



صندوق سرمایه گذاری

ارمغان فیروزه آسیا

شماره ثبت : ۴۱۹۲۹

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا (قابل معامله)

برای دوره مالی سه ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۲

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
۷	خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق
۸	خالص ارزش دارایی‌های هر واحد صندوق (NAV)
۱۰	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 ۳ ماهه منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۲ 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	لادن بخشنده ، رضا یارمحمدی، مریم سادات حسینی
متولی صندوق	شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی
حسابرس	موسسه حسابرسی آگاهان و همکاران
سایت صندوق	firouzehfixetf.ir

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 نمایند 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 ۱,۰۰۰,۰۰۰ 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:

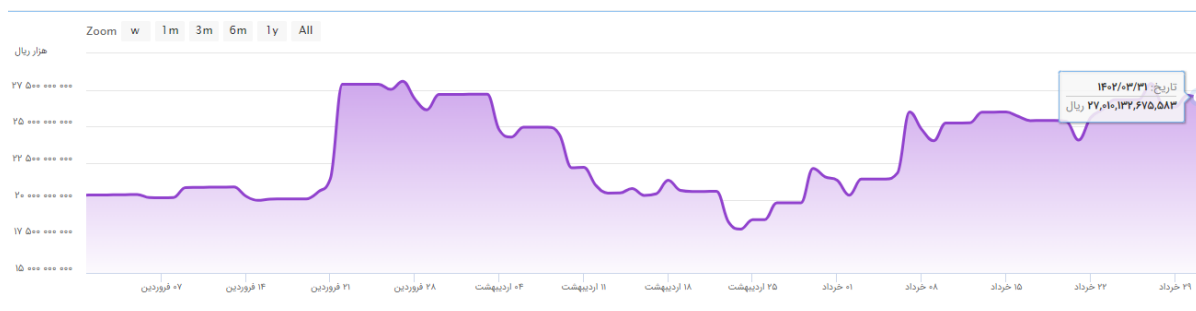
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز	درصد واحدهای ممتاز
۱	شرکت سرمایه‌گذاری توسعه صنعتی ایران	۷۰۰,۰۰۰	۷۰٪
۲	شرکت سبذگردان توسعه فیروزه	۳۰۰,۰۰۰	۳۰٪
	جمع	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱۰۰٪

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 تحقق یافته دریافت نشده، سپرده‌های بانکی و سهام) و ارزش سایر دارایی‌های صندوق به قیمت بازار در پایان همان روز است. برای محاسبه ارزش روز سود تحقق یافته دریافت نشده هر سپرده یا ورقه مشارکت، از نرخ سود همان سپرده یا ورقه مشارکت و برای محاسبه ارزش روز سود سهام تحقق یافته 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 دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ به شرح ذیل می‌باشد.

روند تغییر خالص ارزش دارایی صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا

از تاریخ ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ لغایت ۱۴۰۲/۰۳/۳۱



خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در دوره مالی مورد گزارش از مبلغ ۲۰,۳۱۸,۸۵۰ میلیون ریال در ابتدای دوره (۱۴۰۲/۰۱/۰۱)، به مبلغ ۲۷,۰۱۰,۱۳۲ میلیون ریال در انتهای دوره (۱۴۰۲/۰۳/۳۱) رسیده است.

خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

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 دوره مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ به شرح جدول ذیل می باشد

:

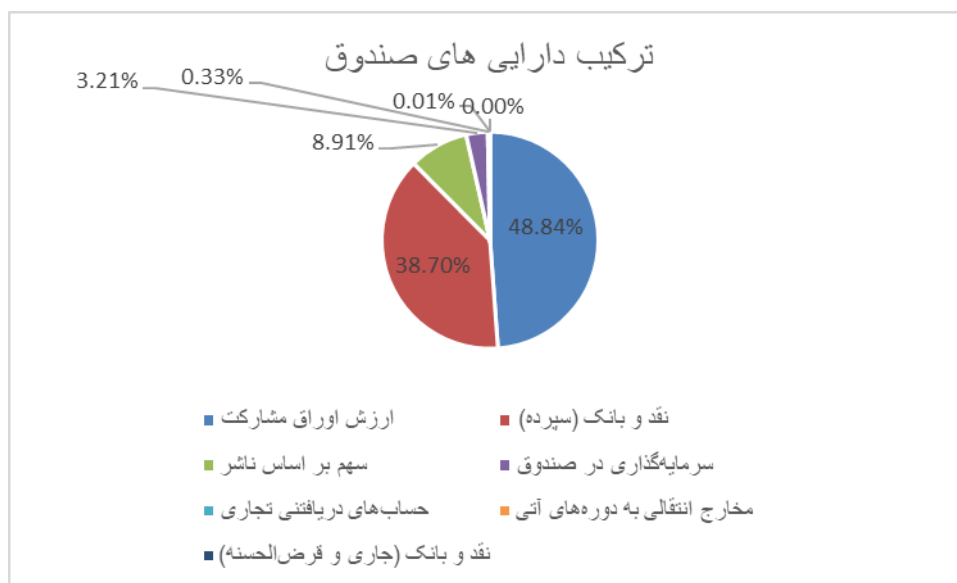
ردیف	شرح	۱۴۰۲/۰۱/۰۱	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	درصد تغییر
۱	ارزش اسمی هر واحد	۱۰,۰۰۰	۱۰,۰۰۰	۰
۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	۶۰۵,۵۶۱,۲۴۰	۷۵۵,۴۲۹,۷۳۸	٪۲۴.۷۵
۳	نرخ صدور	۳۳,۵۹۶	۳۵,۷۸۶	٪۶.۵۲
۴	نرخ ابطال	۳۳,۵۵۴	۳۵,۷۵۵	٪۶.۵۶

