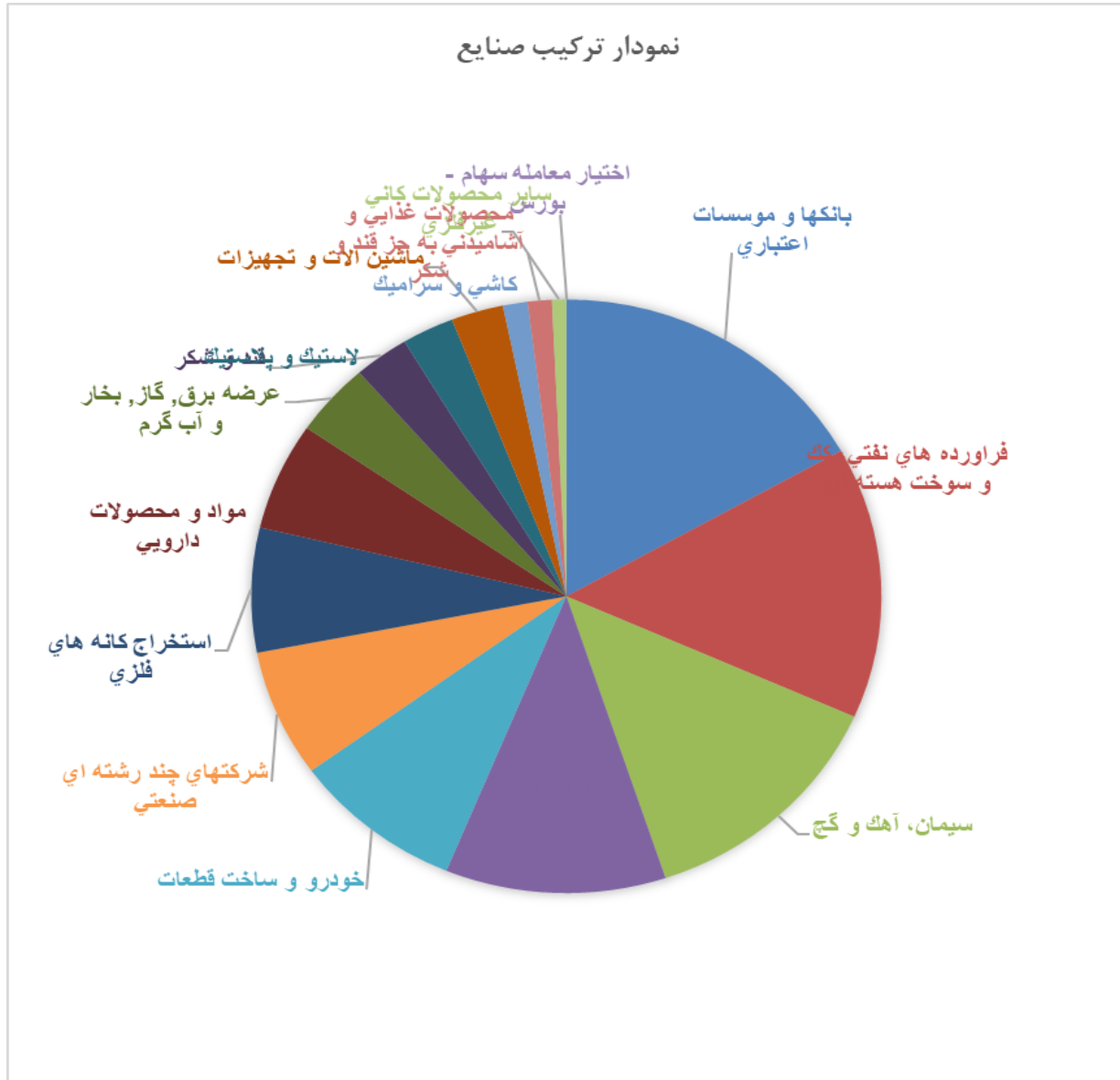


ترکیب دارایی‌های صندوق

❖ جدول ترکیب دارایی‌های صندوق در پایان سال مالی مورد گزارش در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به قرار زیر بوده است:

| ترکیب دارایی‌ها در صندوق | | |
|-----------------------------|-----------------------|--------------|
| نسبت به کل دارایی‌ها (درصد) | خالص ارزش فروش (ریال) | دارایی |
| ۰ | ۶۱,۷۰۹,۵۱۹ | وجه نقد |
| ۳.۲۸ | ۱۴,۸۷۰,۱۵۵,۱۴۳ | سپرده بانکی |
| ۱۰.۲ | ۲۲۲,۳۲۲,۸۰۲,۹۴۲ | اوراق مشارکت |
| ۸۴.۷۷ | ۱,۸۷۱,۷۰۱,۲۴۳,۸۲۵ | سهام |
| ۱.۶۵ | ۲۲,۴۷۹,۵۲۵,۸۶۵ | سایر |
| % ۱۰۰ | ۲,۱۳۱,۴۳۵,۴۳۷,۲۹۴ | جمع |

