



صندوق سرمایه‌گذاری
حفظ ارزش دماوند
در سهام مبتنی بر صدور و ابطال
گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۱- کلیات

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند از انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری مبتنی بر صدور و ابطال 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، خالد اسلامبولی، کوچه سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ۴، 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:

۲-۱- مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. در تاریخ صورت خالص دارایی‌ها دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است:

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

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۲-۲ متولی صندوق، موسسه حسابرسي ایرانیان تحلیل فارابی است که در تاریخ ۱۳۸۸/۰۳/۲۷ با شماره ثبت ۳۵۳۰۲۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، یوسف آباد-خ نهم-نبش این سینا- پ ۶ - طبقه ۳ - واحد ۶.

۲-۳ حسابرس صندوق، موسسه حسابرسي 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

۲-۴ 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

۲-۵ 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 عبارت است از : تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالداسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۲-۶ 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 عبارت است از : تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالداسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ششم، واحد جنوب غربی

۳- گروه مدیران سرمایه‌گذاری:

- آزاده شکری

- امیرعلی عباس‌زاده‌اصل

- ابراهیم ساجد نیلاتجق

۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۲/۳۱

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	۸۹,۹۶۹,۷۳۰	۱۶,۱۲۷	۱۵,۹۷۴	۱۸,۲۵۳

۵- صورت خالص و ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۱-۵- جدول زیر، ترکیب سرمایه‌گذاری‌های صندوق در دوره مالی مورد گزارش را نشان می‌دهد.

صورت خالص دارایی ها		
عنوان	ارزش (ریال)	درصد
سهام و حق تقدم	۱,۴۰۱,۸۵۷,۶۴۲,۶۷۰	۸۴,۶۸
اوراق با درآمد ثابت	۱۲۳,۱۰۵,۵۸۶,۰۱۹	۷,۴۳
گواهی سپرده کالایی	۹۴,۴۹۲,۸۲۷,۰۲۷	۵,۷۰
نقد و بانک	۲۴,۷۷۶,۵۶۳,۳۸۵	۱,۴۹
حساب‌های فی ما بین با کارگزاران	۷,۵۸۹,۷۲۸,۰۹۶	۰,۴۵
حسابهای دریافتی تجاری	۲,۷۱۷,۳۶۶,۶۳۴	۰,۱۶
سایر دارایی ها	۸۳۰,۱۳۶,۹۸۸	۰,۰۵
جمع دارایی‌ها	۱,۶۵۵,۳۶۹,۸۵۰,۸۱۹	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

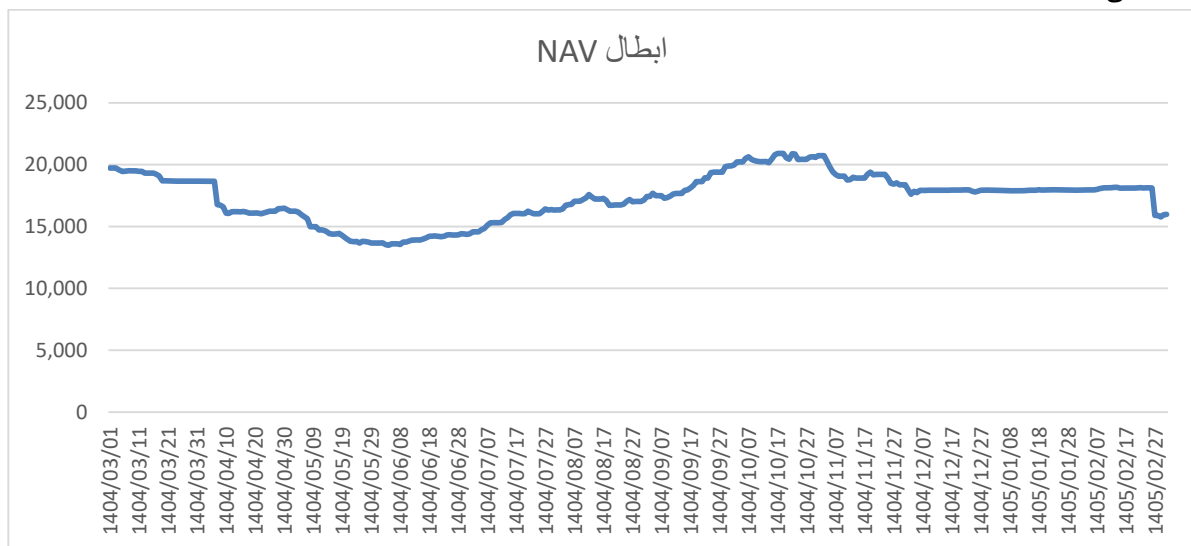
سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۵-۲- ترکیب دارایی‌های صندوق در سهام به تفکیک صنعت در تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ به شرح جدول زیر می‌باشد:

