



## صندوق اختصاصی بازارگردانی داناپان

گزارش عملکرد مدیر صندوق برای سال مالی منتهی به

۱۴۰۳/۰۳/۳۱

با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان برای سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ماه ۱۴۰۳ که در اجرای بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق براساس سوابق، مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده است به شرح زیر تقدیم می‌گردد:

## ۱ - اطلاعات کلی صندوق

### ۱-۱ تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان در تاریخ ۱۴۰۰/۰۸/۰۸ تحت مجوز شماره ۱۱۸۹۵ از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه‌گذاری موضوع بند ۲۰ ماده ۱ قانون بازار اوراق بهادار مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، فعالیت خود را آغاز کرد. این صندوق در تاریخ ۱۴۰۰/۰۷/۲۸ تحت شماره ۵۲۴۲۲ و شناسه ملی ۱۴۰۱۰۴۴۳۹۱۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیرتجاری تهران به ثبت رسیده است. عملکرد این صندوق بر اساس مفاد اساسنامه و امیدنامه و در چارچوب قوانین و مقررات مربوطه است. فعالیت این صندوق تحت نظارت سبا انجام شده و متولی صندوق نیز به طور مستمر فعالیت آن را زیر نظر دارد. مدیریت دارایی‌های صندوق که عمدتاً شامل اوراق مشارکت، اوراق صکوک و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت است توسط مدیر سرمایه‌گذاری صندوق صورت می‌گیرد. این صندوق از نوع صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی با هدف مشخص بازارگردانی مجموعه‌ای از سهام اعلام‌شده در این امیدنامه در بورس تهران/ فرابورس ایران تأسیس شده است. بنابراین این صندوق به غیر از سهام و حق تقدم خرید سهام موضوع بازارگردانی، در سایر سهام و حق تقدم خرید سهام، سرمایه‌گذاری نمی‌کند؛ و تنها در راستای اجرای تعهدات و مدیریت نقدینگی دارایی‌های خود به منظور اجرای صحیح تعهدات بازارگردانی، در سپرده‌های بانکی و سایر اوراق با مشخصات بند ۲-۲-۳- این امیدنامه سرمایه‌گذاری می‌کند.

### ۲-۱ اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس [www.danayan.fund](http://www.danayan.fund) درج گردیده است.

### ۲-۲ ارکان صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان، از ارکان زیر تشکیل شده است:

• **مجمع صندوق:** از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری ممتاز از حق رای در مجمع برخوردارند. در تاریخ ترازنامه دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرح زیر است:

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری ممتاز	شماره ثبت	شناسه / کد ملی	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز
۱	شرکت کارگزاری دانایان (سهامی خاص)	۲۳۳۶۳	۱۰۱۰۲۸۲۸۰۰۴	۶۳,۰۰۰	٪۶۰
۲	گروه مالی دانایان (سهامی عام)	۲۵۲۲۷۹	۱۰۱۰۲۹۲۷۱۹۸	۴۲,۰۰۰	٪۴۰
	جمع			۱۰۵,۰۰۰	٪۱۰۰

• **مدیر صندوق:** شرکت کارگزاری دانایان است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۲/۱۲ با شماره ثبت ۲۳۳۶۳ و شناسه ملی ۱۰۱۰۲۸۲۸۰۰۴ نزد مرجع ثبت شرکت ها مشهود به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، خیابان زاینده رود غربی، پلاک ۳ کدپستی ۱۹۹۱۶۳۴۴۱۳

• **متولی صندوق:** موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهیافت و همکاران است که در تاریخ ۱۳۷۷/۰۲/۲۷ با شماره ثبت ۵۸۹ و شناسه ملی ۱۰۳۸۰۰۷۶۴۶۰ نزد مرجع ثبت شرکت ها مشهود به ثبت رسیده است. آدرس دفتر تهران متولی: خیابان سهوردی جنوبی، پایین تر از مطهری، خیابان برادران نوبخت، شماره ۲۹، طبقه اول، واحدهای یک و دو کد پستی: ۹۱۳۳۹۱۳۱۱۵

• **حسابرس صندوق:** موسسه حسابرسی وانیا نیک تدبیر است که در تاریخ ۱۳۹۰/۱۰/۲۸ با شماره ثبت ۲۸۶۵۰ و شناسه ملی ۱۰۳۲۰۷۲۱۸۶۲ نزد مرجع ثبت شرکت ها مشهود به ثبت رسیده است. آدرس دفتر تهران حسابرس: بلوار آفریقا (جردن)، خ گلدان، پلاک ۸ واحد ۳، کد پستی ۱۹۶۶۸۸۳۴۷۴

