

صندوق سرمایه گذاری

ارمغان فیروزه آسیا

شماره ثبت : ۴۱۹۲۹

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری ارمغان فیروزه آسیا (قابل معامله)

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۱



فهرست مطالب

۳ مقدمه
۳ تاریخچه فعالیت صندوق
۴ معرفی صندوق
۴ اهداف صندوق
۵ ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق
۶ واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن
۶ خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق
۸ خالص ارزش دارایی‌های هر واحد صندوق (NAV)
۸ بازدهی صندوق
۹ ترکیب پرتفوی صندوق

مقدمه

در اجرای مفاد ماده ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفند ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدینوسیله گزارش درباره فعالیت و وضع عمومی صندوق برای دوره سه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۱ پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود تهیه و به شرح زیر تقدیم می‌گردد. گزارش حاضر، مبتنی بر اطلاعات ارائه شده در صورت‌های مالی بوده و اطلاعاتی را در خصوص وضع عمومی و عملکرد مدیر فراهم می‌آورد.

تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری قابل معامله در بازار اوراق بهادار ارمغان فیروزه آسیا که صندوقی با اندازه بزرگ محسوب می‌شود در تاریخ ۱۳۹۶/۰۴/۲۴ تحت شماره ۱۱۵۱۸ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۶/۰۳/۲۹ تحت شماره ۴۱۹۲۹ و شناسه ملی ۱۴۰۰۶۸۴۷۰۶۹ در اداره کل ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد است؛ علاقه‌مندان به سرمایه‌گذاری در این صندوق، واحدهای سرمایه‌گذاری عادی صندوق را خریداری می‌کنند. خرید و فروش واحدهای سرمایه‌گذاری، در بورس یا بازار خارج از بورس مربوطه و به واسطه کارگزاران دارای مجوز انجام می‌شود. سرمایه‌گذاری در این صندوق بدون ریسک نیست و با توجه به اینکه واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در بورس یا بازار خارج از بورس مربوطه مورد داد و ستد قرار می‌گیرد، این امکان وجود دارد که نوسانات میزان عرضه و تقاضا در بازار، قیمت واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق را دستخوش نوسان کند.

معرفی صندوق

جدول مشخصات صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا به شرح زیر می‌باشد:

صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا	
نوع صندوق	درآمد ثابت - قابل معامله
تاریخ آغاز فعالیت	۱۳۹۶/۱۰/۰۹
مدیر صندوق	سبذگردان توسعه فیروزه
مدیر سرمایه‌گذاری	مجید علی‌فر، رضا یارمحمدی، امیر جعفرزاده
متولی صندوق	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی
حسابرس	موسسه حسابرسی آگاهان و همکاران
سایت صندوق	firouzehfixetf.com

اهداف صندوق

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد است همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی با تعهد خرید اوراق بهادار مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد.

انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی نسبت به سرمایه‌گذاری انفرادی سرمایه‌گذاران دارد:

اولاً هزینه بکارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد. ثانیاً صندوق از جانب سرمایه‌گذاران کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد، ثالثاً امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق

هر چند تمهیدات لازم بعمل آمده است تا سرمایه‌گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه‌گذاری‌های صندوق همواره وجود دارد. بنابراین سرمایه‌گذاران باید به ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق از جمله ریسک‌های یاد شده در این بخش از امیدنامه، توجه ویژه داشته باشند، دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی با سرمایه‌گذاری در صندوق، تمام ریسک‌های فراروی صندوق را می‌پذیرند.

ریسک کاهش ارزش دارایی‌های صندوق: قیمت اوراق بهادار در بازار، تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی اقتصادی، اجتماعی، صنعت موضوع فعالیت خاص ناشر و ضامن آن است. با توجه به آنکه ممکن است در مواقعی تمام یا بخشی از دارایی‌های صندوق در اوراق بهادار سرمایه‌گذاری شده باشند، و از آنجا که قیمت این اوراق می‌تواند در بازار کاهش یابد، لذا صندوق از این بابت ممکن است متضرر شده و این ضرر به سرمایه‌گذاران منتقل شود.

