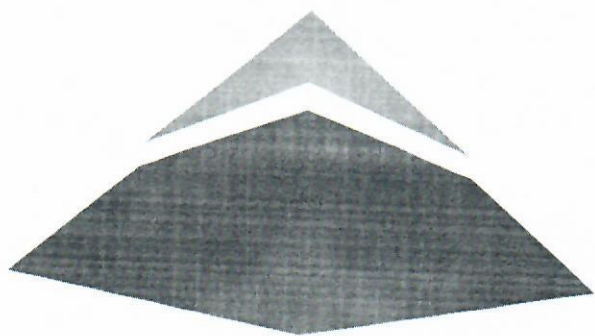




صندوق سرمایه‌گذاری  
**حفظ ارزش دماوند**  
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳

**صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند**  
**گزارش عملکرد**  
**دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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](http://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 ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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 ۱۴۰۳/۱۱/۳۰، تعداد ۱۶۱,۴۸۴,۰۴۲ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۵۱,۴۸۴,۰۴۲ 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                          | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰                   | ۱۰۰٪                  |

**۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۳۰**

| ردیف | تعداد واحد سرمایه‌گذاری ممتاز | تعداد واحد سرمایه‌گذاری عادی | نرخ صدور (ریال) | نرخ ابطال (ریال) | خالص ارزش آماری (ریال) |
|------|-------------------------------|------------------------------|-----------------|------------------|------------------------|
| ۱    | ۱۰,۰۰۰,۰۰۰                    | ۱۵۱,۴۸۴,۰۴۲                  | ۱۷,۳۶۲          | ۱۷,۲۴۴           | ۱۷,۲۷۳                 |

**۵- صورت خالص دارایی‌ها در تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۳۰**

| یادداشت                                                       | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰               | ۱۴۰۳/۰۲/۳۱               |
|---------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| ریال                                                          | ریال                     | ریال                     |
| <b>دارایی‌ها</b>                                              |                          |                          |
| سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم                                | ۲,۶۱۳,۶۲۹,۰۸۳,۵۰۰        | ۳,۹۷۹,۵۲۱,۳۶۰,۸۹۶        |
| سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی                     | ۱۳۵,۳۸۷,۵۷۷,۹۰۸          | ۳۲۱,۷۱۱,۹۹۸,۸۷۳          |
| سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب | ۱۰,۱۲۲,۰۸,۵۲۶,۹۴۱        | ۸۸۴,۷۱۳,۴۳۱,۹۲۶          |
| حساب‌های دریافتی                                              | ۱,۸۹۴,۵۲۷,۳۵۶            | ۴,۵۰۴,۲۷۹,۱۸۵            |
| سایر دارایی‌ها                                                | ۵۲۲,۱۲۸,۸۵۷              | ۱,۶۲۰,۸۱۰,۰۴۳            |
| <b>جمع دارایی‌ها</b>                                          | <b>۳,۷۶۴,۶۵۱,۸۵۴,۵۶۲</b> | <b>۵,۰۹۲,۰۷۱,۸۸۰,۹۲۳</b> |
| <b>بدهی‌ها</b>                                                |                          |                          |
| جاری کارگزاران                                                | ۶۴۲,۷۸۳,۸۳۱,۸۵۶          | ۵۵۱,۳۸۶,۳۲۵,۱۱۴          |
| بدهی به ارکان صندوق                                           | ۱۶۴,۵۷۹,۴۷۸,۷۱۹          | ۹۱,۷۸۴,۸۹۱,۱۰۸           |
| بدهی به سرمایه‌گذاران                                         | ۲۵۹,۱۵۷,۹۳۲              | ۱۰,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰           |
| سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر                                 | ۱۷۲,۳۳۱,۴۴۵,۹۸۶          | ۲۱۱,۷۶۷,۷۹۳,۷۸۷          |
| <b>جمع بدهی‌ها</b>                                            | <b>۹۷۹,۹۵۳,۸۱۴,۴۹۲</b>   | <b>۸۵۶,۰۲۸,۹۱۰,۰۰۹</b>   |
| <b>خالص دارایی‌ها</b>                                         | <b>۲,۷۸۴,۶۹۸,۰۴۰,۰۶۹</b> | <b>۴,۲۳۶,۰۴۲,۹۷۰,۹۱۴</b> |
| خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری ریال                     | <b>۱۷,۲۴۴</b>            | <b>۱۲,۶۸۳</b>            |

**صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند**  
**گزارش عملکرد**  
**دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳**

