



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

دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ مرداد 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.

۲-۱- 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 سرمایه-

گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده اند شامل اشخاص زیر است:

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

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

۲-۲ متولی صندوق، موسسه حسابرسی 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 ابن سینا- پ ۶ - طبقه ۳ - واحد ۶.

۲-۳ 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

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:

- نگین جلی

- محسن یزدانیان نجف آبادی

- ابراهیم ساجد نیلاتجق

۴- اطلاعات صندوق در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۳۱

ردیف	تعداد واحد سرمایه‌گذاری ممتاز	تعداد واحد سرمایه‌گذاری عادی	نرخ صدور (ریال)	نرخ ابطال (ریال)	خالص ارزش آماری (ریال)
۱	۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۹۶,۶۱۱,۰۲۵	۲۸,۷۸۵	۲۸,۵۳۰	۲۸,۵۳۰

۵- صورت خالص و ترکیب دارایی های صندوق در تاریخ ۳۱ مرداد 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	۲,۴۸۳,۳۱۶,۴۷۶,۴۲۷	۸۰.۲
اوراق با درآمد ثابت	۳۸۸,۵۵۴,۱۸۵,۲۶۰	۱۲.۵۵
گواهی سپرده کالایی	۱۵۰,۴۸۳,۷۹۹,۳۰۰	۴.۸۶
نقد و بانک	۲۱,۳۳۲,۳۳۲,۴۹۱	۰.۶۹
حساب‌های فی ما بین با کارگزاران	۶۳۳,۱۳۱,۱۲۰	۰.۰۲
حسابهای دریافتی تجاری	۴۶,۳۵۰,۶۶۵,۷۲۳	۱.۵
سایر دارایی ها	۵,۵۵۳,۸۹۸,۲۹۶	۰.۱۸
جمع دارایی‌ها	۳,۰۹۶,۲۲۴,۴۸۸,۶۱۷	۱۰۰

صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند

گزارش عملکرد

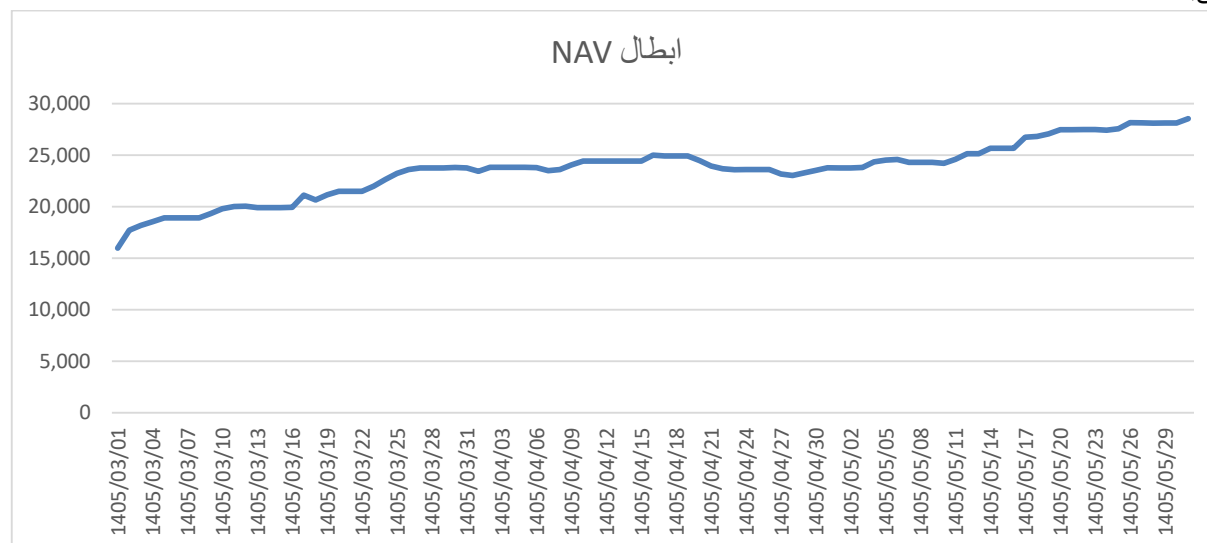
دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

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

ردیف	نام صنعت	ارزش ریالی	درصد از کل دارایی‌ها
۱	خودرو و ساخت قطعات	۶۰,۹۸۹,۸۷۵,۵۵۰	۱.۹۷
۲	بانکها و موسسات اعتباری	۳۳۷,۰۵۲,۰۹۲,۷۵۸	۱۰.۸۹
۳	فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۳۹۶,۰۸۸,۳۳۷,۹۲۶	۱۲.۷۹
۴	شرکت‌های چند رشته ای صنعتی	۴۶۸,۰۰۶,۷۷۱,۳۲۰	۱۵.۱۲
۵	فلزات اساسی	۱۶۷,۶۲۲,۱۷۵,۶۸۴	۵.۴۱
۶	فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۳۴۶,۲۵۲,۶۱۶,۵۰۰	۱۱.۱۸
۷	محصولات شیمیایی	۷۷,۲۳۸,۲۹۶,۸۰۰	۲.۴۹
۸	استخراج کانه های فلزی	۳,۳۷۷,۹۱۹,۲۵۱	۰.۱۱
۹	مواد و محصولات دارویی	۱۹۳,۳۷۶,۶۰۴,۰۰۳	۶.۲۵
۱۰	زراعت و خدمات وابسته	۲۶,۰۵۳,۰۴۱,۱۲۰	۰.۸۴
۱۱	حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۷۲,۰۴۷,۷۳۲,۴۳۰	۲.۳۳
۱۲	محصولات غذایی و آشامیدنی به جز قند و شکر	۱۹۶,۱۸۶,۱۹۴,۴۶۰	۱۰.۸۹
۱۳	سیمان، آهک و گچ	۶۹,۴۸۸,۰۲۵,۴۲۶	۲.۲۴
۱۴	کاشی و سرامیک	۶۳,۵۶۰,۸۴۷,۱۲۰	۲.۰۵
۱۵	محصولات کاغذی	۵,۹۷۵,۹۴۶,۰۷۵	۰.۱۹

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 دوره مالی منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵ می‌باشد



صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند
گزارش عملکرد
دوره مالی ۳ ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

۷- بازدهی صندوق

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش دماوند برای دوره مالی ۳ ماهه منتهی به تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۵ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول ذیل آمده است.

توضیحات	از تاریخ	تا تاریخ	بازدهی صندوق	بازدهی بازار
روز اخیر	۱۴۰۵/۰۵/۳۰	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۱.۴۸	%۱.۸۳
هفته گذشته	۱۴۰۵/۰۵/۲۴	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۴.۰۴۸	%۵.۶۶۴
ماه گذشته	۱۴۰۵/۰۵/۰۱	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۲۰.۱۲۶	%۲۴.۱۱۱
۹۰ روز اخیر	۱۴۰۵/۰۳/۰۳	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۵۶.۸۹۶	%۵۵.۰۳۶
۱۸۰ روز اخیر	۱۴۰۴/۱۲/۰۴	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۵۹.۹۷۵	%۶۴.۷۰۹
یک سال اخیر	۱۴۰۴/۰۵/۳۱	۱۴۰۵/۰۵/۳۱	%۸۰.۷۸۲	%۱۴۴.۸۹۲

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 تارنما های مربوط به صندوق های سرمایه گذاری و سامانه "قله" و نیز انجام تبلیغات موردی، مدیریت صندوق به دنبال معرفی هرچه بیشتر 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	