ریسک نکول اوراق بهادار با درآمد ثابت: اوراق بهادار با درآمد ثابت شرکت‌ها بخشی از دارایی‌های صندوق را تشکیل می‌دهد. گرچه صندوق در اوراق بهاداری سرمایه‌گذاری کند که سود حداقل برای آن‌ها تعیین و پرداخت سود و اصل سرمایه‌گذاری آن توسط یک موسسه معتبر تضمین شده باشد، یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه‌گذاری در آن‌ها وثایق معتبر و کافی وجود داشته باشد ولی این احتمال وجود دارد که طرح سرمایه‌گذاری مرتبط با این اوراق، سودآوری کافی نداشته باشد یا ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق بهادار، عمل ننمایند یا ارزش وثایق به طرز قابل توجهی کاهش یابد. به طوری که پوشش‌دهنده‌ی اصل سرمایه‌گذاری و سود متعلق به آن نباشند وقوع این اتفاقات می‌تواند باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً سرمایه‌گذاران شوند.

ریسک نوسان بازده بدون ریسک: در صورتی که نرخ بازده بدون ریسک نظیر سود علی الحساب اوراق مشارکت دولتی) افزایش یابد، به احتمال زیاد قیمت اوراق مشارکت و سایر اوراق بهاداری که سود حداقل یا ثابتی برای آنها تعیین شده است، در بازار کاهش می‌یابد، اگر صندوق در این نوع اوراق بهادار سرمایه‌گذاری کرده باشد و باز خرید آن به قیمت معین توسط یک موسسه معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، افزایش نرخ بازده بدون ریسک، ممکن است باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً سرمایه‌گذاران گردد.

ریسک نکول ضامن جبران خسارت با سود: علی‌رغم اینکه تحت شرایط مندرج در این امیدنامه و اساسنامه صندوق، ضامن جبران خسارت یا سود، حداقل بازدهی را برای دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری عادی تضمین نموده است، با این حال ممکن است در اثر ورشکستگی ضامن جبران خسارت با سود یا به هر دلیل دیگری، وی نتواند به تعهدات خود عمل کند یا از عمل به تعهدات خود سر باز زنده در این صورت ممکن است بازدهی دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری عادی کمتر از نرخ تضمین شده شود.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن

ارزش مبنای هر واحد سرمایه‌گذاری برابر ده هزار ریال است که باید روی گواهی‌های سرمایه‌گذاری قید شود. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می‌شود:

الف) دارنده واحدهای سرمایه‌گذاری عادی دارای حق رأی نیست و نمی‌تواند در مجامع صندوق شرکت نماید.

ب) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که تعداد آن‌ها ۱۰۰۰۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری است، قبل از شروع دوره پذیرهنویسی اولیه مطابق ماده ۸، کلاً توسط مؤسس یا مؤسسان صندوق خریداری می‌شود. دارنده واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق حضور و حق رأی در مجامع صندوق است. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیر قابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می‌باشد. در تاریخ ارائه گزارش دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

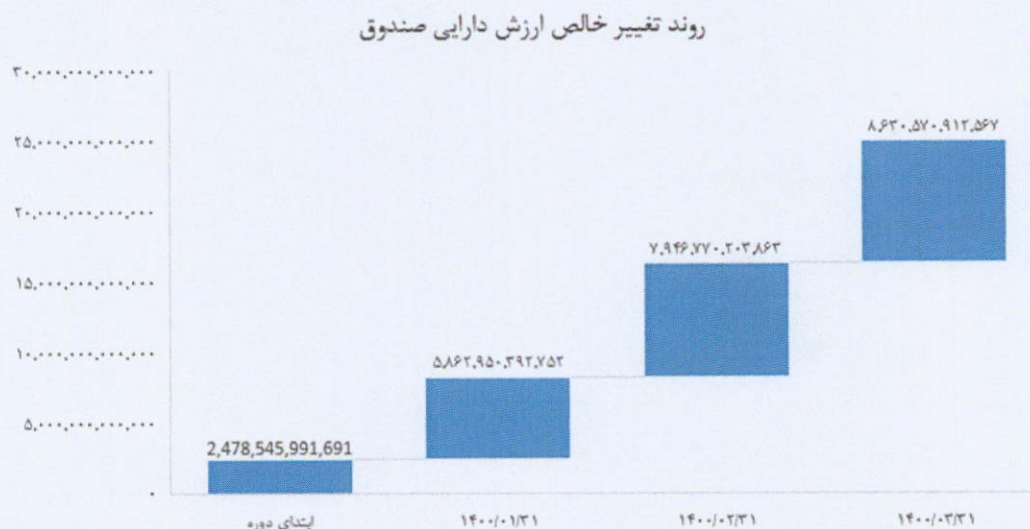
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سرمایه‌گذاری توسعه صنعتی ایران	۷۰۰.۰۰۰	٪۷۰
۲	شرکت سبذگردان توسعه فیروزه	۳۰۰.۰۰۰	٪۳۰
	جمع	۱,۰۰۰,۰۰۰	٪۱۰۰

خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق

ارزش روز دارایی‌های صندوق در پایان هر روز برابر با مجموع وجوه نقد صندوق، قیمت فروش اوراق بهادار صندوق، ارزش روز مطالبات صندوق (نظیر سود تحقق‌یافته دریافت نشده، سپرده‌های بانکی و سهام) و ارزش سایر دارایی‌های صندوق به قیمت بازار در پایان همان روز است. برای محاسبه ارزش روز سود تحقق‌یافته دریافت نشده هر سپرده یا ورقه مشارکت، از نرخ سود همان سپرده یا ورقه مشارکت و برای محاسبه ارزش روز سود سهام تحقق‌یافته دریافت نشده، از نرخ سود علی الحساب آخرین اوراق مشارکت دولتی به علاوه ۵ درصد استفاده می‌شود. قیمت فروش اوراق بهادار صندوق در هر زمان مطابق دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله مصوب سازمان تعیین می‌شود. روند تغییرات خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق طی دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ به شرح ذیل می‌باشد.

روند تغییر خالص ارزش دارایی صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا

از تاریخ ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ لغایت ۱۴۰۱/۰۳/۳۱



خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در دوره مالی مورد گزارش از مبلغ ۲,۴۷۸,۵۴۵ میلیون ریال در ابتدای دوره (۱۴۰۰/۱۲/۲۹) به مبلغ ۸,۶۳۰,۹۱۲ میلیون ریال در انتهای دوره (۱۴۰۱/۰۳/۳۱) رسیده است.

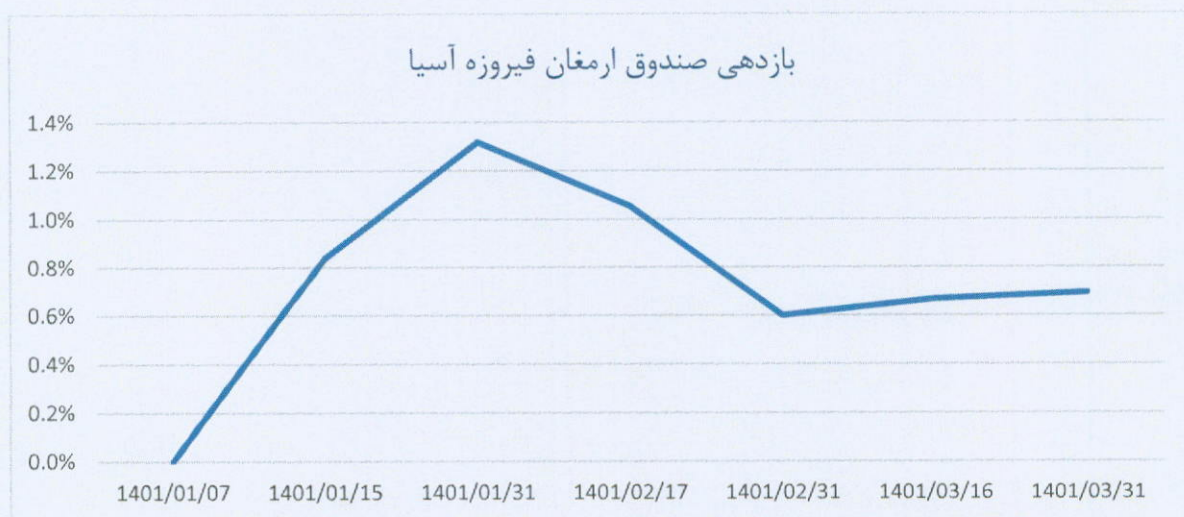
خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

