



فیروزه

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی اهرمی موج فیروزه

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اهرمی موج فیروزه

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰



فیروزه

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی اهرمی موج فیروزه
شماره ثبت ۵۶۱۹۱

فهرست مطالب

۳	مقدمه
۳	تاریخچه فعالیت صندوق و معرفی صندوق
۴	اهداف صندوق
۴	اهداف صندوق
۵	واحدهای سرمایه گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن
۶	خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق
۷	ترازنامه صندوق
۸	صورت سود و زیان و 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 وضع عمومی صندوق سرمایه‌گذاری اهرمی موج فیروزه برای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ بر پایه سوابق، مدارک و اطلاعات موجود ارائه می‌گردد. گزارش حاضر به عنوان گزارش دوره ای 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 وضع 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 اهرمی موج فیروزه که صندوقی از نوع صندوق های سرمایه‌گذاری در سهام محسوب می‌شود. در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۲۰ تحت شماره ۵۶۱۹۱ و شناسه ملی ۱۴۰۱۲۵۶۳۳۲۴ در اداره کل ثبت شرکتها و موسسات غیر تجاری به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل صندوق، جمع آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده (۵) اساسنامه به منظور کاهش ریسک سرمایه‌گذاری و بهره‌گیری از صرفه جویی های ناشی از مقیاس و تامین منافع سرمایه‌گذاران است. موضوع اصلی فعالیت صندوق، سرمایه‌گذاری در انواع اوراق بهادار از جمله سهام و حق تقدم سهام پذیرفته شده در بورس تهران و فرابورس ایران، گواهی سپرده کالایی، اوراق بهادار بادرآمد ثابت، سپرده ها و گواهی های سپرده بانکی است. موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار بادرآمد ثابت می‌باشد.

معرفی صندوق

جدول مشخصات صندوق سرمایه‌گذاری اهرمی موج فیروزه به شرح زیر می‌باشد:

صندوق سرمایه‌گذاری اهرمی موج فیروزه	
نوع صندوق	سرمایه‌گذاری در سهام
تاریخ آغاز فعالیت	۱۴۰۲/۰۸/۲۲
مدیر صندوق	شرکت سبذگردان توسعه فیروزه
مدیر سرمایه‌گذاری	سالار میرزائی حصار، هانیه جعفری نجف‌آبادی، حسین پارسا سرشت
مدیر ثبت صندوق	شرکت کارگزاری فیروزه آسیا
متولی صندوق	موسسه حسابرسی آگاهان و همکاران
حسابرس	موسسه حسابرسی آتیه اندیش نمودگر
سایت صندوق	mojfund.ir

اهداف و استراتژی های صندوق:

۱-۲- 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.

۲-۲- موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار است. صندوق فقط می‌تواند در دارایی‌های ریالی داخل کشور سرمایه‌گذاری کند و سرمایه‌گذاری خارجی (ارزی) به هر نوع و شکل غیرمجاز می‌باشد. صندوق در دارایی‌هایی به شرح زیر سرمایه‌گذاری می‌کند:

۱-۲-۲: سهام پذیرفته‌شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول و دوم فرابورس ایران و سهام قابل معامله در بازار پایه فرابورس ایران؛

۲-۲-۲: حق تقدم خرید سهام موضوع بند قبل؛

۳-۲-۲: «واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق‌های سرمایه‌گذاری غیر از اوراق بهادار» از جمله صندوق‌های سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان و صندوق‌های سرمایه‌گذاری پروژه؛

۴-۲-۲: سرمایه‌گذاری در گواهی سپرده کالایی که صرفاً به قصد فروش قبل از سررسید اوراق و یا قبل از زمان تحویل فیزیکی خواهد بود.

۵-۲-۲: اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:

الف- مجوز انتشار آن‌ها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

ب- سود حداقلی برای آن‌ها تضمین و مشخص شده باشد؛

ج- در یکی از بورس‌ها قابل معامله باشد؛

۶-۲-۲: گواهی‌های سپرده منتشره توسط بانک‌ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۷-۲-۲: هر نوع سپرده‌گذاری نزد بانک‌ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

۸-۲-۲: اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی اوراق بهادار، صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار موجود در صندوق سرمایه‌گذاری و اتخاذ موقعیت خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار صرفاً به منظور بستن موقعیت‌های فروشی که قبلاً در قراردادهای آتی اوراق بهادار اتخاذ نموده‌اند.