ترکیب پرتفوی صندوق

در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱ حدود ۴۸.۸۴ درصد از ارزش پرتفوی صندوق به اوراق درآمد ثابت تخصیص داده شده است. حدود ۸.۹۱ درصد از دارایی های صندوق به سهام شرکت های بورسی و فرابورسی سرمایه گذاری شده است و حدود ۳.۰۹ درصد از دارایی صندوق در صندوق های سرمایه گذاری سهامی سرمایه گذاری شده است. همچنین در نمودارهای صفحه بعد درصد تخصیص منابع صندوق به هر یک از صنایع و شرکت ها ارائه شده است..

ترکیب دارایی های صندوق ارمغان فیروزه آسیا در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

عنوان	خالص ارزش دارایی ها (ریال)	نسبت به کل دارایی ارزش روز (درصد)
ارزش اوراق مشارکت	۱۳,۳۵۸,۵۸۹,۹۸۴,۰۷۷	٪۴۸.۸۴
نقد و بانک (سپرده)	۱۰,۵۸۵,۹۶۶,۱۲۹,۴۹۴	٪۳۸.۷۰
سهام بر اساس ناشر	۲,۴۳۶,۱۵۵,۹۰۷,۹۸۷	٪۸.۹۱
سرمایه گذاری در صندوق	۸۷۸,۱۳۶,۰۳۹,۵۷۶	٪۳.۲۱
حساب های دریافتی تجاری	۸۹,۴۵۸,۵۳۹,۵۵۱	٪۰.۳۳
مخارج انتقالی به دوره های آتی	۲,۵۲۴,۶۲۹,۴۸۲	٪۰.۰۱
نقد و بانک (جاری و قرض الحسنه)	۵۷,۹۲۶,۹۹۱	٪۰
جمع	۲۷,۳۵۰,۸۸۹,۱۵۷,۱۵۸	۱۰۰



ترکیب دارایی‌های صندوق - اوراق مشارکت صندوق سرمایه‌گذاری ارمغان فیروزه آسیا

در تاریخ ۱۴۰۲/۰۳/۳۱

درصد از کل دارایی صندوق	خالص ارزش فروش	اوراق مشارکت
٪۷.۳۷	۲,۰۱۶,۱۱۳,۹۵۳,۱۰۲	گام بانک صادرات ایران ۰۲۰۷
٪۴.۵۷	۱,۲۵۰,۶۴۳,۳۲۹,۸۰۳	گام بانک اقتصاد نوین ۰۲۰۵
٪۴.۲۷	۱,۱۶۸,۸۳۳,۵۶۹,۲۰۲	مراجعه عام دولت ۱۲۷-ش.خ ۰۴۰۶۲۳
٪۳.۷۷	۱,۰۳۰,۹۶۳,۵۵۶,۴۸۰	گام بانک اقتصاد نوین ۰۲۰۴
٪۳.۲۲	۸۸۰,۹۱۷,۳۶۷,۶۶۴	مراجعه عام دولت ۹۴-ش.خ ۰۳۰۸۱۶
٪۲.۹۲	۷۹۹,۶۱۸,۰۶۸,۵۵۲	اسناد خزانه-م ۱۰ بودجه ۹۹-۲۰۸۰۷
٪۲.۴۰	۶۵۶,۶۵۱,۸۸۶,۱۷۲	مراجعه عام دولت ۳-ش.خ ۰۲۰۸
٪۲.۳۶	۶۴۵,۳۵۹,۶۲۲,۷۵۳	مراجعه عام دولت ۵-ش.خ ۰۲۰۹
٪۱.۸۶	۵۰۹,۲۹۷,۶۵۵,۷۵۱	اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۰۰-۳۰۵۲۲
٪۱.۷۴	۴۷۴,۹۹۵,۸۵۶,۵۰۱	مراجعه عام دولت ۱۰۹-ش.خ ۰۲۰۷۱۹
٪۱.۷۴	۴۷۴,۸۷۶,۷۵۶,۵۰۵	اسناد خزانه-م ۸ بودجه ۹۹-۲۰۶۰۶
٪۱.۷۳	۴۷۱,۸۲۵,۹۹۱,۷۷۱	مراجعه عام دولت ۸۶-ش.خ ۰۲۰۴۰۴
٪۱.۶۶	۴۵۳,۱۷۵,۸۴۶,۹۸۸	گواهی اعتبار مولد رفاه ۰۲۰۴
٪۱.۴۹	۴۰۶,۹۶۴,۸۷۸,۲۳۴	مراجعه عام دولت ۱۱۲-ش.خ ۰۴۰۴۰۸
٪۱.۳۳	۳۶۲,۸۵۱,۳۰۱,۲۷۹	اسناد خزانه-م ۷ بودجه ۹۹-۲۰۷۰۴

