



صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
سهامی صدور ابطالی

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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 خالداسلامبولی، 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.

۱-۲-۱ 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 خالداسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۱-۲-۲ 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

۱-۲-۳ مدیر ثبت صندوق، شرکت تامین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت عبارت است از: تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالداسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۱-۲-۴ 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

۱-۲-۴ ضامن نقد شوندگی، شرکت تامین سرمایه دماوند (سهامی عام) است که در تاریخ ۱۳۹۹/۰۱/۰۹ با شماره ثبت ۵۵۶۲۰۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر ثبت عبارت است از: تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالداسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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 حفظ ارزش دماوند در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۳۰، تعداد ۱۰۰,۰۵۸,۳۰۳ واحد بوده که این تعداد شامل ۹۰,۰۵۸,۳۰۳ 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 ۱۴۰۴/۱۱/۳۰

ردیف	تعداد واحد سرمایه‌گذاری ممتاز	تعداد واحد سرمایه‌گذاری عادی	نرخ صدور (ریال)	نرخ ابطال (ریال)	خالص ارزش آماری (ریال)
۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰,۰۵۸,۳۰۳	۱۸,۵۴۴	۱۸,۳۷۶	۱۸,۳۷۶

۵- صورت خالص دارایی‌ها در تاریخ ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

یادداشت	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۳۰
	ریال	ریال	ریال
دارایی‌ها			
سرمایه‌گذاری در سهام	۵	۱,۵۳۴,۸۶۵,۴۱۵,۹۱۸	۳,۳۹۵,۷۹۴,۲۷۸,۵۳۶
سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده کالا	۶	۹۲,۳۳۵,۵۶۳,۰۱۶	۰
سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۷	۵۸,۳۶۵,۵۹۸,۳۰۳	۳۴۳,۶۳۷,۳۶۱,۸۲۸
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۸	۲۴۶,۰۶۲,۶۱۹,۵۹۳	۵۳۱,۲۸۸,۳۱۴,۶۹۹
حساب‌های دریافتی	۹	۱۴۸,۹۱۸,۳۴۴	۳,۹۹۹,۹۸۰,۹۴۲
سایر دارایی‌ها	۱۰	۱,۰۷۲,۳۸۶,۷۳۰	۴,۵۶۵,۷۵۴,۳۱۶
جمع دارایی‌ها		۱,۹۳۲,۸۵۰,۵۰۱,۹۰۴	۴,۲۷۹,۲۸۵,۶۹۰,۳۲۱
بدهی‌ها			
جاری کارگزاران	۱۱	۳۶,۸۸۰,۱۳۲,۳۱۴	۶۲۲,۲۱۵,۹۰۶,۲۶۶
بدهی به ارکان صندوق	۱۲	۵۲,۵۶۱,۶۸۶,۹۷۵	۱۸۱,۹۶۸,۶۸۴,۰۸۲
بدهی به سرمایه‌گذاران	۱۳	۹۱,۸۸۰,۰۰۰	۴۴۰,۰۰۰,۲۰۰,۰۰۰
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۱۴	۴,۶۲۴,۱۴۵,۶۴۶	۲۱۹,۹۹۸,۵۷۲,۳۱۴
جمع بدهی‌ها		۹۴,۱۵۷,۸۴۴,۹۳۵	۱,۴۴۴,۱۹۳,۳۶۲,۶۶۲
خالص دارایی‌ها	۱۵	۱,۸۳۸,۶۹۲,۶۵۶,۹۶۹	۲,۸۱۵,۰۹۲,۳۲۷,۶۵۹
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال		۱۸,۳۷۶	۱۹,۷۱۶