خالص ارزش دارایی های هر واحد سرمایه گذاری در پایان هر روز برابر با ارزش روز دارایی های صندوق در پایان آن روز منهای بدهی های صندوق در پایان آن روز تقسیم بر تعداد واحدهای سرمایه گذاری نزد سرمایه گذاران در پایان همان روز است. خالص ارزش دارایی های هر واحد در ابتدا و انتهای دوره سالانه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ به شرح جدول ذیل می باشد :

ردیف	شرح	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۱/۰۱/۳۱	درصد تغییر
۱	ارزش اسمی هر واحد	۱۰.۰۰۰	۱۰.۰۰۰	۰
۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	۹۱.۲۸۶.۴۰۹	۳۰۰.۰۰۰.۰۰۰	۲۲۸/۶۴
۳	نرخ صدور	۲۷.۱۹۳	۲۷.۷۸۳	۵/۸۵
۴	نرخ ابطال	۲۷.۱۵۲	۲۸.۷۶۹	۵/۹۶

بازدهی صندوق ارمغان فیروزه آسیا

نمودار زیر بازده صندوق سرمایه گذاری ارمغان فیروزه آسیا را در دوره سه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ نشان می دهد:

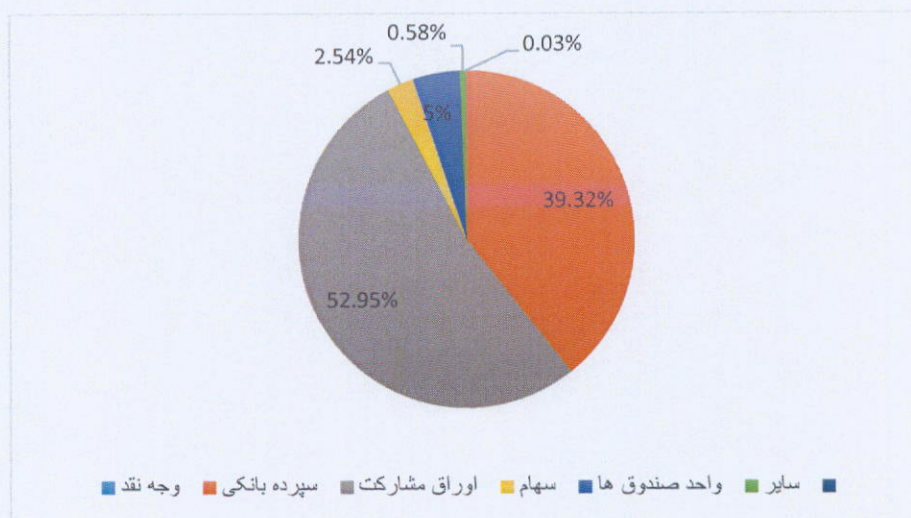


ترکیب پرتفوی صندوق

در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ حدود ۵۲.۹۵ درصد از ارزش پرتفوی صندوق به اوراق درآمد ثابت تخصیص داده شده است. حدود ۲.۵۴ درصد از دارایی‌های صندوق به سهام شرکت‌های بورسی و فرابورسی سرمایه‌گذاری شده است و حدود ۴.۵۷ درصد از دارایی صندوق در صندوقهای سرمایه‌گذاری سهامی سرمایه‌گذاری شده است. همچنین در نمودارهای صفحه بعد درصد تخصیص منابع صندوق به هر یک از صنایع و شرکت‌ها ارائه شده است..

