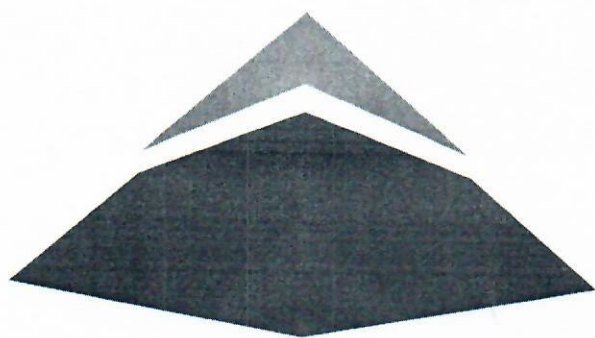




صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 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:

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.

۱-۲- مدیر صندوق، شرکت تامین 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

۲-۲- متولی صندوق، مشاور سرمایه‌گذاری 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 اسدآبادی، خ ابن سینا، نبش خ نهم، پلاک ۶، طبقه سوم، واحد ۶

۳-۲- مدیر ثبت صندوق، شرکت تامین 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 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

۴-۲- 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

۴-۲- ضامن نقد شوندگی، شرکت تامین 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 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 شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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 ۱۴۰۴/۰۸/۳۰، تعداد ۱۱۹,۷۸۹,۷۰۱ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۰۹,۷۸۹,۷۰۱ 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 ۱۴۰۴/۰۸/۳۰

ردیف	تعداد واحد سرمایه‌گذاری ممتاز	تعداد واحد سرمایه‌گذاری عادی	نرخ صدور (ریال)	نرخ ابطال (ریال)	خالص ارزش آماری (ریال)
۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۹,۷۸۹,۷۰۱	۱۷,۲۰۶	۱۷,۰۳۸	۱۷,۰۳۸

۵- صورت خالص دارایی‌ها در تاریخ ۳۰ آبان ۱۴۰۴

یادداشت	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۱۴۰۴/۰۲/۳۱
	ریال	ریال
دارایی‌ها		
۵ سرمایه‌گذاری در سهام	۱,۸۴۸,۸۰۶,۸۶۴,۶۹۰	۲,۳۹۵,۷۹۴,۲۷۸,۵۲۶
۶ سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده کالا	۸۹,۷۶۴,۶۸۴,۲۵۶	-
۷ سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۲۲,۶۴۲,۷۲۴,۸۲۵	۲۴۲,۶۲۷,۳۶۱,۸۲۸
۸ سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار یا درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۴۲۸,۷۴۹,۷۲۷,۹۱۴	۵۲۱,۲۸۸,۳۱۴,۶۹۹
۹ حساب‌های دریافتنی	۴۲,۳۲۴,۵۸۷,۰۷۸	۲,۹۹۹,۹۸۰,۹۴۲
۱۰ سایر دارایی‌ها	۴,۴۰۰,۴۷۹,۴۵۰	۴,۵۶۵,۷۵۴,۲۱۶
جمع دارایی‌ها	۲,۴۴۷,۶۹۹,۰۷۸,۲۱۳	۲,۴۷۹,۲۸۵,۶۹۰,۳۲۱
بدهی‌ها		
۱۱ جاری کارگزاران	۲۶۹,۹۲۲,۹۷۵,۷۱۴	۶۲۲,۲۱۵,۹۰۶,۲۶۶
۱۲ بدهی به ارکان صندوق	۴۲,۸۲۲,۷۹۷,۱۶۸	۱۸۱,۹۶۸,۶۸۴,۰۸۲
۱۳ بدهی به سرمایه‌گذاران	۱,۰۰۰,۲۰۵,۲	۴۴۰,۰۱۰,۲۰۰,۰۰۰
۱۴ سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر	۹۲,۹۹۱,۱۳۲,۳۹۶	۲۱۹,۹۹۸,۵۷۲,۳۱۴
جمع بدهی‌ها	۴۰۶,۷۴۸,۹۰۷,۳۳۰	۱,۴۶۴,۱۹۲,۳۶۲,۶۶۲
خالص دارایی‌ها	۲,۰۴۰,۹۵۰,۱۷۰,۸۸۳	۲,۸۱۵,۰۹۲,۳۲۷,۶۵۹
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال	۱۷,۰۳۸	۱۹,۷۱۶