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

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

یادداشت	دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴	دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۳
	ریال	ریال
درآمدها:		
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۶ (۳۷۲,۸۵۶,۷۳۴,۶۴۳)	۵۵۴,۹۷۹,۶۹۰,۶۵۱
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۷ ۴۸,۳۱۵,۷۷۰,۶۷۱	۳۱۵,۰۸۱,۲۳۷,۴۷۵
سود سهام	۱۸ ۸۴,۴۷۳,۰۳۰,۴۱۴	۱۵۷,۹۹۴,۰۲۶,۳۲۸
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی‌الحساب	۱۹ ۸۶,۰۷۴,۶۴۲,۸۰۹	۲۶۵,۸۲۹,۳۴۵,۹۰۷
سایر درآمدها	۲۰ ۲,۰۹۲,۶۶۸,۳۴۴	۶۳۱,۷۲۰,۱۵۹
جمع درآمدها	(۱۵۱,۹۰۰,۶۲۲,۴۰۵)	۱,۲۹۴,۵۱۶,۰۲۰,۵۲۰
هزینه‌ها:		
هزینه کارمزد ارکان	۲۱ ۳۲,۳۳۱,۰۸۱,۲۰۴	۷۴,۶۶۹,۵۱۰,۴۷۵
سایر هزینه‌ها	۲۲ ۹,۰۶۸,۵۳۶,۶۱۰	۴,۶۸۲,۲۹۷,۴۷۸
سود (زیان) قبل از هزینه‌های مالی	(۱۹۳,۳۰۰,۲۴۰,۲۱۹)	۱,۲۱۵,۱۶۴,۲۱۲,۵۶۷
هزینه‌های مالی	۲۳ ۵۵,۳۰۸,۷۶۴,۱۱۳	۱۲۴,۶۹۲,۳۴۰,۹۴۲
سود خالص	(۲۴۸,۶۰۹,۰۰۴,۳۳۲)	۱,۰۹۰,۴۷۱,۸۷۱,۶۲۵
بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)	(۱۱.۶۰)	۲۹.۶۹
بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)	(۱۳.۲۶)	۳۹.۳۷

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

جدول و نمودار زیر، ترکیب دارایی‌های صندوق در پایان دوره منتهی به ۳۰ بهمن 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	۱,۵۳۴,۸۶۵,۴۱۵,۹۲۸	۷۹.۴۱
اوراق با درآمد ثابت	۲۴۴,۴۱۲,۸۱۴,۰۶۲	۱۲.۶۵
نقد و بانک	۵۸,۳۶۵,۵۹۸,۳۰۳	۳.۰۲
گواهی سپرده کالایی	۹۲,۳۳۵,۵۶۳,۰۱۶	۴.۷۸
حسابهای دریافتی تجاری	۱۴۸,۹۱۸,۳۴۴	۰.۰۱
سایر دارایی‌ها	۲,۷۲۲,۱۹۲,۳۶۱	۰.۱۴
جمع کل	۱,۹۳۲,۸۵۰,۵۰۱,۹۱۴	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

دوره نه ماهه منتهی به ۳۰ بهمن 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.

بازده شاخص(درصد)	بازده صندوق(درصد)	تا تاریخ	از تاریخ	توضیحات
۸۷.۹۹۱	۸۳.۷۶	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون
۳۹.۳۲۸	۶.۲۷۵	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۳/۱۲/۰۱	۳۶۵ روز گذشته
۵۴.۰۶	۳۴.۴۳۶	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۰۶/۰۱	۱۸۰ روز گذشته
۲۰.۱۴۲	۷.۸۵۳	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۰۸/۳۰	۹۰ روز گذشته
(۱۴.۹۹۹)	(۱۰.۷۲۷)	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۱۰/۳۰	۳۰ روز گذشته
(۵.۵۳۵)	(۴.۳۳۷)	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۲۳	هفت روز گذشته
.	.	۱۴۰۴/۱۱/۳۰	۱۴۰۴/۱۱/۲۹	یک روز گذشته

۹- برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی

باتوجه به کم‌رونق بودن سال‌های اخیر بازار سرمایه و برهم خوردن آرامش سیاسی کشور طی جنگ ۱۲ روزه و در نتیجه کاهش شاخص‌های بورس و فرابورس تمامی صندوق‌های سرمایه‌گذاری در سهام دچار کاهش نرخ NAV شده‌اند، در این شرایط مدیریت صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند امیدوار است با توجه به بسته‌های حمایتی در نظر گرفته شده جهت کنترل بازار، تکیه بر موقعیت‌های 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