نام صنعت	ارزش ریالی	درصد از کل دارایی‌ها
خودرو و ساخت قطعات	۴۰۵,۴۱۱,۰۴۰,۲۳۲	۲۴.۴۹
بانکها و موسسات اعتباری	۳۰۴,۲۹۰,۰۹۵,۳۵۶	۱۸.۳۸
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱۶۰,۰۰۶,۵۱۴,۳۱۰	۹.۶۷
شرکت‌های چند رشته ای صنعتی	۱۴۶,۰۶۴,۹۴۹,۱۷۷	۸.۸۲
فلزات اساسی	۱۱۷,۸۵۶,۵۴۵,۸۴۱	۷.۱۲
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۱۱۱,۲۱۲,۳۲۲,۵۳۲	۶.۷۲
محصولات شیمیایی	۵۷,۹۴۰,۷۹۹,۰۴۹	۳.۵۰
استخراج کانه های فلزی	۲۲,۶۱۳,۷۲۲,۱۱۰	۱.۳۷
مواد و محصولات دارویی	۲۱,۱۰۰,۷۷۰,۷۲۱	۱.۲۷
ساخت محصولات فلزی	۱۹,۰۵۶,۲۵۳,۲۳۳	۱.۱۵
سرمایه گذاریها	۱۳,۵۷۷,۵۵۷,۹۶۵	۰.۸۲
زراعت و خدمات وابسته	۱۲,۹۱۳,۷۹۸,۶۸۸	۰.۷۸
ماشین آلات و دستگاه‌های برقی	۵,۴۰۵,۸۸۶,۹۶۰	۰.۳۳
لاستیک و پلاستیک	۳,۶۵۲,۵۴۵,۸۷۰	۰.۲۲
مخابرات	۷۵۴,۸۴۰,۶۲۶	۰.۰۵

۶- خالص ارزش دارایی‌های صندوق

شاخص ارزیابی صندوق‌های سرمایه‌گذاری، خالص ارزش دارایی‌های صندوق (NAV) به ازای هر واحد عادی می‌باشد، نمودار زیر بیانگر تغییرات شاخص یادشده در صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند از ابتدای دوره مالی تا انتهای سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ می‌باشد



صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۷- بازدهی صندوق

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند برای سال مالی منتهی به تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول ذیل آمده است.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازده صندوق (درصد)	بازده شاخص (درصد)
از ابتدای فعالیت صندوق تا کنون	۱۴۰۲/۰۷/۲۹	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	۵۹.۷۴	۸۵.۷۴
۳۶۵ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۲/۳۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	(۱۸.۹۸)	۲۱.۰۱
۱۸۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۰۹/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	(۶.۸)	۱۷.۶۲
۹۰ روز گذشته	۱۴۰۴/۱۲/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	(۱۳.۰۷)	(۱.۱۹)
۳۰ روز گذشته	۱۴۰۵/۰۲/۰۱	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	(۱۰.۹۵)	۱.۲۷
هفت روز گذشته	۱۴۰۵/۰۲/۲۴	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	(۱۱.۸۹)	۱.۲۷
یک روز گذشته	۱۴۰۵/۰۲/۳۰	۱۴۰۵/۰۲/۳۱	۰.۱۱	۰

۸- برنامه ها و فعالیت های آتی

ا توجه به کم رونق بودن سال های اخیر بازار سرمایه و مشکلات سیاسی ایجاد شده ناشی از جنگ تحمیلی ، به علاوه افزایش قیمت دلار در ماه های اخیر، پیش بینی می شود پس از بازگشت آرامش و ثبات ؛ یکی از بازارهای مورد توجه سرمایه گذاران در سال پیش رو، بازار سرمایه باشد. در همین راستا، مدیر صندوق از طریق ایجاد پلتفرم " قله " و هدف قراردادن گروه های مختلف سرمایه گذاران شامل حقیقی و حقوقی، مترصد آن است که بازاریابی مجدد و مدیریت شده ای را در پیش گیرد. همچنین از طریق باز طراحی تارنماهای مربوط به صندوق سرمایه گذاری و سامانه " قله " و نیز انجام تبلیغات موردی، مدیر صندوق به دنبال معرفی هر چه بهتر صندوق بین عموم خواهد بود. در نهایت با تقویت تیم مستقیم سرمایه گذاری و جذب مشاوران حرفه ای مدیریت دارایی، پیش بینی می شود در سال مالی پیش رو، در صندوق تحولات قابل توجهی ایجاد شود.

ارکان صندوق	شخص حقوقی	نماینده	امضاء
مدیر صندوق	شرکت تامین سرمایه دماوند	محسن عرب زاده	

