

به نام خدا

صورتجلسه کمیته سیاست‌گذاری مدیریت صندوق‌های سرمایه‌گذاری

سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۵

دستور جلسه:

- بررسی عملکرد صندوق‌های تحت مدیریت
- بررسی شاخص سورتینو جهت ارزیابی عملکرد مبتنی بر ریسک در صندوق‌ها
- سایر موارد در صلاحیت کمیته

مصوبات:

- ۱- بازده صندوق‌های تحت مدیریت (قابل معامله سهامی، سهامی و مختلط) و مقایسه آن با شاخص‌های مربوطه به شرح جدول زیر به استحضار اعضاء رسید:

نام صندوق	نوع صندوق	بازدهی سالانه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱		بازدهی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	
		شاخص کل	صندوق	شاخص کل هم وزن	شاخص کل هم وزن
صندوق سرمایه‌گذاری آسمان آرمانی سهام	قابل معامله سهامی	۸۸.۴۶%	۰.۴۲%	۸۲.۴۲%	-۲.۴۲%
صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان یکم	سهامی	۹۰.۲%	۰.۹۸%		
صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان خاورمیانه	مختلط	۷۶.۵۷%	۵.۶۶%		

- ۲- بازده صندوق‌های تحت مدیریت (با درآمد ثابت) و مقایسه آن با شاخص‌های مربوطه به شرح جدول زیر به استحضار اعضاء رسید:

نام صندوق	نوع صندوق	بازدهی سالانه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱		بازدهی سه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	
		شاخص وزنی اخزا	صندوق	شاخص وزنی اخزا	صندوق
صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان امید	با درآمد ثابت بدون پیش بینی سود	۲۵.۰۹%	۶.۱۳%	۱۶.۷%	۲.۷۸%
صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان سهند	با درآمد ثابت	۲۵.۰۱%	۶.۰۲%		

۳- شاخص سورتینو ارزیابی عملکرد مبتنی بر ریسک و مقایسه آن با شاخص کل و شاخص هم وزن به شرح جدول زیر به استحضار اعضاء رسید:

دوره سالانه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱			نوع صندوق	نام صندوق
شاخص سورتینو (شاخص هم وزن)	شاخص سورتینو (شاخص کل)	شاخص سورتینو		
۰.۳۸	۰.۴۵	۰.۹۶	قابل معامله سهامی	صندوق سرمایه‌گذاری آسمان آرمانی سهام
		۱.۰۱	سهامی	صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان یکم
		۱.۴۴	مختلط	صندوق سرمایه‌گذاری مشترک آسمان خاورمیانه
		-۰/۴۸	با درآمد ثابت بدون تقسیم سود	صندوق سرمایه‌گذاری آسمان امید
		-۰/۴۵	با درآمد ثابت با تقسیم سود	صندوق سرمایه‌گذاری آسمان سهند

حاضرین در جلسه:

سرکار خانم نسترن محمدی (عضو کمیته)	جناب آقای مهرداد محمودی (دبیر کمیته)	جناب آقای جواد جمالی (عضو هیئت مدیره و رییس کمیته)
	 مهرداد محمدودی	