



صندوق سرمایه‌گذاری
لاچورد دماوند
اختصاصی بازارگردانی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاچورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

۱- کلیات

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند در تاریخ ۱۳۹۹/۱۲/۰۶ تحت شماره ۱۱۸۱۳ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و تحت شماره ۵۱۲۳۱ و شناسه ملی ۱۴۰۰۹۸۴۳۴۹۴ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری استان تهران به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق امیدنامه و کسب منابع از این محل است. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه ۳ سال است. طبق مجمع مورخ ۱۴۰۰/۱۰/۲۸ افزایش سقف واحدهای سرمایه‌گذاری قابل صدور صندوق از ۱۰.۰۰۰.۰۰۰ واحد به ۳۰.۰۰۰.۰۰۰ واحد به تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است و طبق مجمع مورخ ۱۴۰۱/۰۳/۰۴ افزایش سقف واحدهای سرمایه‌گذاری قابل صدور صندوق از ۳۰.۰۰۰.۰۰۰ واحد به ۱۲۰.۰۰۰.۰۰۰ واحد به تایید سازمان بورس و اوراق بهادار رسیده است. طبق مجمع مورخ ۱۴۰۲/۱۱/۰۷ فعالیت صندوق به مدت ۳ سال تا تاریخ ۱۴۰۵/۱۱/۲۵ تمدید گردید. مرکز اصلی صندوق در تهران، میدان آرژانتین، خیابان خالد اسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ۴ واقع شده است.

۲-۱- اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند در تارنمای صندوق به آدرس www.damavandfunds.ir درج گردیده است.

۲-۲- ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

۱-۲- 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	۳۱.۵۰۰	۹۰٪
۲	شرکت سرمایه‌گذاری اعتضاد غدیر	۳.۵۰۰	۱۰٪
	جمع	۳۵.۰۰۰	۱۰۰٪

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.

۲-۴- حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی بیات رایان است که در تاریخ ۱۳۵۷/۰۲/۰۷ با شماره ثبت ۱۹۱۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: تهران-خیابان بخارست- کوچه پژوهشگاه دوم- پلاک ۲۲- طبقه

دوم

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

۲-۵ 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 ثبت عبارت است از : تهران، شهرستان تهران، بخش مرکزی، شهر تهران، آرژانتین، ساعی، خیابان شهید خالد اسلامبولی، خیابان سیزدهم، پلاک ۱۸، طبقه ۴، واحد شمال شرقی.

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. واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رأی در مجمع بوده قابل انتقال، اما غیرقابل ابطال می‌باشد. تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی لاجورد دماوند در تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۳۰، تعداد ۵۳،۴۴۹،۳۹۹ واحد بوده که این تعداد شامل ۵۳،۴۱۴،۳۹۹ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۳۵،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد. وضعیت تملک واحدهای سرمایه‌گذاری برحسب اشخاص حقیقی و حقوقی در پایان دوره مالی مورد گزارش به شرح ذیل است:

تعداد	دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری
۲۰	حقوقی
۰	حقیقی
۲۰	جمع

۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان سال مالی

۴-۱- جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه‌گذاری‌های صندوق در سال مالی مورد گزارش را نشان می‌دهد.

ترکیب دارایی‌های صندوق	
خالص ارزش	عنوان
۵۳,۰۵۸,۸۷۳,۳۵۶,۷۱۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۵,۸۸۶,۲۶۲,۸۱۳,۰۸۶	سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌ها
۴۹۹,۷۶۶,۳۸۱,۷۵۸	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت
۲۱۳,۰۹۶,۷۵۲,۰۹۴	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۷,۱۹۲,۹۶۵,۹۰۳,۶۷۸	حساب‌های دریافتی
۱,۰۴۷,۶۹۹,۷۴۹	سایر دارایی‌ها
۲,۲۷۱,۷۶۸	موجودی نقد
۶۶,۸۵۲,۰۱۵,۱۷۸,۸۴۷	جمع