**۶- صورت سود و زیان برای دوره مالی منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰**

| درآمد داشت                                   | دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ماه ۱۴۰۳ | دوره مالی ۷ ماه و ۶ روزه منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۲ |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------------------|
| ریال                                         | ریال                                       | ریال                                           |
| <b>درآمدها:</b>                              |                                            |                                                |
| سود (زیان) فروش اوراق بهادار                 | ۱۵                                         | ۵۵۴,۹۷۹,۶۹۰,۶۵۱                                |
| سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار  | ۱۶                                         | ۲۱۵,۰۸۱,۲۲۷,۴۷۵                                |
| سود سهام                                     | ۱۷                                         | ۱۵۷,۹۹۴,۰۲۶,۳۲۸                                |
| سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب | ۱۸                                         | ۲۶۵,۸۲۹,۳۴۵,۹۰۷                                |
| سایر درآمدها                                 | ۱۹                                         | ۶۳۱,۷۲۰,۱۵۹                                    |
| <b>جمع درآمدها</b>                           |                                            |                                                |
|                                              | ۱,۲۹۴,۵۱۶,۰۴۰,۵۲۰                          | ۴۸۴,۶۴۰,۸۲۴,۰۴۱                                |
| <b>هزینه ها:</b>                             |                                            |                                                |
| هزینه کارمزد ارکان                           | ۲۰                                         | ۷۴,۶۶۹,۵۱۰,۴۷۵                                 |
| سایر هزینه ها                                | ۲۱                                         | ۴,۶۸۲,۲۹۷,۴۷۸                                  |
| <b>سود قبل از هزینه‌های مالی</b>             |                                            |                                                |
|                                              | ۱,۲۱۵,۱۶۴,۲۱۲,۵۶۷                          | ۴۰۸,۵۵۰,۷۲۴,۳۱۶                                |
| هزینه‌های مالی                               | ۲۲                                         | ۱۲۴,۶۹۲,۳۴۰,۹۴۲                                |
| <b>سود خالص</b>                              |                                            |                                                |
|                                              | ۱,۰۹۰,۴۷۱,۸۷۱,۶۲۵                          | ۲۷۴,۷۰۸,۳۰۷,۷۴۲                                |
| بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)            | ۲۹/۶۹                                      | ۱۲/۷۸                                          |
| بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)         | ۳۹/۳۷                                      | ۹/۷۶                                           |

**۷- وضعیت ترکیب دارایی ها در پایان دوره مالی**

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی های صندوق در پایان دوره ۹ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ 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        | ۲,۸۸۷,۶۵۴,۶۸۵,۵۴۴  | ۷۶.۷              |
| اوراق با درآمد ثابت   | ۷۳۹,۱۹۲,۹۲۴,۸۹۷    | ۱۹.۶۴             |
| نقد و بانک            | ۱۳۵,۳۸۷,۵۷۷,۹۰۸    | ۳.۶               |
| حسابهای دریافتی تجاری | ۱,۸۹۴,۵۳۷,۳۵۶      | ۰.۰۵              |
| سایر دارایی ها        | ۵۲۲,۱۲۸,۸۵۷        | ۰.۰۱              |
| جمع کل                | ۳,۷۶۴,۶۵۱,۸۵۴,۵۶۲  | ۱۰۰               |



# صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

## گزارش عملکرد

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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                           | ۱۴۰۳/۱۱/۲۹ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۰.۶۰۷       | %۰.۶۷۷       |
| هفته گذشته                         | ۱۴۰۳/۱۱/۲۳ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %(۱.۰۷۳)     | %(۲.۳۳۵)     |
| ماه گذشته                          | ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۲.۱۶۹       | %(۲.۹۱۴)     |
| ۳ ماه اخیر                         | ۱۴۰۳/۰۸/۳۰ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۲۰.۱۱۷      | %۲۰.۴۵۲      |
| ۶ ماه                              | ۱۴۰۳/۰۶/۰۱ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۳۰.۶۹۶      | %۳۳.۴۸۴      |
| یک سال اخیر                        | ۱۴۰۲/۱۱/۳۰ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۴۳.۰۵۶      | %۳۱.۳۲       |
| تا زمان انتشار                     | ۱۴۰۲/۰۷/۲۹ | ۱۴۰۳/۱۱/۳۰ | %۷۲.۴۴       | %۳۴.۲۹       |
| حداکثر بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس |            |            | %۵.۰۵        | %۶.۳۱        |
| حداقل بازدهی هفتگی از تاریخ تاسیس  |            |            | %(۴.۲۸)      | %(۴.۲۸)      |

### ۹- برنامه‌ها و فعالیت‌های 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 | میلاد فروغی |  |