ترکیب دارایی‌های صندوق ارمغان فیروزه آسیا در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

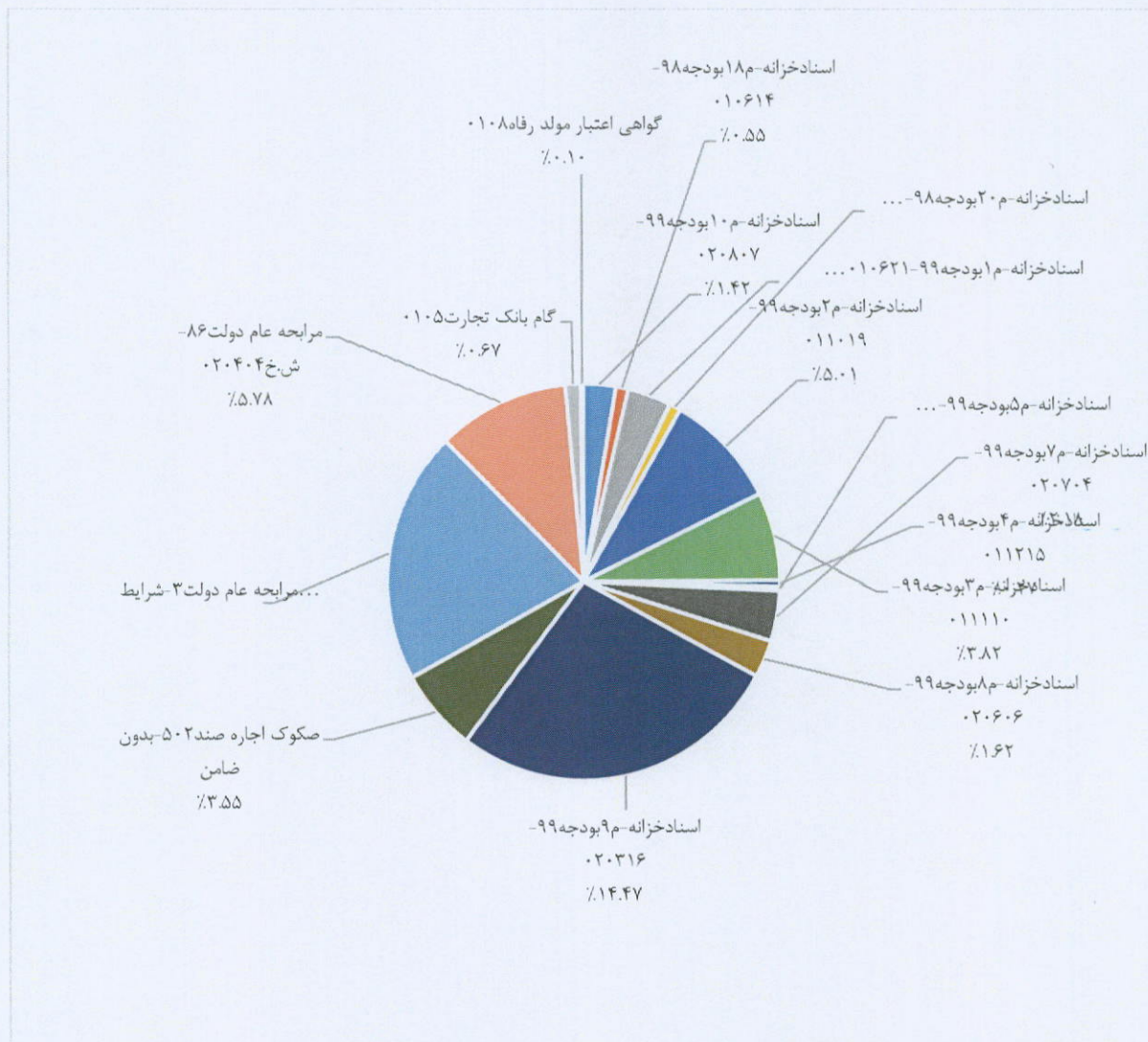
عنوان	خالص ارزش	نسبت به کل دارایی ارزش روز
وجه نقد	۲,۸۱۴,۰۷۲,۸۲۰	۰.۰۳
سپرده بانکی	۳,۴۰۴,۲۸۸,۹۹۵,۲۹۷	۳۹.۳۲
اوراق مشارکت	۴,۵۸۳,۹۴۰,۵۶۷,۰۷۵	۵۲.۹۵
سهام	۲۲۰,۳۰۳,۲۲۸,۵۲۱	۲.۵۴
واحد صندوق‌ها	۳۹۵,۹۸۹,۲۰۳,۷۵۰	۴.۵۷
سایر	۵۰,۴۶۹,۱۸۲,۶۹۴	۰.۵۸
جمع	۸,۶۵۷,۸۰۵,۲۵۰,۱۵۷	۱۰۰



