



صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

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 ۱۴۰۱۱۲۴۱۳۵۱۵ 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 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) اساسنامه 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 ماده ۵۷ اساسنامه در تارنمای صندوق به نشانی hefzearezshdamavandfund.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:

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.

۲-۱- مدیر صندوق، شرکت تامین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت های 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

۲-۲- متولی صندوق، مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی است که در تاریخ ۱۳۸۸/۰۳/۲۷ به شماره ثبت ۳۵۳۰۲۳ نزد مرجع ثبت شرکت های 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

۲-۳- مدیر ثبت صندوق، شرکت تامین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت 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

۲-۴- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی بیات رایان است که در تاریخ ۱۳۵۷/۰۲/۰۷ به شماره ثبت ۱۹۱۰ نزد مرجع ثبت شرکت های 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

۲-۴- ضامن نقد شوندگی، شرکت تامین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت 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

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

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 صدور و ابطال 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 ۱۴۰۴/۰۵/۳۱، تعداد ۱۲۴،۹۲۸،۵۰۹ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۱۴،۹۲۸،۵۰۹ 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	۱۰،۰۰۰،۰۰۰	۱۰۰٪

۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۴/۰۵/۳۱

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	۱۱۴،۹۲۸،۵۰۹	۱۳،۷۱۱	۱۳،۶۶۵	۱۳،۶۶۴

۵- صورت خالص دارایی ها در تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

یادداشت	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۱۴۰۴/۰۲/۳۱
	ریال	ریال
دارایی ها		
سرمایه گذاری در سهام	۵	۳،۳۹۵،۷۹۴،۲۷۸،۵۳۶
سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۶	۳۴۳،۶۳۷،۳۶۱،۸۲۸
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی الحساب	۷	۵۳۱،۲۸۸،۳۱۴،۶۹۹
حساب های دریافتی	۸	۳،۹۹۹،۹۸۰،۹۴۲
جاری کلرگزاران	۹	-
سایر دارایی ها	۱۰	۴،۵۴۵،۷۵۴،۳۱۶
جمع دارایی ها		۴،۲۷۹،۲۸۵،۶۹۰،۳۲۱
بدهی ها		
جاری کلرگزاران	۹	۶۲۲،۲۱۵،۹۰۶،۲۶۶
بدهی به ارکان صندوق	۱۱	۱۸۱،۹۶۸،۶۸۴،۰۸۲
بدهی به سرمایه گذاران	۱۲	۴۴۰،۰۱۰،۲۰۰،۰۰۰
سایر حساب های پرداختنی و تاخیر	۱۳	۲۱۹،۹۹۸،۵۷۲،۳۱۴
جمع بدهی ها		۱،۴۶۴،۱۹۳،۳۶۲،۶۶۲
خالص دارایی ها	۱۴	۲،۸۱۵،۰۹۲،۳۲۷،۶۵۹
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه گذاری - ریال		۱۹،۷۱۶
		۱۳،۶۶۵

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

۶- صورت سود و زیان برای دوره منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

درآمد داشت	دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴	دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۳
درآمدها:	ریال	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۵	(۴۶۹,۴۲۳,۲۹۵,۳۱۶)
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۶	(۴۲۴,۹۰۳,۹۲۷,۴۰۵)
سود سهام	۱۷	۴۳,۱۴۷,۰۳۲,۷۶۳
سود اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۱۸	۳۹,۲۸۴,۴۴۲,۰۱۷
سایر درآمدها	۱۹	۴۰۱,۰۶۰,۰۲۳
جمع درآمدها		۲۲۱,۸۶۰,۳۵۶,۷۹۸
هزینه ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۰	۱۳,۶۹۱,۱۵۸,۵۷۶
سایر هزینه ها	۲۱	۱,۹۰۱,۱۳۹,۳۸۸
سود (زیان) قبل از هزینه‌های مالی		۱۸۶,۹۵۱,۴۷۷,۹۵۷
هزینه‌های مالی	۲۲	۴۱,۹۳۷,۵۸۳,۸۲۸
سود خالص		۱۴۵,۰۱۳,۸۹۴,۱۲۹
بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)		۳.۶۴
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)		۳.۸۰

۷- وضعیت ترکیب دارایی ها در پایان دوره منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی های صندوق در پایان دوره منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴ مورد گزارش را نشان می‌دهد. صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند بر اساس ماده ۳۹ 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	۷۶۳,۳۳۰,۰۷۰,۰۷۷	۴۳.۵۷
اوراق با درآمد ثابت	۵۰۴,۶۳۱,۲۱۵,۹۲۱	۲۸.۸
نقد و بانک	۳۰۸,۹۳۰,۱۹۷,۳۱۴	۱۷.۶۳
حسابهای دریافتی تجاری	۳۰,۶۴۴,۱۰۳,۳۰۷	۱.۷۵
حساب های فی ما بین با کارگزاری	۱۴۰,۶۹۸,۶۶۱,۱۸۵	۸.۰۳
سایر دارایی ها	۳,۸۶۶,۷۲۵,۶۵۸	۰.۲۲
جمع کل	۱,۷۵۲,۱۰۰,۹۷۳,۴۶۲	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۴

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	بازده صندوق (درصد)	بازده شاخص (درصد)
از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۳۶.۶۵	۲۲.۲۳
۳۶۵ روز گذشته	۱۴۰۳/۰۶/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۳.۵۷	۲۱.۵۰
۱۸۰ روز گذشته	۱۴۰۳/۱۲/۰۵	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	(۲۰.۰۵)	(۹.۵۳)
۹۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۳/۰۳	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	(۳۰.۷۶)	(۲۱.۰۳)
۳۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۵/۰۱	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	(۱۵.۸۶)	(۱۲.۷۵)
هفت روز گذشته	۱۴۰۴/۰۵/۲۴	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	(۰.۹۶)	۰.۳۳۴
یک روز گذشته	۱۴۰۴/۰۵/۳۰	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۰.۰۱۵	۰

۹- برنامه ها و فعالیت های آتی

باتوجه به کم‌رونق بودن سال‌های اخیر بازار سرمایه و برهم خوردن آرامش سیاسی کشور طی جنگ ۱۲ روزه و در نتیجه کاهش شاخص های بورس و فرابورس تمامی صندوق های سرمایه گذاری در سهام دچار کاهش نرخ NAV شده اند، در این شرایط مدیریت صندوق سرمایه گذاری حفظ ارزش دماوند امیدوار است با توجه به بسته های حمایتی در نظر گرفته شده جهت کنترل بازار، تکیه بر موقعیت های اختیار معامله و کاهش فشار عرضه سهام بتواند باعث جلب مجدد اعتماد مردم به صندوق شوند.

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

مدیر صندوق

شرکت تامین سرمایه دماوند

میلاذ فروغی

