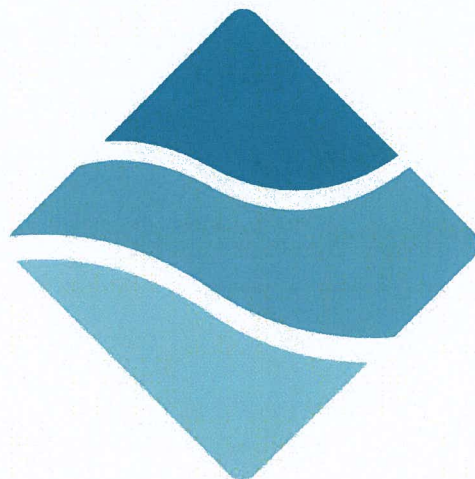




صندوق دریای آبی فیروزه

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری دریای آبی فیروزه

دوره مالی چهار ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰



صندوق سرمایه‌گذاری
دریای آبی فیروزه
شماره ثبت: ۲۵۵۰۰



فهرست مطالب

۳	مقدمه
۳	تاریخچه فعالیت صندوق
۴	معرفی صندوق
۴	اهداف صندوق
۵	ریسک های سرمایه گذاری در صندوق
۵	واحدهای سرمایه گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن
۶	خالص ارزش روز دارایی های صندوق
۶	خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق (NAV)
۷	ترازنامه صندوق
۸	صورت سود و زیان
۸	ترکیب دارایی های 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 سه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ 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 سپرده‌های 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	سیدگردان توسعه فیروزه
مدیر سرمایه‌گذاری	یگانه اقبال نیا، هانیه جعفری نجف آبادی، محمد مسعود صدرالدین کرمی
متولی صندوق	مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی
حسابرس	موسسه حسابرسی آتیه اندیش نمودگر
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 بازخريد 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:

ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سرمایه‌گذاری توسعه صنعتی ایران	۲.۷۰۰.۰۰۰	٪۹۰
۲	شرکت سیدگردان توسعه فیروزه	۳۰۰.۰۰۰	٪۱۰
	جمع	۳.۰۰۰.۰۰۰	٪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 ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح ذیل می‌باشد:

ردیف	شرح	۱۴۰۳/۱۰/۳۰
۱	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق	۲۴۴,۸۶۳,۳۹۸ واحد
۲	تعداد واحدهای باقیمانده (کد رزرو بازارگردان)	۷۵۵.۱۳۶.۶۰۲ واحد
۳	کل خالص ارزش دارایی‌های صندوق	۵,۱۹۳,۳۲۸,۴۳۱,۱۸۶ 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 چهارماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح ذیل می‌باشد.

خالص ارزش دارایی های هر واحد صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

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 چهار ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح جدول ذیل می باشد

ردیف	شرح	۱۴۰۳/۱۰/۳۰
۱	ارزش اسمی هر واحد	۱۰,۰۰۰
۲	تعداد واحدهای سرمایه گذاری	۲۴۴,۸۶۳,۳۹۸
۳	نرخ صدور	۲۱,۳۵۴
۴	نرخ ابطال	۲۱,۲۰۹

ترازنامه صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

صورت خالص دارایی	
دارایی ها:	ریال
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۵,۱۳۰,۲۱۵,۵۳۳,۶۱۲
سرمایه گذاری در سپرده بانکی	۸۰,۰۶۴,۵۸۹,۳۵۸
حساب های دریافتی	۴۶,۲۴۷,۴۸۱,۰۰۳
سایر دارایی ها	۱,۴۱۵,۵۷۴,۰۸۴
جاری کارگزاران	۴۱,۴۴۸,۹۰۰,۶۲۰
جمع دارایی ها	۵,۲۹۹,۳۹۲,۰۷۸,۶۷۷
بدهی به ارکان صندوق	۳۱,۷۹۵,۰۵۶,۰۶۳
سایر حساب های پرداختنی و ذخایر	۷۴,۲۶۸,۵۹۱,۴۲۸
جمع بدهی ها	۱۰۶,۰۶۳,۶۴۷,۴۹۱
خالص دارایی ها	۵,۱۹۳,۳۲۸,۴۳۱,۱۸۶

صورت سود و زیان صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

صورت سود و زیان	
درآمدها	ریال
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱۵۸,۴۴۴,۰۸۵,۵۰۰
سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱,۰۴۲,۳۹۳,۴۸۲,۶۸۹
سود سهام	۹۴,۹۹۹,۴۳۹,۸۲۰
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۳,۲۸۶,۳۳۲,۲۴۷
سایر درآمدها	۱۱,۵۴۹,۴۸۶,۶۰۴
جمع درآمدها	۱,۳۲۰,۶۷۲,۸۲۶,۸۶۰
هزینه کارمزد ارکان صندوق	(۴۰,۷۹۹,۸۴۰,۲۳۰)
سایر هزینه ها	(۲,۴۵۹,۷۹۱,۴۳۶)
جمع هزینه ها	(۴۳,۲۵۹,۶۳۱,۶۶۶)
سود خالص	۱,۲۷۷,۴۱۳,۱۹۵,۱۹۴

ترکیب دارایی های صندوق دریای آبی فیروزه در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

عنوان	خالص ارزش دارایی ها (ریال)	نسبت به کل دارایی ارزش روز (درصد)
نقد و بانک (سپرده)	۸۰,۰۶۴,۵۸۹,۳۵۸	%۱.۵۱
سهام و حق تقدم	۵,۱۳۰,۲۱۵,۵۳۳,۶۱۲	%۹۶.۸۱
حساب های دریافتی تجاری	۴۶,۲۴۷,۴۸۱,۰۰۳	%۰.۸۷
سایر دارایی ها	۴۲,۸۶۴,۴۷۴,۷۰۴	%۰.۸۱
جمع	۵,۲۹۹,۳۹۲,۰۷۸,۶۷۷	%۱۰۰



صندوق دریای آبی فیروزه



تهران، نیاوران، خیابان شهید دکتر باهنر، پایین تر از چهارراه مژده، کوچه صالحی، پلاک ۰
ساختمان فیروزه، طبقه دوم

کد پستی: ۱۹۷۱۹۸۳۱۱۵



صندوق سرمایه‌گذاری
دریای آبی فیروزه
شماره ثبت: ۵۴۵۵۰