ترکیب دارایی‌های صندوق - اوراق مشارکت صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا

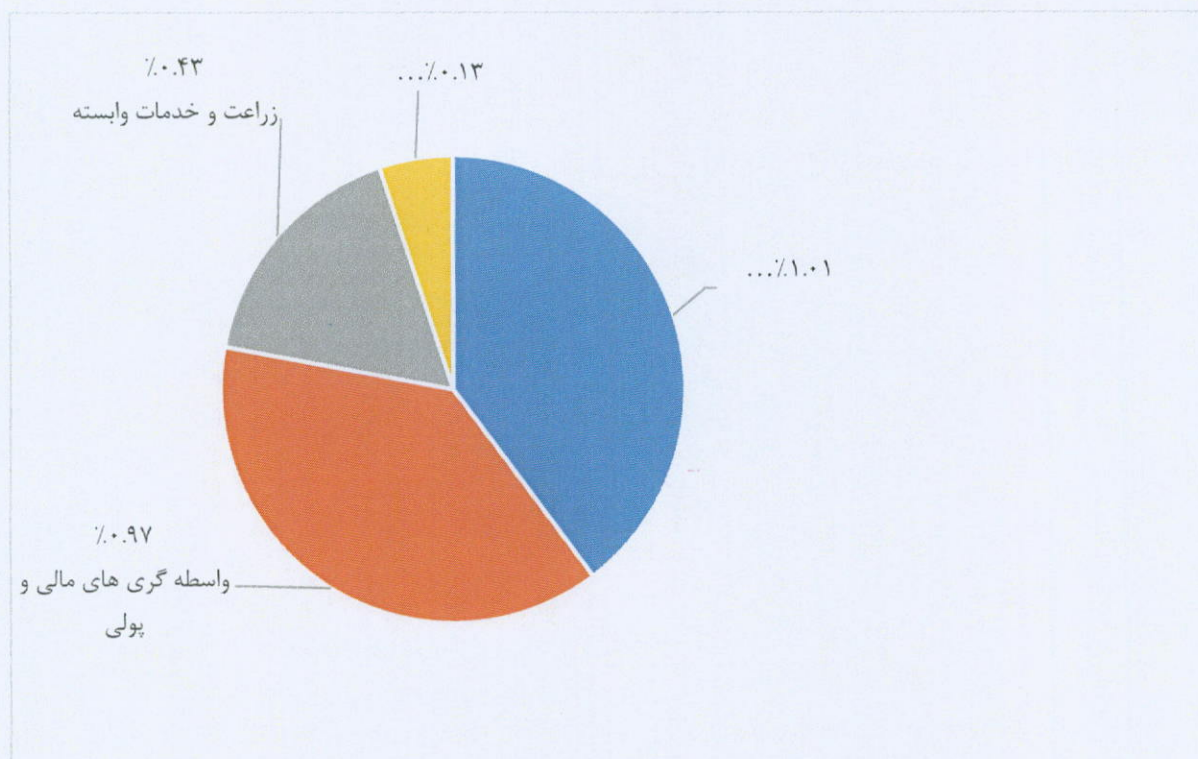
در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