۹-۲-۲: اوراق بهاداری که صندوق در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید آن‌ها مشارکت می‌کند، باید علاوه بر خصوصیات مندرج در بند ۲-۲-۵، دارای خصوصیات زیر باشند:

۲-۹-۱: حداقل سود تعیین شده یا پیش‌بینی شده برای اوراق بهادار و بازپرداخت اصل اوراق بهادار در مواعد مقرر، توسط ضامن معتبری تضمین شده باشد؛

۲-۹-۲: بازدهی تعیین‌شده یا پیش‌بینی شده برای اوراق بهادار، کمتر از بازدهی پیش‌بینی شده یا تضمین‌شده برای صندوق سرمایه‌گذاری نباشد یا در صورت عدم پیش‌بینی یا تضمین بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری، بازدهی تعیین‌شده یا پیش‌بینی شده برای اوراق بهادار، از متوسط بازدهی اوراق بهادار موضوع بند ۲-۲-۵ که در مالکیت صندوق است، کمتر نباشد.

۲-۳: این صندوق از نوع صندوق سرمایه‌گذاری در سهام است. در طول عمر صندوق حدنصاب‌های صندوق بر اساس آخرین نصاب اعلام شده توسط سازمان متناسب با نوع صندوق باید رعایت شود. آخرین نصاب مجاز در تارنمای صندوق به روزآوری می‌شود.

۲-۴: مدیر می‌تواند به‌منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار موجود در سبد دارایی صندوق، در بازار معاملات آتی اوراق بهادار شرکت نموده و تا سقف دارایی هر ورقه در صندوق، اقدام به اتخاذ موقعیت فروش در قرارداد آتی آن ورقه نماید. در هر زمان باید تعداد اوراق بهادار در موقعیت‌های فروش باز صندوق در قراردادهای آتی، از تعداد همان نوع ورقه که در سبد دارایی صندوق قرار دارد کمتر باشد. در صورتی که در اثر فروش اوراق بهادار، تعداد اوراق بهادار موجود در سبد دارایی از تعداد اوراق بهاداری که صندوق در قراردادهای آتی متعهد به فروش آن‌ها شده است، کمتر گردد؛ مدیر موظف است قبل از فروش اوراق بهادار مربوطه، با اتخاذ موقعیت تعهد خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار، تعداد اوراق بهاداری را که صندوق در قرارداد آتی متعهد به فروش آن شده است را به میزان کافی کاهش دهد.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق و حقوق دارندگان آن

ارزش مبنای هر واحد سرمایه‌گذاری برابر ده هزار ریال است. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق در قالب واحدهای ممتاز و عادی به شرح زیر قابل تقسیم است:

الف) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که در دو نوع واحدهای ممتاز نوع اول و واحدهای ممتاز نوع دوم هستند.

الف-۱) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع اول در قبال آورده مؤسسين قابل صدور است. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع اول دارای حق حضور و حق رأی در مجامع صندوق هستند. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر بوده و صرفاً در بورس و با رعایت مقررات آن، قابل انتقال می‌باشد.

الف-۲) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع دوم طی دوره فعالیت صندوق برای عرضه به عموم سرمایه‌گذاران توسط بازارگردان قابل صدور است. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع دوم دارای حق حضور و حق رأی در مجامع صندوق نیستند. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر بوده و صرفاً در بورس و با رعایت مقررات آن، قابل انتقال می‌باشد و بازارگردان در چارچوب مقررات بازارگردانی و مفاد اساسنامه و امیدنامه، بازارگردانی آن‌ها را تعهد کرده است. واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع دوم تحت تملک بازارگردان با رعایت تشریفات این اساسنامه قابل ابطال نیز می‌باشد. حداکثر واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع دوم نزد سرمایه‌گذاران در امیدنامه قید شده است.

ب) واحدهای سرمایه‌گذاری عادی پس از صدور مجوز فعالیت صندوق صادر می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری عادی دارای حق رأی و حق حضور در مجامع صندوق نمی‌باشند. واحدهای سرمایه‌گذاری عادی تحت تملک سرمایه‌گذاران، با رعایت تشریفات اساسنامه صندوق قابل ابطال است.

در تاریخ ارائه گزارش دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز نوع اول شامل اشخاص زیر است:

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی اهرمی موج فیروزه			
ردیف	نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحد	درصد واحدهای تحت تملک
۱	شرکت سبدگردان توسعه فیروزه	۵.۱۰۰.۰۰۰	٪۵۱
۲	شرکت گروه سرمایه‌گذاری توسعه صنعتی ایران	۲.۴۵۰.۰۰۰	٪۲۴.۵
۳	شرکت سرمایه‌گذاری توسعه صنعت و تجارت	۲.۴۵۰.۰۰۰	٪۲۴.۵
	جمع	۱۰.۰۰۰.۰۰۰	٪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.