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

۲-۴- ترکیب دارایی‌های صندوق در سهام و حق تقدم به تفکیک صنعت در تاریخ ۳۰ بهمن ۱۴۰۴ به شرح جدول زیر می‌باشد:

نام صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
فلزات اساسی	۳۸,۸۲۶,۶۴۱,۷۶۰,۱۹۸	۲۷,۸۶۱,۳۹۰,۴۳۷,۸۰۴
سرمایه گذاری ها	۸,۱۳۵,۷۳۶,۵۱۹,۴۱۶	۹,۴۸۵,۵۷۳,۶۶۴,۵۶۴
سیمان، آهک و گچ	۵,۳۱۱,۶۰۶,۶۲۶,۹۶۰	۷,۶۷۳,۱۰۷,۴۹۹,۲۱۳
شرکتهای صنعتی چند رشته ای	۷,۲۲۵,۷۸۶,۷۹۹,۰۶۲	۵,۹۴۲,۲۵۱,۰۹۲,۲۳۵
صندوق سرمایه گذاری قابل معامله	۵,۵۳۷,۱۰۶,۳۴۹,۷۸۶	۵,۸۸۶,۲۶۲,۸۱۳,۰۹۷
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱,۱۷۶,۴۵۴,۴۷۴,۶۰۱	۸۸۱,۶۶۲,۱۴۲,۰۲۹
سایر واسطه گریهای مالی	۴۶۴,۴۹۵,۷۵۴,۳۳۶	۵۶۹,۷۷۹,۰۳۸,۵۷۶
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳۲۵,۷۲۲,۵۴۸,۸۴۰	۲۳۶,۰۸۱,۸۰۴,۷۶۴
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۵۷,۲۵۱,۸۰۱,۱۵۰	۱۷۲,۷۱۹,۹۰۳,۰۲۵
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۳۲,۱۳۷,۱۷۵,۷۰۷	۱۲۹,۰۴۵,۵۱۹,۴۹۲
استخراج نفت گاز و خدمات جنبی جز اکتشاف	۷۱,۹۱۸,۹۶۹,۹۸۱	۵۷,۵۸۷,۳۵۶,۷۷۲
بیمه و صندوق بازنشستگی به جز تامین اجتماعی	۶۸,۷۹۴,۲۹۱,۱۶۲	۴۹,۶۷۴,۸۹۸,۲۴۰
اوراق با درآمد ثابت	۴۸۶,۹۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۴۹۹,۷۶۶,۳۸۱,۷۵۸
جمع	۶۷,۹۲۰,۵۵۳,۰۷۱,۱۹۹	۵۹,۴۴۴,۹۰۲,۵۵۱,۵۶۹

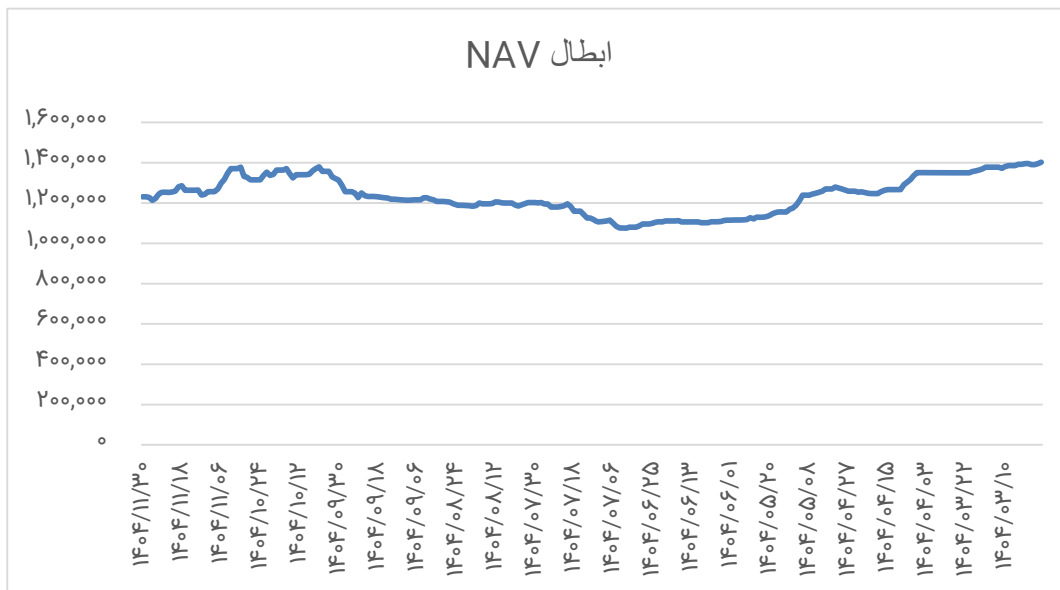
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

