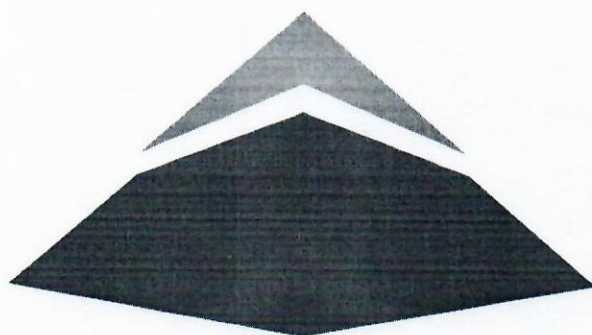




صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره مالی ۱۰ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی ۱۰ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

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 ۱۰ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

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 ۱۴۰۳/۰۲/۳۱، تعداد ۳۳۳,۹۸۱,۷۵۱ واحد بوده که این تعداد شامل ۳۳۳,۹۸۱,۷۵۱ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱۰,۰۰۰,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرح جدول زیر می‌باشد:

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

۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۲/۳۱

ردیف	تعداد واحد سرمایه گذاری ممتاز	تعداد واحد سرمایه گذاری عادی	نرخ صدور (ریال)	نرخ ابطال (ریال)	خالص ارزش آماری (ریال)
۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۳۳۳,۹۸۱,۷۵۱	۱۲,۷۶۶	۱۲,۶۸۳	۱۲,۷۳۴

۵- صورت خالص دارایی ها در تاریخ ۱۴۰۳/۰۲/۳۱

یادداشت	۱۴۰۳/۰۲/۳۱
	ریال
دارایی ها	
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۵
سرمایه گذاری در سیده و گواهی سیده یانگی	۶
سرمایه گذاری در سایر اوراق بیهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب	۷
حساب های دریافتی	۸
جاری کارگزاران	۹
سایر دارایی ها	۱۰
جمع دارایی ها	
بدهی ها	
جاری کارگزاران	۹
بدهی به ارکان صندوق	۱۱
بدهی به سرمایه گذاران	۱۲
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۱۳
جمع بدهی ها	
خالص دارایی ها	
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری - ریال	۱۲,۶۸۳

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی ۱۰ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

۶- صورت سود و زیان برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱

سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱	یادداشت	
درآمدها:		
۶۸۷.۷۲۱.۲۴۳.۹۸۷	۱۵	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
(۱۲۳,۰۴۹,۹۳۳,۵۳۲)	۱۶	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۶.۳۴۸.۳۹۰.۴۲۵	۱۷	سود سهام
۱۶۳.۹۲۴.۲۷۸.۲۱۱	۱۸	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱.۶۸۷.۳۱۱.۷۷۸	۱۹	سایر درآمدها
۷۳۶.۶۳۱.۲۹۰.۸۶۹		جمع درآمدها
هزینه ها:		
۹۲.۶۳۴.۲۴۷.۴۴۶	۲۰	هزینه کارمزد ارکان
۶۶.۲۹۱.۹۰۵.۸۸۶	۲۱	سایر هزینه ها
۱۵۸.۹۲۶.۱۵۳.۳۳۲		جمع هزینه ها
۵۷۷.۷۰۵.۱۳۷.۵۳۷		سود خالص
۱۴,۹۶٪		بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
۷,۵۸٪		بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)

۷- وضعیت ترکیب دارایی ها در پایان دوره مالی

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی های صندوق در پایان سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۲/۳۱ 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 دارایی (ریال)	درصد از کل دارایی
سهام و حق تقدم	۳,۹۷۹,۵۲۱,۳۶۰,۸۹۶	۷۸,۱۵
اوراق با درآمد ثابت	۸۸۴,۷۱۳,۴۳۱,۹۴۲	۱۷,۳۷
نقد و بانک	۲۲۱,۷۱۱,۹۹۸,۸۷۳	۴,۳۵
حسابهای دریافتی تجاری	۴,۵۰۴,۲۷۹,۱۸۵	۰,۰۹
سایر دارایی ها	۱,۶۲۰,۸۱۰,۰۴۳	۰,۰۳
جمع کل	۵,۰۹۲,۰۷۱,۸۸۰,۹۳۹	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره مالی ۱۰ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

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
روز اخیر	۱۴۰۳/۰۲/۳۰	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۰,۰۲۴٪	۰٪
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۲/۲۴	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۱,۲۷۷)	٪(۲,۲۶۱)
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۲/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	٪(۲,۰۳۲)	٪(۷,۵۸۱)
۳ ماه اخیر	۱۴۰۲/۱۲/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۴,۹۴٪	۱,۹۸۶٪
۶ ماه	۱۴۰۲/۰۹/۰۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۱۵,۹۸۵٪	۴,۴۶۲٪
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۰۲/۳۱	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۰	۰
تا زمان انتشار	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	۱۴۰۳/۰۲/۳۱	۲۶,۸۳٪	۴,۳۲۵٪
حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			۴,۲۵٪	۳,۹۹٪
حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			٪(۰,۷۵)	٪(۲,۵۱)

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.

امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

میشم فدائی واحد

شرکت تامین سرمایه دماوند

مدیر صندوق

