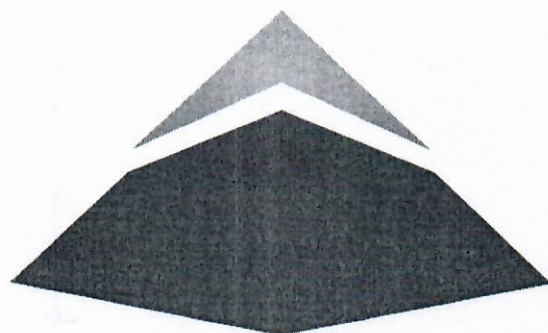




صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره مالی چهار ماه و شش روزه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۲

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

۱- کلیات

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند از انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری صدور و ابطالی متمرکز بر مشتقات می‌باشد که در تاریخ ۱۴۰۲/۰۴/۲۶ تحت شماره ۵۵۹۰۰ و شناسه ملی ۱۴۰۱۲۴۱۳۵۱۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیرتجاری استان تهران و در تاریخ ۱۴۰۲/۰۷/۲۹ تحت شماره ۱۲۱۶۲ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آن‌ها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده (۴) به منظور کاهش ریسک سرمایه‌گذاری، بهره‌گیری از صرفه‌جویی‌های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه‌گذاران است. موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در انواع اوراق بهادار از جمله سهام و حق تقدم سهام پذیرفته‌شده در بورس تهران و فرابورس ایران، گواهی سپرده کالایی، اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده‌ها و گواهی‌های سپرده بانکی است. موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار با درآمد ثابت می‌باشد. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساس نامه نامحدود است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای خرداد ماه هر سال تا انتهای اردیبهشت ماه همان سال است، مرکز اصلی صندوق در تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالدا سلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه چهارم، واحد شمال شرقی واقع شده است.

۱-۲- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند مطابق با بند ۱۱ امیدنامه در تارنمای صندوق به آدرس hefzearzeshdamavandfund.ir درج گردیده است.

۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۲-۱ مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری ممتاز از یک حق رای در مجمع برخوردارند.

۲-۲ مدیر صندوق، شرکت تأمین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالدا سلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۲-۳ متولی صندوق، موسسه حسابرسی ایرانیان تحلیل فارابی است که در تاریخ ۱۳۸۸/۰۳/۲۷ به شماره ثبت ۳۵۳۰۲۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خ سید جمال الدین اسد آبادی، خ ابن سینا، نبش خ نهم، پلاک ۶، طبقه سوم، واحد ۶

۲-۴ مدیر ثبت صندوق، شرکت تأمین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی بازارگردان عبارت است از: تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالدا سلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۲-۵ حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی بیات رایان است که در تاریخ ۱۳۵۷/۰۲/۰۷ به شماره ثبت ۱۹۱۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: استان تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین-ساعی، خیابان شهید احمد قصیر، کوچه پژوهشگاه (دوم)، پلاک ۲۲، ساختمان یازده، طبقه ۲، واحد ۶

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

۳- واحدهای سرمایه‌گذاری

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو دسته واحدهای سرمایه‌گذاری عادی و واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تقسیم می‌شود. واحد سرمایه‌گذاری عادی، فاقد حق رأی بوده و قابل ابطال اما غیرقابل انتقال است و خرید و فروش صرفاً از طریق بازار بورس می‌باشد. واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رأی در مجمع بوده قابل انتقال، اما غیرقابل ابطال می‌باشد. تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند در تاریخ ۱۴۰۲/۰۸/۳۰، تعداد ۱۶۲,۱۰۵,۶۲۸ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۵۲,۱۰۵,۶۲۸ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت تامین سرمایه دماوند	۹,۰۰۰,۰۰۰	۹۰٪
۲	شرکت سرمایه‌گذاری زرین پرشیا	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰٪
	جمع	۲,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰٪

۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

ردیف	تعداد واحد سرمایه‌گذاری ممتاز	تعداد واحد سرمایه‌گذاری عادی	نرخ صدور (ریال)	نرخ ابطال (ریال)	خالص ارزش آماری (ریال)
۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۵۲,۱۰۵,۶۲۸	۱۱۰۲۰	۱۰,۹۳۳	۱۰,۹۳۳

۵- صورت خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۲

دارایی‌ها	مادداشت	۱۴۰۲/۰۸/۳۰ ریال
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۵	۲۰,۵۸,۵۲۵,۴۱۰,۸۲۹
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده	۶	۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰,۰۰۰
حساب‌های دریافتنی	۷	۱۶,۵۲۶,۰۲۷,۳۷۷
سایر دارایی‌ها	۸	۴۹۱,۴۹۷,۱۸۴
موجودی نقد	۹	۱۷۲,۱۱۶,۷۱۸,۳۵۵
جمع دارایی‌ها		۳,۰۴۷,۶۵۹,۶۵۳,۶۴۵
بدهی‌ها		
جاری کارگزاران	۱۰	۷۶۳,۵۶۹,۱۳۶,۸۲۲
بدهی به ارکان صندوق	۱۱	۱۳,۵۶۰,۱۳۶,۵۷۷
بدهی به سرمایه‌گذاران	۱۲	۱۶۰,۰۲۲,۲۲۰,۷۴۹
سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر	۱۳	۳۳۸,۲۳۸,۷۱۵,۵۴۳
جمع بدهی‌ها		۱,۳۷۵,۳۹۰,۲۰۹,۶۹۱
خالص دارایی‌ها	۱۴	۱,۷۷۲,۲۶۹,۴۴۳,۹۵۴
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری		۱۰,۹۳۳