۵- خالص ارزش دارایی‌های صندوق

شاخص ارزیابی صندوق‌های سرمایه‌گذاری، خالص ارزش دارایی‌های صندوق (NAV) به ازای هر واحد می‌باشد، نمودار زیر بیانگر تغییرات شاخص یادشده در صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن می‌باشد.



۶- بازدهی صندوق

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند برای سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول ذیل آمده است.

شرح	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۰ بهمن ۱۴۰۴	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۰ بهمن ۱۴۰۳
صندوق سرمایه‌گذاری NAV	۱,۲۳۰,۷۷۳	۱,۳۵۱,۰۹۶
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۳,۸۰۶,۷۶۵	۲,۷۱۹,۳۳۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۰ بهمن ۱۴۰۴

۷- استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند با هدف ایجاد تعادل در معاملات، کاهش نوسانات غیر منطقی و ارتقای نقدشوندگی نمادهای تحت بازارگردانی و کسب منافع در چارچوب تعهدات بازارگردانی تشکیل شده است. تیم مدیریت صندوق با رصد لحظه‌ای جریان سفارش‌ها، تحلیل شرایط بازار و پایش عمق تقاضا و عرضه، تلاش می‌کند تا از طریق ورود هوشمندانه منابع مالی، ثبات معاملاتی و کارایی قیمتی را در نمادهای هدف تقویت کند. رویکرد اصلی صندوق مبتنی بر مدیریت فعال سفارش‌ها، تنظیم دامنه نوسان قیمتی، جلوگیری از فشارهای ناگهانی خرید و فروش و حمایت منطقی از تابلو معاملات است. تمرکز صندوق بر شفافیت در اجرای دستورالعمل‌ها، چابکی در واکنش به شرایط بازار و رعایت استانداردهای نظارتی، ستون اصلی استراتژی فعالیت آن را تشکیل می‌دهد.

مدیریت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند در سال پیش رو، برنامه توسعه فعالیت خود را بر ارتقای کیفیت بازارگردانی و تقویت سازوکار نقدشوندگی متمرکز کرده است. این رویکرد شامل افزایش سرعت و دقت در پردازش سفارشات، توسعه مدل‌های الگوریتمی برای پیش‌بینی فشارهای خرید و فروش و بهبود فرآیند مداخله حمایتی در دوره‌های پرنوسان بازار است. همچنین صندوق به دنبال بهبود پیوسته عملکرد از طریق افزایش کارایی سرمایه در گردش، تنظیم بهینه منابع بازارگردانی بر اساس رفتار معامله‌گران و توسعه چارچوب‌های مدیریت ریسک اختصاصی خواهد بود. هدف نهایی، ایجاد بازاری روان‌تر، عمیق‌تر و قابل‌اتکاتر برای سرمایه‌گذاران و ایفای نقشی پایدار در تقویت کیفیت معاملات نمادهای تحت بازارگردانی است.

امضاء	نماینده	شخص حقوقی	ارکان صندوق
	میلاذ فروغی	شرکت تامین سرمایه دماوند	مدیر صندوق



صندوق اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند
شماره ثبت: ۵۱۲۳۱