



صندوق دریای آبی فیروزه

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه

دوره مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

فهرست مطالب

۳	 مقدمه
۳	 تاریخچه فعالیت صندوق
۴	 معرفی صندوق
۴	 اهداف صندوق
۵	 ریسک های سرمایه گذاری در صندوق
۶	 واحدهای سرمایه گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن
۷	 خالص ارزش روز دارایی های صندوق
۸	 خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق (NAV)
۸	 مقایسه بازده ی صندوق با بازده شاخص کل
۹	 ترکیب پرتفوی صندوق

مقدمه

در اجرای مفاد ماده ۲۳۲ اصلاحیه قانون تجارت، مصوب اسفندماه ۱۳۴۷ و ماده ۴۵ قانون بازار اوراق بهادار بدین وسیله گزارش فعالیت و وضعیت عمومی صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه برای دوره مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می‌گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش مدیران سرمایه‌گذاری، مبتنی بر اطلاعات ارائه شده در صورتهای مالی صندوق بوده و اطلاعات ارائه شده در آن نشان دهنده وضعیت عمومی صندوق و عملکرد مدیران آن در دوره مزبور می‌باشد. اطلاعات مندرج در این گزارش که درباره عملیات و وضعیت عمومی صندوق می‌باشد، با تاکید بر ارائه منصفانه نتایج عملکرد مجموعه مدیریت صندوق و انطباق با مقررات قانونی و اساسنامه صندوق تهیه و ارائه می‌گردد.

تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه که صندوق سرمایه‌گذاری در سهام و از نوع قابل معامله (ETF) می‌باشد در تاریخ ۱۴۰۱/۰۸/۰۲ تحت شماره ۱۲۰۳۹ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۴۰۱/۰۷/۲۷ تحت شماره ۵۴۵۵۰ و شناسه ملی ۱۴۰۱۱۵۸۸۵۴۶ 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 دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در سهام و حق تقدم خرید سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس و فرابورس، اوراق مشارکت، اوراق صکوک، اوراق بهادار رهنی، گواهی سپرده و سپرده های بانکی سرمایه‌گذاری می‌نماید. لازم به ذکر است مدت زمان فعالیت صندوق با توجه به ماده ۵ اساسنامه صندوق و مجوز فعالیت شماره ۱۲۲/۱۱۷۴۷۴ مورخ ۱۴۰۱/۰۹/۲۱ سازمان بورس و اوراق بهادار از تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۲۱ به مدت نامحدود می‌باشد.

معرفی صندوق

جدول مشخصات صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه به شرح زیر می‌باشد:

صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه	
نوع صندوق	سرمایه‌گذاری در سهام – قابل معامله (ETF)
تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۱/۰۹/۲۱
مدیر صندوق	سبدگردان توسعه فیروزه
مدیر سرمایه‌گذاری	امید عطار درآباد، مائده پوربهرامی، زهره نوروزنژاد
متولی صندوق	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی
حسابرس	مؤسسه حسابرسی و مشاوره مدیریت وانیا نیک تدبیر
سایت صندوق	daryaetf.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 یا 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 به‌کارگیری 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

البته، تمهیدات لازم به عمل آمده است تا سرمایه‌گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه‌گذاری‌های صندوق همواره وجود دارد؛ بنابراین، سرمایه‌گذاران باید به همه ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق از جمله ریسک‌های زیر توجه ویژه مبذول دارند.

۱- **ریسک کاهش ارزش دارایی‌های صندوق:** صندوق عمدتاً در سهام شرکت‌ها سرمایه‌گذاری می‌کند.

ارزش سهام شرکت‌ها در بازار تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی، اقتصادی، اجتماعی، صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص شرکت است. قیمت سهام در بازار می‌تواند کاهش یابد و در اثر آن صندوق و سرمایه‌گذاران آن متضرر شوند.

۲- **ریسک نکول اوراق مشارکت:** اوراق مشارکت شرکت‌ها بخشی از دارایی‌های صندوق را تشکیل می‌دهد.

گرچه صندوق در اوراق مشارکتی سرمایه‌گذاری می‌کند که سود و اصل آن توسط یک مؤسسه معتبر تضمین شده است، ولی این احتمال وجود دارد که ناشر و ضامن به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق مشارکت مذکور، عمل ننمایند.