درصد از کل دارایی صندوق	خالص ارزش فروش	اوراق مشارکت
۱.۴۲	۱۲۲,۷۹۰,۷۴۴,۷۴۳	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۹-۲۰۸۰۷
۰.۵۵	۴۷,۸۶۵,۳۲۲,۸۳۷	اسناد خزانه-م ۱۸ بودجه ۹۸-۱۰۶۱۴
۱.۹۰	۱۶۴,۴۷۸,۲۵۷,۹۱۱	اسناد خزانه-م ۱ بودجه ۹۹-۱۰۶۲۱
۰.۵۰	۴۳,۱۳۲,۷۵۵,۷۷۱	اسناد خزانه-م ۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶
۵.۰۱	۴۳۳,۵۳۳,۱۱۷,۳۰۸	اسناد خزانه-م ۲ بودجه ۹۹-۱۱۰۱۹
۳.۸۲	۳۳۱,۱۴۷,۹۷۰,۵۵۰	اسناد خزانه-م ۳ بودجه ۹۹-۱۱۱۱۰
۰.۲۷	۲۳,۰۶۰,۸۷۶,۳۱۸	اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۹۹-۱۱۲۱۵
۰.۱۸	۱۵,۲۳۵,۰۷۰,۶۴۳	اسناد خزانه-م ۵ بودجه ۹۹-۲۰۲۱۸
۲.۱۸	۱۸۸,۸۴۳,۸۴۰,۸۴۹	اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۹۹-۲۰۷۰۴
۱.۶۲	۱۴۰,۶۱۲,۳۰۹,۳۹۹	اسناد خزانه-م ۸ بودجه ۹۹-۲۰۶۰۶
۱۴.۴۷	۱,۲۵۲,۳۹۷,۰۲۵,۸۸۸	اسناد خزانه-م ۹ بودجه ۹۹-۲۰۳۱۶
۳.۵۵	۳۰۷,۲۰۸,۶۰۱,۶۴۵	صکوک اجاره سند ۵۰۲-بدون ضامن
۱۰.۹۳	۹۴۶,۷۲۳,۶۲۹,۰۴۳	مراجعه عام دولت ۳-شرایط خاص ۲۰۸
۵.۷۸	۵۰۰,۲۳۲,۲۱۴,۶۲۸	مراجعه عام دولت ۸۶-ش.خ ۲۰۴۰۴
۰.۶۷	۵۷,۸۸۹,۵۰۵,۶۲۵	گام بانک تجارت ۱۰۵
۰.۱۰	۸,۷۸۹,۳۲۳,۹۱۷	گواهی اعتبار مولد رفاه ۱۰۸
۱.۴۲	۱۲۲,۷۹۰,۷۴۴,۷۴۳	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۹-۲۰۸۰۷
۵۲.۹۵	۴,۵۸۳,۹۴۰,۵۶۷,۰۷۵	جمع



ترکیب پرتفوی سهام صندوق سرمایه گذاری ارمغان فیروزه آسیا بر اساس صنعت ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