❖ نمودار ترکیب صنایع سهام صندوق در پایان سال مالی گزارش در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به قرار زیر بوده است:



جدول ترکیب صنایع سهام صندوق در پایان سال مالی مورد گزارش در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به قرار زیر بوده است:

| ترکیب صنایع در صندوق | | |
|-----------------------------|-----------------------|--|
| نسبت به کل دارایی‌ها (درصد) | خالص ارزش فروش (ریال) | صنعت |
| ۹.۵۶ | ۱۶۴/۹۲۲/۴۱۰/۱۱۴ | بانکها و موسسات اعتباری |
| ۹.۵۴ | ۲۰۵/۹۰۲/۲۲۶/۳۶۸ | فراورده های نفتی، كك و سوخت هسته ای |
| ۲.۳۸ | ۶۶/۸۸۳/۸۲۸/۱۲۵ | سیمان، آهك و گچ |
| ۲۰.۶۹ | ۴۵۹/۱۱۷/۲۸۴/۲۸۳ | فلزات اساسی |
| ۵.۷۵ | ۱۲۶/۷۴۱/۰۰۹/۴۶۰ | خودرو و ساخت قطعات |
| ۷.۳۴ | ۱۶۹/۵۱۸/۳۲۸/۶۵۰ | شرکتهای چند رشته ای صنعتی |
| ۶.۶۲ | ۱۳۴/۱۴۳/۶۱۵/۸۸۰ | استخراج کانه های فلزی |
| ۳.۳۶ | ۷۰/۸۷۰/۹۱۲/۲۴۷ | مواد و محصولات دارویی |
| ۳.۴۳ | ۶۹/۴۲۸/۷۰۰/۰۱۳ | عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم |
| ۰.۱۹ | ۲۵/۶۰۶/۵۶۲/۸۲۹ | قند و شکر |
| ۳.۷۳ | ۹۴/۶۶۸/۱۷۷/۱۷۶ | ماشین آلات و تجهیزات |
| ۰.۳۸ | ۱۰,۰۵۹,۲۹۸,۹۱۵ | محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر |
| ۱۱/۸۱ | ۲۷۰'۹۷۰'۴۵۲'۹۵۱ | محصولات شیمیایی |
| ۸۴/۷۷ | ۱,۸۷۱,۷۰۱,۲۴۳,۸۲۵ | جمع |

صورت‌های مالی

خلاصه صورت‌های مالی صندوق سرمایه‌گذاری مشترک کارگزاری حافظ برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۴/۳۱ مطابق جداول ذیل می‌باشد.

صورت خالص دارایی ها

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری حافظ

صورت خالص دارایی ها

به تاریخ ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

| ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ | ۱۴۰۲/۰۲/۲۱ | یادداشت |
|--------------------------|--------------------------|---|
| ریال | ریال | |
| | | دارایی ها |
| ۱,۸۷۱,۷۰۱,۲۴۳,۸۲۵ | ۱,۶۶۳,۷۰۰,۹۴۵,۰۶۲ | ۵ سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم |
| ۱۴,۸۷۰,۱۵۵,۱۴۳ | ۶۶,۳۴۶,۶۴۹,۷۸۶ | ۶ سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی |
| ۲۲۲,۲۲۲,۸۰۲,۹۴۲ | ۲۰۰,۱۲۱,۴۲۷,۴۵۵ | ۷ سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب |
| ۲۱,۰۲۶,۸۱۰,۹۲۰ | ۲۹,۲۳۲,۰۸۱,۷۰۵ | ۸ حسابهای دریافتی |
| ۱,۰۸۳,۶۵۰,۸۹۶ | ۳,۱۳۲,۹۶۶,۰۱۸ | ۹ سایر دارایی ها |
| ۶۱,۷۰۹,۵۱۹ | ۶۱,۷۰۹,۵۱۹ | ۱۰ موجودی نقد |
| ۳۶۹,۰۶۴,۰۴۹ | - | ۱۱ جاری کارگزاران |
| <u>۲,۱۲۱,۴۳۵,۴۲۷,۲۹۴</u> | <u>۱,۹۶۲,۵۹۵,۷۷۹,۵۴۵</u> | جمع دارایی ها |
| | | بدهی ها |
| - | - | ۱۱ جاری کارگزاران |
| ۳۵,۵۷۸,۰۳۹,۲۹۲ | ۱۷,۳۱۴,۶۴۴,۲۵۴ | ۱۲ پرداختنی به ارکان صندوق |
| ۲۸۷,۹۳۵,۸۵۰ | ۲,۲۷۲,۶۰۹,۲۶۱ | ۱۳ پرداختنی به سرمایه گذاران |
| ۳,۹۹۸,۷۰۴,۷۰۹ | ۶,۹۰۱,۶۰۰,۹۰۰ | ۱۴ سایر حسابهای پرداختنی و ذخایر |
| <u>۳۹,۸۶۴,۶۷۹,۸۵۱</u> | <u>۲۶,۴۸۸,۶۵۴,۴۱۵</u> | جمع بدهی ها |
| <u>۲,۰۹۱,۵۷۰,۷۵۷,۴۴۲</u> | <u>۱,۹۳۶,۱۰۷,۱۲۵,۱۳۰</u> | ۱۵ خالص دارایی ها |
| <u>۲۲,۰۸۲,۹۸۶</u> | <u>۲۲,۲۵۲,۸۴۹</u> | خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری |

یادداشت های توضیحی همراه بخش جدایی ناپذیر صورت های مالی است.