۳- **ریسک نوسان بازده بدون ریسک:** در صورتی که نرخ سود بدون ریسک (نظیر سود علی‌الحساب اوراق

مشارکت دولتی) در انتشارهای بعدی توسط ناشر افزایش یابد، قیمت اوراق مشارکتی که سود حداقلی برای آن‌ها تضمین شده است در بازار کاهش می‌یابد. اگر صندوق در این نوع اوراق مشارکت سرمایه‌گذاری کرده باشد و بازخرید آن به قیمت معین توسط یک مؤسسه معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، با افزایش نرخ اوراق بدون ریسک، صندوق ممکن است متضرر شود.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن

صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه از ارکان زیر تشکیل شده است:

دارنده واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز مادامی که حداقل تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز مذکور در اساسنامه را در اختیار داشته باشد، دارای حق رأی است و می‌تواند در مجمع صندوق، از حق رأی خود استفاده کند. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نمی‌توانند با درخواست ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری خود، سهم خود را از دارایی‌های صندوق مطالبه کنند، ولی می‌توانند واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز خود را به دیگران واگذار کنند. در تاریخ ارائه گزارش دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رأی بوده شامل اشخاص زیر است:

صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه		
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	درصد واحدهای تحت تملک
۱	سبدگردان توسعه فیروزه	٪۹۰
۲	گروه سرمایه‌گذاری توسعه صنعتی ایران	٪۱۰
	جمع	٪۱۰۰

واحدهای سرمایه‌گذاری عادی در طول دوره پذیره‌نویسی اولیه یا پس از تشکیل صندوق صادر می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری صرفاً در بورس یا بازار خارج از بورس و با رعایت مقررات آن قابل انتقال می‌باشد. تعداد و ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ به شرح ذیل می‌باشد:

ردیف	شرح	۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق	۲۲۲.۲۱۲.۵۷۸ واحد
۲	تعداد واحدهای باقیمانده (کد رزرو بازارگردان)	۷۷.۷۸۷.۴۲۲ واحد
۳	کل خالص ارزش دارایی‌های صندوق	۲,۲۴۳,۱۸۷,۸۳۴,۳۰۳ ریال

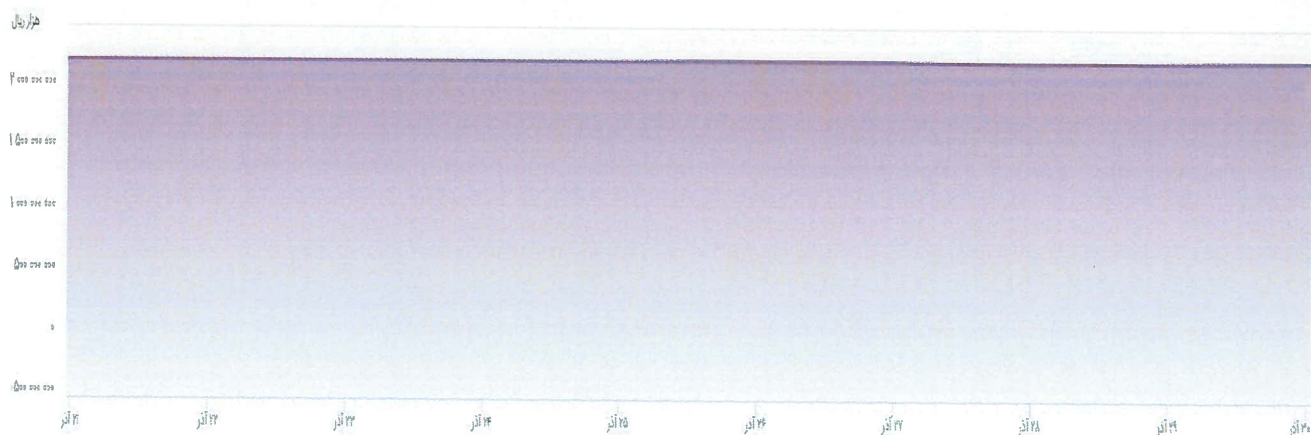
خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق

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.

روند تغییرات خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق طی دوره مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ به شرح ذیل می‌باشد.