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

۶- صورت سود و زیان برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

دوره مالی ۴ ماه و ۶ روزه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰	یادداشت	
		درآمدها:
(۴۵۵,۲۷۸,۷۳۹)	۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۶۲,۴۲۶,۶۲۰,۵۵۷	۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۶۱,۷۸۴,۰۷۷,۹۸۳	۱۷	سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۰۱,۶۳۷,۹۶۹	۱۸	سایر درآمدها
<u>۱۲۴,۱۵۷,۰۵۷,۷۷۰</u>		جمع درآمدها
		هزینه ها:
۱۳,۵۶۰,۱۳۶,۵۷۷	۱۹	هزینه کارمزد ارکان
۳۰۱,۶۴۹,۵۵۴	۲۰	سایر هزینه ها
<u>۱۱۰,۲۹۵,۲۷۱,۶۳۹</u>		سود و زیان قبل از هزینه های مالی
۱,۸۶۰,۰۶۰	۲۱	هزینه های مالی
<u>۱۱۰,۲۹۳,۴۱۱,۵۷۹</u>		سود خالص
۲۴.۹۳٪		بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
۶.۴۳٪		بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)

دوره مالی ۴ ماه و ۶ روزه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰	تعداد	ریال	
			خالص دارایی‌ها (واحدهای سرمایه‌گذاری) اول دوره
۱,۶۲۵,۱۵۶,۲۸۰,۰۰۰	۱۶۲,۵۱۵,۶۲۸		واحدهای سرمایه‌گذاری صادر شده طی دوره
(۴,۱۰۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۴۱۰,۰۰۰)		واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده طی دوره
۱۱۰,۲۹۳,۴۱۱,۵۷۹			سود(زیان)خالص
۴۰,۹۱۹,۷۵۲,۳۷۵	۲۲		تعدیلات
<u>۱,۷۷۲,۲۶۹,۴۴۳,۹۵۴</u>	<u>۱۶۲,۱۰۵,۶۲۸</u>		

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

۷- وضعیت ترکیب دارایی ها در پایان دوره مالی

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی های صندوق در پایان دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰ مورد گزارش را نشان می‌دهد. صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند براساس ماده ۲۸ اساسنامه و به منظور مدیریت مناسب ریسک و کسب بیشترین بازده نسبت به سرمایه‌گذاری در سهام و مشتقات سهام و گواهی سپرده بانکی اقدام نموده است.

نوع دارایی	مبلغ	درصد از کل دارایی
سهام و حق تقدم	۲,۰۵۸,۵۲۵,۴۱۰,۸۳۴	۶۷.۵۴٪
نقد و بانک	۹۷۲,۱۱۶,۷۱۸,۲۵۵	۳۱.۹۰٪
حساب‌های دریافتی تجاری	۱۶,۵۱۴,۲۶۳,۷۹۲	۰.۵۴٪
سایر دارایی ها	۴۹۱,۴۹۷,۱۸۴	۰.۰۳٪
جمع کل	۳,۰۴۷,۶۴۷,۸۹۰,۰۶۵	۱۰۰٪
حساب‌های فی ما بین با کارگزاران	(۷۶۳,۵۶۹,۱۳۶,۸۲۲)	٪(۲۵.۰۵)

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰

۸- بازدهی صندوق

اطلاعات بازدهی صندوق شامل بازدهی صندوق از ابتدای تاسیس تا تاریخ گزارش، بازدهی صندوق در یکسال، شش ماه، سه ماهه، یک ماه و یک هفته (بر طبق بند ۲ ماده ۵۸ اساسنامه صندوق) در جدول ارائه که به روز رسانی آن در پایان هر هفته انجام می‌گردد.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
هفته گذشته	۱۴۰۲/۰۸/۲۳	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۰.۸۲٪	-۱.۲۷٪
ماه گذشته	۱۴۰۲/۰۷/۳۰	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۹.۳۳٪	-۰.۵۹٪
سه ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۶/۰۱	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
شش ماه اخیر	۱۴۰۲/۰۳/۰۴	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
یک سال اخیر	۱۴۰۱/۰۸/۳۰	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۰.۰۰٪	۰.۰۰٪
تازمان انتشار	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۹.۳۳٪	-۰.۲۴٪
حداکثر بازده هفتگی از تاریخ تاسیس		۲.۹۹٪		
حداقل بازده هفتگی از تاریخ تاسیس		-۱.۱۳٪		

۹- برنامه ها و فعالیت های آتی

تلاش در جهت کسب رضایت مشتریان از بازدهی متناسب صندوق، افزایش سقف واحدها و به تبع آن افزایش فروش واحدهای جدید صندوق می‌باشد.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
-------------	-----------	---------	-------

مدیر صندوق

شرکت تامین سرمایه دماوند

میثم فدائی واحد