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴

۶- صورت سود و زیان برای دوره منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴

یادداشت	دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴	دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۳	
	ریال	ریال	درآمدها:
۱۶	(۶۹۴,۵۵۹,۱۶۶,۴۹۸)	۲۰۶,۶۴۴,۲۷۲,۷۸۲	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۷	۱۶۹,۷۸۱,۵۰۹,۴۵۸	(۵۲,۲۰۶,۵۲۲,۸۸۴)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۸	۷۸,۱۶۰,۲۶۱,۷۰۵	۱۵۷,۹۵۰,۶۲۴,۷۲۵	سود سهام
۱۹	۷۰,۴۲۷,۷۲۱,۲۲۶	۱۹۴,۵۴۵,۴۲۵,۱۱۰	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب
۲۰	۸۵۲,۷۵۱,۹۶۰	۲۲۱,۱۳۲,۶۱۶	سایر درآمدها
	(۳۷۵,۳۳۵,۹۱۲,۱۴۹)	۶۰۷,۲۵۴,۹۳۳,۳۵۹	جمع درآمدها
			هزینه‌ها:
۲۱	۲۲,۱۶۷,۸۲۹,۹۷۷	۵۲,۹۷۸,۸۸۲,۰۲۱	هزینه کارمزد ارکان
۲۲	۵,۱۲۲,۴۱۶,۶۳۶	۲,۶۹۸,۷۲۸,۰۸۷	سایر هزینه‌ها
	(۴۰۲,۶۲۶,۱۵۸,۷۶۲)	۵۵۱,۵۷۷,۲۲۲,۲۵۱	سود (زیان) قبل از هزینه‌های مالی
۲۳	۴۶,۴۲۲,۸۳۲,۲۹۱	۷۹,۱۲۵,۵۴۲,۸۸۰	هزینه‌های مالی
	(۴۴۹,۰۵۸,۹۹۲,۰۵۳)	۴۷۲,۴۴۱,۷۷۹,۳۷۱	سود خالص
	(۲۰.۷۷)	۱۲.۱۱	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
	(۲۱.۷۷)	۱۴.۲۶	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)

۷- وضعیت ترکیب دارایی‌ها در پایان دوره منتهی به ۳۰ آبان ۱۴۰۴

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی‌های صندوق در پایان دوره منتهی به ۳۰ آبان 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	۱,۹۳۸,۵۷۱,۵۴۸,۹۶۰	۷۹.۲
اوراق با درآمد ثابت	۴۲۸,۷۴۹,۷۳۷,۹۱۵	۱۷.۵۲
نقد و بانک	۳۲,۶۴۲,۷۲۴,۸۲۵	۱.۳۳
حسابهای دریافتی تجاری	۴۳,۲۴۲,۳۲۴,۷۵۹	۱.۷۷
سایر دارایی‌ها	۴,۴۹۲,۷۴۱,۷۶۹	۰.۱۸
جمع کل	۲,۴۴۷,۶۹۹,۰۷۸,۲۲۸	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره شش ماهه منتهی به ۳۰ آبان 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	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۷۰.۳۸	۵۶.۴۷
۳۶۵ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۹/۰۱	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۱۸.۶۴	۴۰.۳۵
۱۸۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۳/۰۴	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	(۱۳.۱۶)	۲.۱۴
۹۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۶/۰۱	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۲۴.۶۴	۲۸.۲۳
۳۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۷/۳۰	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۴.۳۰	۲.۸۸
هفت روز گذشته	۱۴۰۴/۰۸/۲۳	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۱.۷۳	۲.۲۵
یک روز گذشته	۱۴۰۴/۰۸/۲۹	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۰	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.

امضاء

نماینده

شخص حقوقی

ارکان صندوق

میلاد فروغی

شرکت تامین سرمایه دماوند

مدیر صندوق