روند تغییر خالص ارزش دارایی صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه از تاریخ ۱۴۰۱/۰۷/۲۷ لغایت

۱۴۰۱/۰۹/۳۰



خالص ارزش کل دارایی‌های صندوق مبلغ ۲,۲۴۳,۱۸۷,۸۳۴,۳۰۳ ریال می‌باشد. لازم به ذکر است صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۲۱ موفق به دریافت مجوز فعالیت از سازمان بورس و اوراق بهادار گردید، لذا تنها ۱۰ روز از شروع به فعالیت صندوق سپری شده و مدیریت صندوق در بازه مذکور، فرآیند سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار را آغاز نموده است.

خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

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 مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ به شرح جدول ذیل می باشد :

ردیف	شرح	۱۴۰۱/۰۹/۳۰
۱	ارزش اسمی هر واحد	۱۰,۰۰۰
۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	۲۲۲,۲۱۲,۵۷۸
۳	نرخ صدور	۱۰,۱۱۴
۴	نرخ ابطال	۱۰,۰۹۵

مقایسه بازدهی صندوق با بازده شاخص کل بورس

نمودار زیر مقایسه بازدهی شاخص کل بورس و بازدهی صندوق را در دوره مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ نشان می دهد:



در طی دوره مالی ۲ ماه و ۴ روزه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰، بازدهی صندوق سرمایه گذاری دریای آبی فیروزه ۰.۹۵٪ می باشد.

در خصوص مقایسه بازده صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه با بازده شاخص کل بورس دو نکته قابل ذکر است:

۱- در بازده شاخص کل بورس اوراق بهادار هیچ گونه هزینه مدیریتی و معاملاتی وجود ندارد، در صورتی که بازده صندوق پس از کسر کلیه هزینه‌های صندوق محاسبه می‌شود.

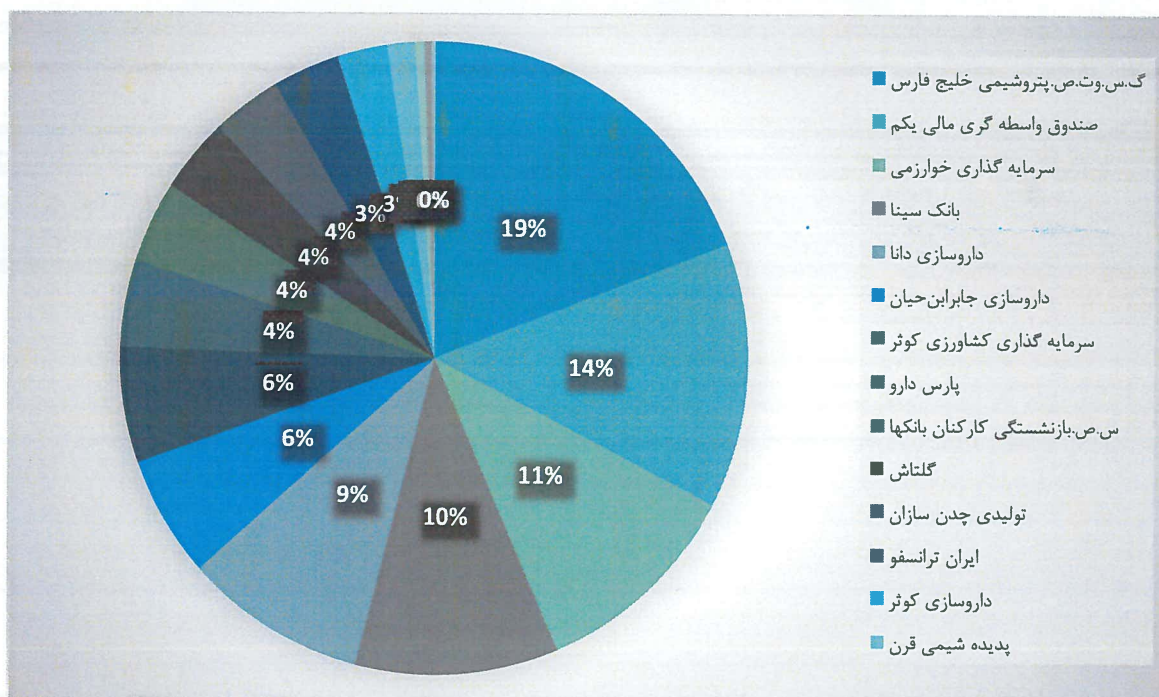
۲- در محاسبه شاخص کل بورس اوراق بهادار، سود نقدی شرکت‌ها پس از برگزاری مجمع عادی سالیانه و در هنگام بازگشایی نمادها بلافاصله شناسایی می‌شود اما در محاسبه NAV، ارزش فعلی سود سهام در نظر گرفته می‌شود.

