



صندوق سرمایه‌گذاری
لاجورد دماوند
اختصاصی بازارگردانی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

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 منافع 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- 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

سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۵-۲ 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 ۱۴۰۵/۰۲/۳۱، تعداد ۵۲,۷۷۴,۳۲۳ واحد بوده که این تعداد شامل ۵۲,۷۳۹,۳۲۳ 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
۱۹	حقوقی
۰	حقیقی
۱۹	جمع

۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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

ترکیب دارایی های صندوق	
عنوان	خالص ارزش
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۴۹,۹۴۵,۴۹۷,۲۱۷,۵۶۶
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق ها	۴,۴۴۲,۹۴۶,۰۰۸,۰۴۱
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱,۴۸۳,۵۴۸,۳۷۸,۱۵۷
سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۱۲۹,۹۳۵,۱۹۷,۴۱۳
حساب های دریافتنی	۷,۳۴۱,۸۱۳,۵۴۲,۹۱۸
سایر دارایی‌ها	۵,۱۱۱,۷۷۲,۳۸۹
موجودی نقد	۱,۴۷۲,۶۸۸
جمع	۶۳,۳۴۸,۸۵۳,۵۸۹,۱۷۲

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

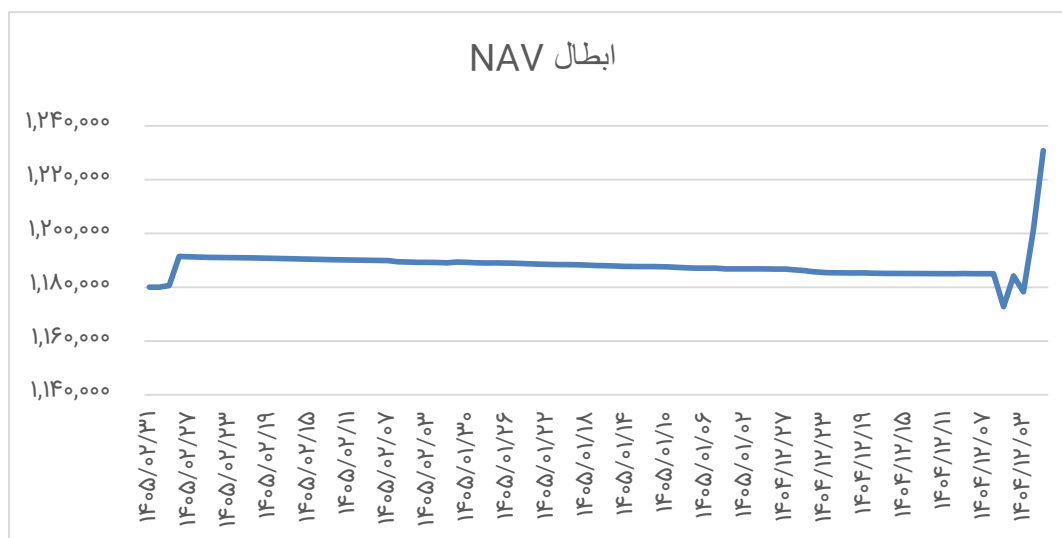
سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۴-۲- ترکیب دارایی‌های صندوق در سهام و حق تقدم به تفکیک صنعت در تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ به شرح جدول زیر می‌باشد:

نام صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش
فلزات اساسی	۳۸,۸۳۹,۶۶۷,۱۲۳,۸۳۰	۲۵,۱۵۰,۷۱۹,۰۱۰,۳۷۱
سرمایه گذاریها	۸,۲۰۲,۳۷۵,۱۸۷,۹۸۲	۹,۴۵۳,۵۸۳,۹۷۹,۵۹۶
سیمان، آهک و گچ	۵,۳۵۱,۶۴۶,۳۲۱,۵۳۸	۷,۶۱۴,۳۸۷,۹۳۱,۸۵۶
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۷,۳۲۹,۳۷۵,۴۲۵,۸۱۰	۵,۷۲۱,۹۹۲,۶۴۵,۷۳۸
صندوق سرمایه گذاری قابل معامله	۴,۰۰۹,۴۰۹,۸۵۱,۲۴۲	۴,۴۴۲,۹۴۶,۰۰۸,۰۴۷
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱,۱۷۸,۲۶۲,۰۰۸,۸۶۱	۹۲۰,۴۹۹,۷۵۹,۹۰۶
سایر واسطه گریهای مالی	۴۹۰,۵۳۸,۲۲۹,۹۶۵	۴۷۶,۹۹۷,۹۴۳,۲۲۶
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳۳۰,۴۵۶,۶۲۷,۴۶۸	۲۴۸,۰۰۸,۴۲۳,۲۷۳
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۱۶۱,۵۴۷,۴۱۹,۲۰۷	۱۷۵,۷۶۴,۵۱۷,۳۶۸
عرضه برق، گاز، بخار و آب گرم	۱۳۷,۱۹۴,۷۴۰,۶۱۶	۱۳۷,۶۸۶,۳۵۶,۶۱۱
بیمه و صندوق بازنشتی به جز تامین اجتماعی	۶۸,۷۹۴,۲۹۱,۱۶۲	۴۵,۸۵۶,۶۴۹,۶۲۹
جمع	۶۶,۰۹۹,۲۶۷,۲۲۷,۶۸۱	۵۴,۳۸۸,۴۴۳,۲۲۵,۶۲۱

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 دوره مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ می‌باشد.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد

سه ماهه منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵

۶- بازدهی صندوق

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند برای دوره مالی منتهی به ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول ذیل آمده است.

شرح	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۵	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۴
صندوق سرمایه‌گذاری NAV	۱,۱۸۰,۰۳۸	۱,۳۹۴,۸۹۶
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۳,۷۶۱,۳۰۴	۳,۱۰۸,۱۱۸

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.

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