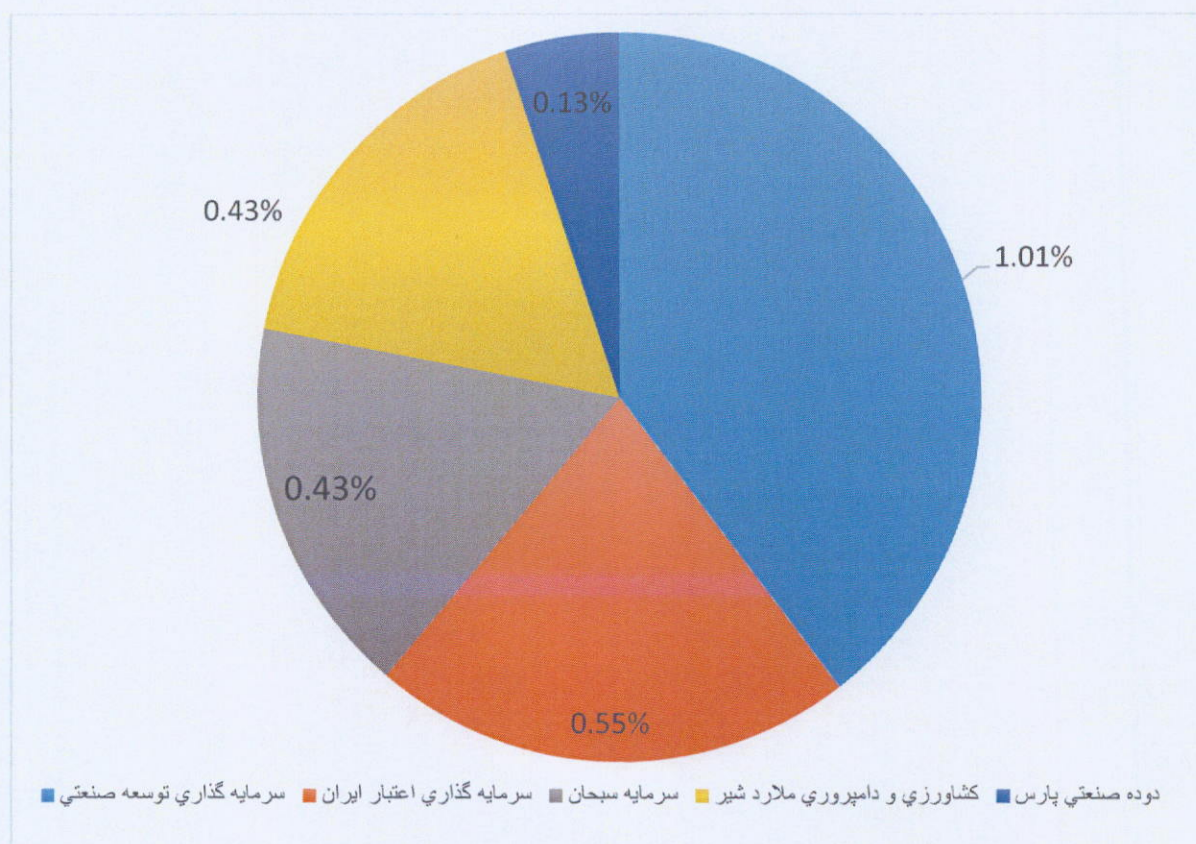
صنعت	خالص ارزش فروش	درصد از کل دارایی صندوق
سرمایه گذاریها	۸۷,۴۷۶,۴۰۰,۰۰۰	۱.۰۱
واسطه گری های مالی و پولی	۸۴,۲۴۳,۲۷۲,۲۵۶	۰.۹۷
زراعت و خدمات وابسته	۳۷,۰۳۸,۳۰۳,۰۰۰	۰.۴۳
محصولات شیمیایی	۱۱,۵۴۵,۲۵۳,۲۶۵	۰.۱۳
جمع	۲۲۰,۳۰۳,۲۲۸,۵۲۱	۲.۵۴

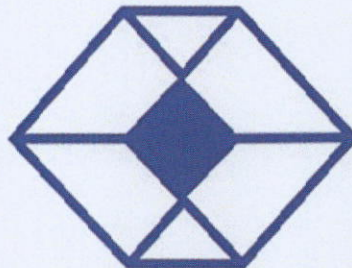


ترکیب پرتفوی سهام صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا بر اساس شرکت‌های بورسی و فرابورسی

در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

اوراق	خالص ارزش فروش	درصد از کل دارایی صندوق
سرمایه گذاری توسعه صنعتی	۸۷.۴۷۶.۴۰۰.۰۰۰	۱.۰۱
سرمایه گذاری اعتبار ایران	۴۷.۳۵۴.۰۷۶.۷۵۶	۰.۵۵
سرمایه سبحان	۳۶.۸۸۹.۱۹۵.۵۰۰	۰.۴۳
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	۳۷.۰۳۸.۳۰۳.۰۰۰	۰.۴۳
دوده صنعتی پارس	۱۱.۴۸۳.۱۰۰.۴۸۸	۰.۱۳
دوده صنعتی پارس	۶۲.۱۵۲.۷۷۷	۰
جمع	۲۲۰.۳۰۳.۲۲۸.۵۲۱	۲.۵۴





صندوق سرمایه گذاری
ارمغان فیروزه آسیا
شماره ثبت: ۴۱۹۲۹



تهران، نیاوران، بین سه راه مژده و دزاشیب، کوچه صالحی، نبش کوچه، پلاک ۱۰۶، ساختمان مهدیار، طبقه دوم

کد پستی: ۱۹۷۱۹۸۳۱۱۵



صندوق سرمایه گذاری
ارمغان فیروزه آسیا