ترکیب پرتفوی صندوق

تعداد سهام موجود در پورتفوی صندوق در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ برابر با ۱۷ شرکت بوده است. بیشترین سرمایه‌گذاری به سهم شرکت گروه سرمایه‌گذاری و توسعه صنایع تکمیلی پتروشیمی خلیج فارس با ۱۹ درصد اختصاص دارد.

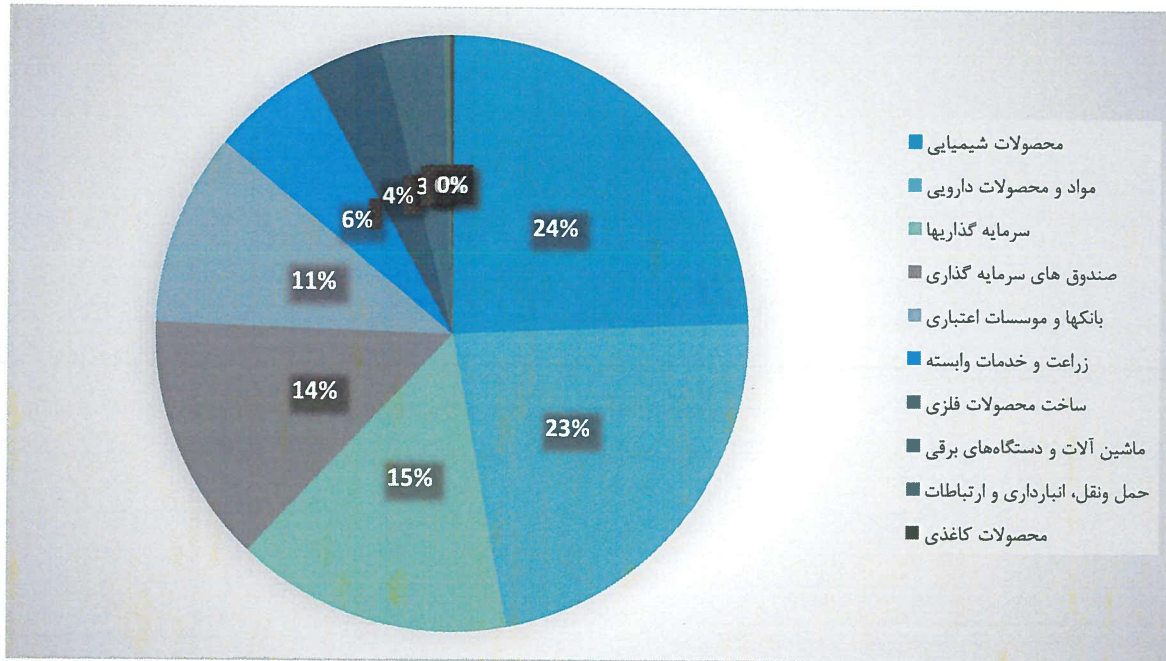
ترکیب پرتفوی سهام صندوق دریای آبی فیروزه

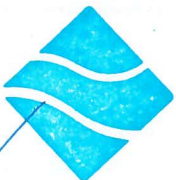
بر اساس شرکت‌های بورسی و فرابورسی در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰



ترکیب پرتفوی سهام صندوق دریای آبی فیروزه

بر اساس صنعت ۱۴۰۱/۰۹/۳۰





صندوق سرمایه گذاری
دریای آبی فیروزه
شماره ثبت: ۵۴۵۵۰



صندوق دریای آبی فیروزه



تهران، نیاوران، خیابان شهید دکتر باهنر، پایین‌تر از چهارراه مژده، کوچه صالحی، پلاک ۱۰۶
ساختمان مهدیار، طبقه دوم

کد پستی: ۱۹۷۱۹۸۳۱۱۵