۱.۱۹٪	۳۲۶,۶۰۱,۱۹۲,۸۰۳	اسناد خزانه-م ۱ بودجه ۰۰-۳۰۸۲۱
۱.۱۰٪	۲۹۹,۵۱۱,۴۴۸,۳۶۳	مراجعه عام دولت ۱۰۷-ش.خ ۰۳۰۷۲۴
۱.۰۸٪	۲۹۴,۴۶۸,۶۱۷,۲۸۸	اسناد خزانه-م ۳ بودجه ۰۰-۳۰۴۱۸
۰.۹۰٪	۲۴۴,۹۸۰,۵۸۹,۲۱۹	اسناد خزانه-م ۲ بودجه ۹۸-۲۰۹۰۶
۰.۸۳٪	۲۲۶,۲۲۹,۷۸۸,۴۱۸	اسناد خزانه-م ۴ بودجه ۰۱-۰۴۰۹۱۷
۰.۷۸٪	۲۱۳,۹۰۸,۱۸۷,۱۱۳	اسناد خزانه-م ۶ بودجه ۰۰-۰۳۰۷۲۳
۰.۵۵٪	۱۴۹,۸۰۰,۵۲۰,۱۳۴	اسناد خزانه-م ۲۰ بودجه ۹۸-۲۰۸۰۶
۴۸.۸۶٪	۱۳,۳۵۸,۵۸۹,۹۸۴,۰۹۱	جمع

ترکیب پرتفوی سهام صندوق سرمایه گذاری ارمغان فیروزه آسیا بر اساس صنعت ۳۱/۰۳/۱۴۰۲

صنعت	خالص ارزش فروش	درصد از کل دارایی صندوق
فراورده های نفتی، کک و سوخت هسته ای	۸۶۵,۴۷۶,۶۷۶,۸۸۵	۳.۱۶٪
شرکتهای چند رشته ای صنعتی	۲۹۲,۹۴۱,۸۴۳,۰۸۴	۱.۰۷٪
حمل و نقل، انبارداری و ارتباطات	۲۷۰,۲۴۹,۷۴۵,۱۴۲	۰.۹۹٪
محصولات شیمیایی	۲۴۸,۲۶۶,۰۷۲,۵۲۵	۰.۹۱٪
سایر محصولات کانی غیرفلزی	۱۸۶,۸۴۱,۳۰۵,۶۲۹	۰.۶۸٪
رایانه و فعالیت های وابسته به آن	۱۴۸,۲۷۴,۰۸۳,۰۱۳	۰.۵۴٪
مواد و محصولات دارویی	۱۴۲,۸۰۳,۹۷۵,۸۲۵	۰.۵۲٪
بانکها و موسسات اعتباری	۱۲۰,۵۵۴,۶۰۱,۱۶۷	۰.۴۴٪
ماشین آلات و دستگاه های برقی	۷۴,۵۴۰,۵۵۱,۴۸۷	۰.۲۷٪
سرمایه گذاریها	۵۳,۳۳۹,۳۷۰,۴۳۸	۰.۲٪
خودرو و ساخت قطعات	۲۷,۱۴۴,۲۱۶,۴۹۲	۰.۱٪
استخراج کانه های فلزی	۵,۳۳۴,۶۳۸,۳۸۱	۰.۰۲٪
ساخت محصولات فلزی	۳۸۸,۸۲۷,۹۲۶	۰٪
جمع	۲,۴۳۶,۱۵۵,۹۰۷,۹۹۴	۸.۹۱



سندوق 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