صورت سود و زیان:

صندوق سرمایه گذاری مشترک کارگزاری حافظ
صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها
دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

| سه ماهه منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۲ | سه ماهه منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۳ | یادداشت | |
|-----------------------------|-----------------------------|---------|--|
| ریال | ریال | | |
| | | | درآمدها |
| ۲۷۴,۲۵۲,۳۱۱,۲۷۶ | ۳۷,۰۹۶,۱۳۶,۰۹۵ | ۱۶ | سود فروش اوراق بهادار |
| ۱۸۲,۷۰۲,۵۰۵,۷۴۷ | (۱۳۱,۳۳۳,۴۲۹,۴۷۳) | ۱۷ | سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار |
| ۳۱,۹۸۷,۱۵۲,۵۳۹ | ۱۶,۷۰۱,۳۶۸,۱۹۳ | ۱۸ | سود سهام |
| ۲۵۹,۳۹۳,۹۳۷ | ۱۴,۲۳۳,۷۷۰,۱۸۶ | ۱۹ | سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب |
| ۴۵۷,۶۹۳,۴۲۱ | ۲۳,۷۱۰,۹۸۲ | ۲۰ | سایر درآمدها |
| ۴۸۹,۶۵۹,۰۵۵,۹۲۰ | (۶۳,۲۷۸,۴۴۴,۰۱۷) | | جمع درآمدها |
| | | | هزینه ها |
| (۳۲,۴۰۹,۷۱۷,۶۸۴) | (۷,۴۰۷,۴۴۵,۱۹۳) | ۲۱ | هزینه کارمزد ارکان |
| (۸۶۷,۰۳۸,۰۸۵) | (۸۷۸,۹۰۸,۹۵۵) | ۲۲ | سایر هزینه ها |
| ۴۵۶,۳۸۲,۳۰۰,۱۵۱ | (۷۱,۵۶۴,۷۹۸,۱۶۵) | | سود قبل از هزینه مالی |
| (۲۱۳,۳۹۲,۳۸۰) | - | ۲۳ | هزینه های مالی |
| ۴۵۶,۱۶۸,۹۰۷,۷۷۱ | (۷۱,۵۶۴,۷۹۸,۱۶۵) | | سود خالص |
| ۲۱.۰۴% | ۳.۴۵%- | | بازده میانگین سرمایه‌گذاری |
| ۵.۱۸%- | ۷.۸۴%- | | بازده سرمایه‌گذاری پایان سال |

صورت گردش خالص دارایی ها :

| سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ | | سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ | | یادداشت |
|-----------------------------|----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---|
| ریال | تعداد واحدهای سرمایه گذاری | ریال | تعداد واحدهای سرمایه گذاری | |
| ۲,۱۰۲,۲۸۳,۷۵۱,۲۶۵ | ۱۱۱,۸۶۰ | ۲,۰۹۱,۵۷۰,۷۵۷,۴۴۳ | ۹۰,۶۰۷ | خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) اول سال |
| ۷,۸۷۲,۰۰۰,۰۰۰ | ۷,۸۷۲ | ۳۸۳,۰۰۰,۰۰۰ | ۳۸۳ | واحدهای سرمایه گذاری صادر شده طی سال |
| (۳۲,۸۹۴,۰۰۰,۰۰۰) | (۳۲,۸۹۴) | (۳,۹۸۹,۰۰۰,۰۰۰) | (۳,۹۸۹) | واحدهای سرمایه گذاری ابطال شده طی سال |
| ۴۵۶,۱۶۸,۹۰۷,۷۷۱ | - | (۷۱,۵۶۴,۷۹۸,۱۶۵) | - | سود خالص |
| (۵۵۸,۳۸۶,۳۸۲,۰۵۷) | - | (۸۰,۲۹۲,۸۳۴,۱۴۸) | - | تعدیلات ۲۴ |
| ۱,۹۷۵,۰۴۴,۳۷۶,۹۷۹ | ۸۶,۸۳۸ | ۱,۹۳۶,۱۰۷,۱۲۵,۱۳۰ | ۸۷,۰۰۱ | خالص دارایی ها (واحدهای سرمایه گذاری) پایان سال |

سود (زیان) خالص

میانگین مؤوزن (ریال) وجوه استفاده شده

۱- بازده میانگین سرمایه گذاری =

۲- بازده سرمایه گذاری پایان دوره = تعدیلات ناشی از تفاوت قیمت صدور و ابطال ± سود (زیان) خالص خالص دارائیهای پایان دوره