خالص ارزش دارایی‌های هر واحد صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

خالص ارزش دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری در پایان هر روز برابر با ارزش روز دارایی‌های صندوق در پایان آن روز منهای بدهی‌های صندوق در پایان آن روز تقسیم بر تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری نزد سرمایه‌گذاران در پایان همان روز است. خالص ارزش دارایی‌های هر واحد در انتهای دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ به شرح جدول ذیل می‌باشد:

ردیف	شرح	۱۴۰۳/۱۰/۳۰
۱	ارزش اسمی هر واحد	۱۰,۰۰۰
۲	تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری	۶,۴۴۹,۵۱۲,۲۲۸
۳	نرخ صدور	۱۶,۹۲۲
۴	نرخ ابطال	۱۶,۸۱۴

ترازنامه صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

صورت خالص دارایی	
ریال	دارایی ها:
۹۵,۹۵۴,۵۰۶,۲۸۷,۳۳۳	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۶,۸۹۷,۰۱۶,۹۹۷,۳۰۲	سرمایه گذاری در سپرده بانکی و گواهی سپرده بانکی
۶,۳۱۷,۵۱۴,۳۹۱,۱۳۴	سرمایه گذاری در سپرده کلایی
۵۷۵,۹۰۱,۳۱۳,۴۰۵	حساب های دریافتی
۱,۳۴۴,۱۳۵,۴۲۱	سایر دارایی ها
۱۰۹,۷۴۶,۲۸۳,۱۲۴,۵۹۵	جمع دارایی ها
۷۵,۷۸۷,۲۱۲,۳۳۷	جاری کارگزاران
۱,۰۴۵,۰۸۴,۰۴۳,۲۵۷	بدهی به ارکان صندوق
۱۴,۸۵۵,۹۴۷,۴۴۴	پرداختی به سرمایه گذاران
۱۶۷,۶۰۷,۵۳۷,۳۲۶	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱,۳۰۳,۳۳۴,۷۴۰,۳۶۴	جمع بدهی ها
۱۰۸,۴۴۲,۹۴۸,۳۸۴,۲۳۱	خالص دارایی ها
۶,۴۴۹,۵۱۲,۲۲۸	تعداد واحد های سرمایه گذاری

صورت سود و زیان دوره مالی شش ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

صورت سود و زیان	
ریال	درآمدها
۱,۱۲۱,۷۴۳,۸۶۷,۸۴۴	سود (زیان) فروش اوراق بهادار
۱۹,۴۶۲,۲۰۱,۵۵۹,۹۰۷	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۳,۰۳۱,۶۰۸,۶۳۱,۰۹۳	سود سهام
۳۵۰,۲۱۷,۴۲۶,۱۸۶	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۲۷,۹۷۷,۴۸۶,۴۵۶	سایر درآمدها
۲۴,۳۹۳,۷۴۸,۹۷۱,۴۸۶	جمع درآمدها
۱,۲۲۰,۱۳۷,۰۷۲,۷۷۳	هزینه کارمزد ارکان صندوق
۱۲,۹۷۷,۶۷۱,۴۶۳	سایر هزینه ها
۱,۲۳۳,۱۱۴,۷۴۴,۲۳۶	جمع هزینه ها
۲۳,۱۶۰,۶۳۴,۲۲۷,۲۵۰	سود خالص

ترکیب دارایی‌های صندوق سهامی اهرمی موج فیروزه در تاریخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰

عنوان	خالص ارزش دارایی ها (ریال)	نسبت به کل دارایی ارزش روز (درصد)
سهام و حق تقدم	۹۵,۹۵۴,۵۰۶,۲۸۷,۳۳۳	٪۹۳.۱۹
نقد و بانک	۶,۸۹۷,۰۱۶,۹۹۷,۳۰۲	٪۶.۲۸
حساب های دریافتی تجاری	۵۷۵,۹۰۱,۳۱۳,۴۰۵	٪۰.۵۲
سایر دارایی ها	۱,۳۴۴,۱۳۵,۴۲۱	٪۰
جمع کل	۱۰۹,۷۴۶,۲۸۳,۱۲۴,۵۹۵	٪۱۰۰



فیروزه

سندوق سرمایه‌گذاری سهامی اهرمی موج فیروزه
شماره ثبت: ۵۶۱۹۱



تهران، نیاوران، بین سه راه مژده و دزاشیب، خیابان شهید دکتر باهنر، نبش کوچه صالحی، پلاک ۰
ساختمان فیروزه، طبقه دوم

کد پستی: ۱۹۷۱۹۸۳۱۱۵



فیروزه

سندوق سرمایه‌گذاری سهامی اهرمی
موج فیروزه
شماره ثبت: ۵۶۱۹۱