



صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۳

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۱۳۴۱۳۵۱۵ 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.

۲-۱- 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.

۲-۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

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

۱-۲ 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 ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۳/۰۸/۳۰، تعداد ۲۲۸،۲۱۴،۰۷۷ واحد بوده که این تعداد شامل ۲۱۸،۲۱۴،۰۷۷ 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 ۱۴۰۳/۰۸/۳۰

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	۲۱۸،۲۱۴،۰۷۷	۱۴،۱۵۵	۱۴،۳۵۶	۱۴۰،۶۱۵

۵- صورت خالص دارایی ها در تاریخ ۱۴۰۳/۰۸/۳۰

یادداشت	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۱۴۰۳/۰۲/۳۱
ریال	ریال	ریال
دارایی ها		
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۳،۳۷۵،۳۰۸،۳۰۱،۵۰۵	۳،۹۷۹،۵۲۱،۳۶۰،۸۹۶
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۳۸،۴۱۹،۳۶۶،۸۹۱	۲۲۱،۷۱۱،۹۹۸،۸۷۳
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۸۶۲،۳۷۲،۴۱۱،۲۴۹	۸۸۴،۷۱۳،۴۳۱،۹۲۶
حساب های دریافتنی	۳،۴۲۸،۹۷۶،۲۳۲	۴،۵۰۴،۲۷۹،۱۸۵
سایر دارایی ها	۱،۴۵۶،۹۳۳،۶۰۲	۱،۶۲۰،۸۱۰،۰۴۳
جمع دارایی ها	۴،۲۸۰،۹۸۵،۹۸۹،۴۷۹	۵،۰۹۲،۰۷۱،۸۸۰،۹۲۳
بدهی ها		
جاری کارگزاران	۵۴۲،۸۹۱،۲۸۹،۱۹۱	۵۵۱،۳۸۶،۲۲۵،۱۱۴
بدهی به ارکان صندوق	۱۴۳،۴۰۳،۴۴۰،۹۹۲	۹۱،۷۸۴،۸۹۱،۱۰۸
بدهی به سرمایه گذاران	۲،۰۶۰،۰۰۰،۰۰۰	۱،۰۹۰،۰۰۰،۰۰۰
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۳۱۶،۳۴۸،۷۵۳،۳۷۲	۲۱۱،۷۶۷،۷۹۳،۷۸۷
جمع بدهی ها	۱،۰۰۴،۷۰۳،۴۸۳،۵۵۵	۸۵۶،۰۲۸،۹۱۰،۰۰۹
خالص دارایی ها	۳،۲۷۶،۲۸۲،۵۰۵،۹۲۴	۴،۲۳۶،۰۴۲،۹۷۰،۹۱۴
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری - ریال	۱۴،۳۷۷	۱۲،۶۸۳

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۳

۶- صورت سود و زیان برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰

درآمد داشت	دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۳	دوره مالی ۴ ماه و ۶ روزه منتهی به ۱۴۰۲/۰۸/۳۰
	ریال	ریال
درآمدها:		
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۵	۳۰۶,۶۴۴,۲۷۳,۷۸۲
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۶	(۵۲,۲۰۶,۵۲۲,۸۸۴)
سود سهام	۱۷	۱۵۷,۹۵۰,۶۲۴,۷۳۵
سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۱۸	۱۹۴,۵۴۵,۴۲۵,۱۱۰
سایر درآمدها	۱۹	۳۲۱,۱۳۲,۶۱۶
جمع درآمدها		۶۰۷,۲۵۴,۹۳۳,۳۵۹
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۰	۵۲,۹۷۸,۸۸۲,۰۲۱
سایر هزینه ها	۲۱	۲,۶۹۸,۷۲۸,۰۸۷
سود (زیان) قبل از هزینه‌های مالی		۵۵۱,۵۷۷,۳۲۳,۲۵۱
هزینه‌های مالی	۲۲	۷۹,۱۳۵,۴۳۳,۸۸۰
سود (زیان) خالص		۴۷۲,۴۴۱,۷۷۹,۳۷۱
بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)		۱۲.۱۱٪
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)		۱۴.۵۶٪
		۸.۰۵٪
		۶.۴۳٪

۷- وضعیت ترکیب دارایی ها در پایان دوره مالی

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی های صندوق در پایان دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۸/۳۰ 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 دارایی (ریال)	درصد از کل دارایی
سهام و حق تقدم	۳,۳۷۵,۳۰۸,۳۰۱,۵۱۵	۷۸,۸۴
اوراق با درآمد ثابت	۸۶۲,۳۷۲,۴۱۱,۲۵۰	۲۰,۱۴
نقد و بانک	۳۸,۴۱۹,۳۶۶,۸۹۱	۰,۹
حسابهای دریافتی تجاری	۳,۰۰۸,۹۷۶,۲۳۲	۰,۰۷
سایر دارایی ها	۱,۸۷۶,۹۳۳,۶۰۲	۰,۰۴
جمع کل	۴,۲۸۰,۹۸۵,۹۸۹,۴۹۰	۱۰۰

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 می گردد.

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آبان ماه ۱۴۰۳

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
روز اخیر	۱۴۰۳/۰۸/۲۹	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪(۰.۰۵۶)	٪(۰.۵۳۳)
هفته گذشته	۱۴۰۳/۰۸/۲۳	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۲.۹۱	٪۵.۱۵۴
ماه گذشته	۱۴۰۳/۰۷/۳۰	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۸.۷۷	٪۱۲.۴۷
۳ ماه اخیر	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۸.۸۰	٪۱۰.۸۱
۶ ماه	۱۴۰۳/۰۳/۰۴	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۱۲.۲۶	٪۶.۷۸
یک سال اخیر	۱۴۰۲/۰۸/۳۰	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۳۱.۳۰	٪۱۱.۷۵
تا زمان انتشار	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	۱۴۰۳/۰۸/۳۰	٪۴۳.۵۶	٪۱۱.۴۸
حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			٪۵.۰۵	٪۶.۳۱
حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس			٪(۴.۲۸)	(۴.۲۸)

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




دماوند

دماوند