صندوق سرمایه‌گذاری
لاجورد دماوند
اختصاصی بازارگردانی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد میان‌دوره‌ای

شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند

گزارش عملکرد میان‌دوره‌ای

شش ماهه منتهی به ۳۱ مرداد ۱۴۰۵

۱- کلیات

۱-۱- تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی لاجورد دماوند درتاریخ 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، جمع آوری 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 سرمایه گذاری 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 سرمایه گذاری 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.

۱-۲- 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:

۲-۱ مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می شود. 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 سرمایه گذاری 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 شمارهٔ 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

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 دستهٔ 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 سرمایه گذاری اختصاصی لاجورد دماوند در تاریخ ۱۴۰۵/۰۵/۳۱، تعداد ۲۶,۹۹۸,۹۴۱ واحد بوده که این تعداد شامل ۲۶,۹۶۳,۹۴۱ 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:

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری	تعداد
حقوقی	۱۴
حقیقی	۰
جمع	**۱۴**

۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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

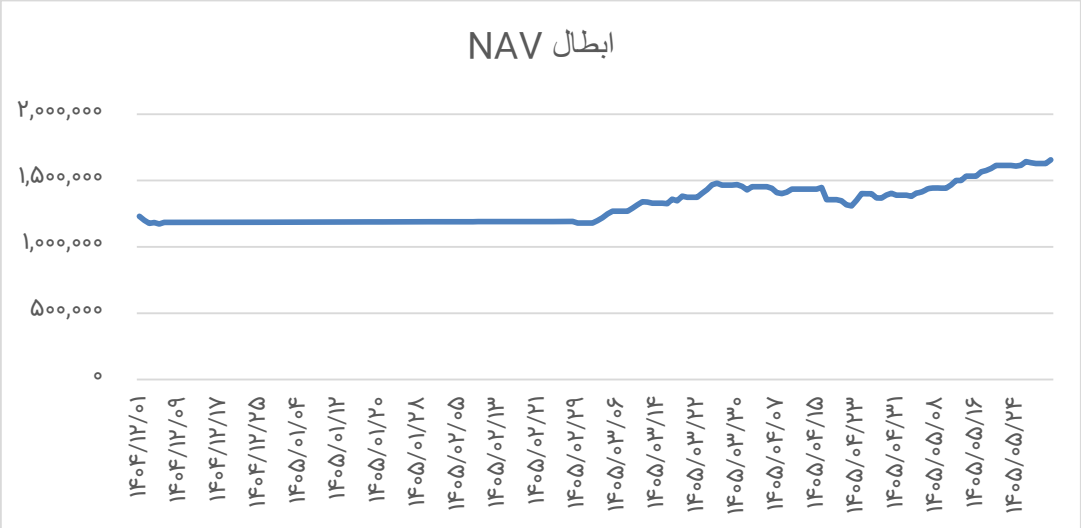
ترکیب دارایی های صندوق		
عنوان	**خالص ارزش**	**درصد به کل دارایی‌ها**
سرمایه‌گذاری در سهام	۳۳,۳۲۷,۸۱۶,۶۸۴,۱۵۰	۷۳.۶۱
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌ها	۳,۲۳۷,۲۰۳,۶۲۹,۹۲۹	۷.۱۵
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱,۵۸۶,۲۸۷,۱۸۶,۴۶۲	۳.۵
سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی	۳۲۳,۳۵۵,۱۰۳,۲۹۹	۰.۷۱
حساب‌های دریافتنی	۶,۴۵۹,۸۱۵,۳۵۲,۰۳۵	۱۴.۲۶
سایر دارایی‌ها	۵,۱۵۱,۹۲۴,۴۰۶	۰.۰۲
موجودی نقد	۱,۳۵۵,۶۸۸	۰
جاری کارگزاران	۳۳۸,۰۹۴,۷۲۷,۶۶۲	۰.۷۵
جمع	**۴۵,۲۷۷,۷۲۵,۹۶۳,۶۳۱**	**۱۰۰**

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

نام صنعت	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	درصد به کل دارایی‌ها
سرمایه‌گذاری‌ها	۸,۴۲۵,۹۳۰,۸۶۸,۸۱۱	۱۱,۶۳۱,۴۵۲,۰۶۸,۸۹۱	۲۵.۶۹
شرکت‌های چند رشته‌ای صنعتی	۷,۰۱۶,۲۳۷,۴۵۵,۷۲۷	۹,۰۸۶,۳۲۰,۳۸۱,۹۱۹	۲۰.۰۷
فلزات اساسی	۷,۵۳۵,۴۳۹,۲۸۷,۳۲۰	۵,۱۴۰,۰۵۳,۸۸۲,۰۴۸	۱۱.۳۵
سیمان، آهک و گچ	۲,۳۱۱,۶۱۶,۷۷۱,۷۳۳	۴,۸۸۶,۲۸۳,۲۵۹,۸۵۹	۱۰.۷۹
فعالیت‌های کمکی به نهادهای مالی واسط	۱,۳۱۸,۶۸۱,۸۷۵,۶۶۴	۱,۰۲۸,۵۷۷,۸۶۰,۴۶۰	۲.۲۷
سایر واسطه گریهای مالی	۴۹۴,۳۲۶,۳۵۷,۶۱۲	۶۵۴,۵۴۱,۹۲۲,۶۲۸	۱.۴۵
انبوه سازی، املاک و مستغلات	۳۳۱,۴۸۹,۴۳۱,۴۸۶	۳۹۲,۲۶۷,۶۴۹,۸۴۰	۰.۸۷
حمل ونقل، انبارداری و ارتباطات	۱۲۰,۱۳۷,۲۰۹,۳۸۳	۲۴۶,۳۰۴,۰۰۲,۵۸۵	۰.۵۴
عرضه برق، گاز، بخاروآب گرم	۱۳۳,۵۳۱,۸۴۷,۶۸۷	۲۱۳,۵۱۷,۶۰۳,۲۰۰	۰.۴۷
بیمه وصندوق بازنشستگی به جزتامین اجتماعی	۶۸,۶۰۵,۴۴۳,۰۲۰	۴۸,۴۹۸,۰۵۲,۷۲۰	۰.۱۱
جمع	**۲۷,۷۵۵,۹۹۶,۵۴۸,۴۴۳**	**۳۳,۳۲۷,۸۱۶,۶۸۴,۱۵۰**	**۷۳.۶۱**

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 مرداد ۱۴۰۵می‌باشد.



۶- بازدهی صندوق

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

شرح	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۵	نرخ هر واحد در تاریخ ۳۱ مرداد ۱۴۰۴
صندوق سرمایه‌گذاری	۱,۶۵۶,۲۳۸	۱,۱۱۵,۳۸۵

۷- استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق

صندوق سرمایه گذاری 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 می دهد.

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 پیش بینی 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 قابل اتکاتر 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	

صندوق سرمایه‌گذاری
لاجورد دماوند
اختصاصی بازارگردانی
شماره ثبت: ۵۱۲۳۱