## ۲-۱ مدیر سرمایه گذاری:

• مجتبی نجفی

## ۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق اختصاصی بازارگردانی دانایان در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱:

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۹ نفر

تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری: ۲,۱۷۳,۴۲۳ واحد

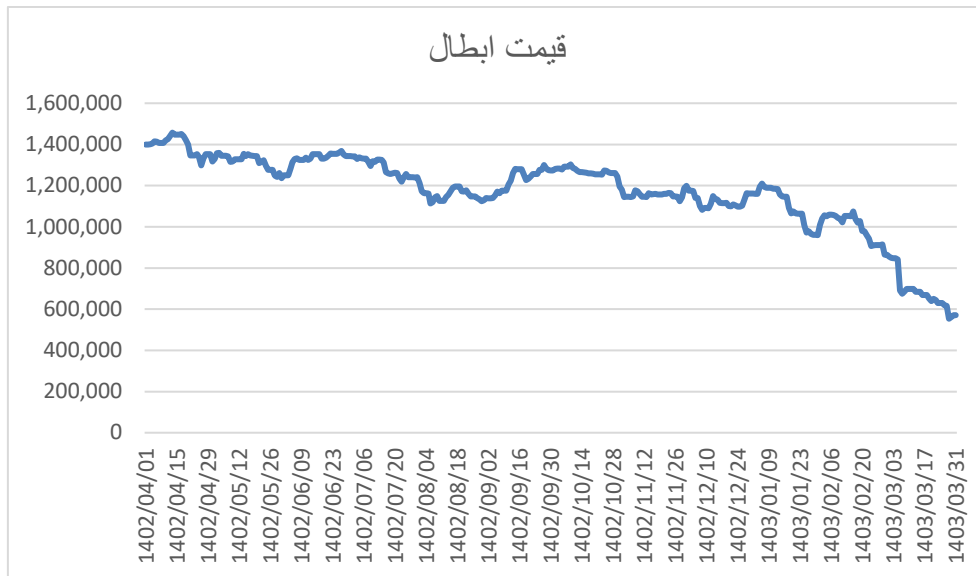
NAV ابطال: ۵۷۰,۵۰۴ ریال

NAV صدور: ۵۷۱,۷۰۷ ریال

کل خالص ارزش دارایی های صندوق: ۱,۲۳۹,۹۴۵,۸۷۳,۸۱۷ ریال

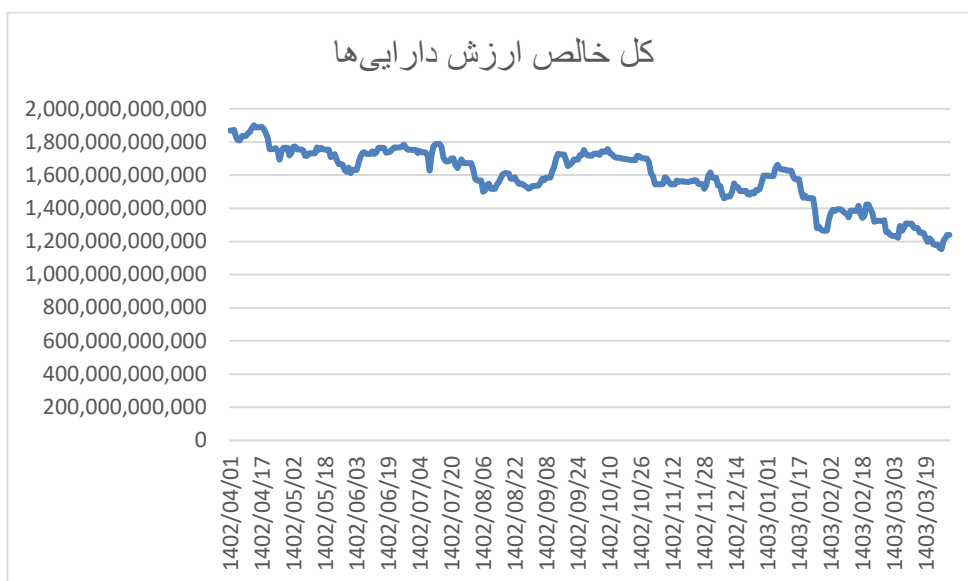
### ۳- بازدهی صندوق:

۳-۱ در نمودار زیر خالص ارزش روزانه هر واحد سرمایه گذاری برای دوره منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ نمایش داده شده است.



۳-۲- خالص ارزش دارایی های صندوق در ابتدای سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ معادل ۱,۸۶۹ میلیارد ریال بوده که این میزان در پایان سال مالی ۱,۲۴۰ میلیارد ریال می باشد.

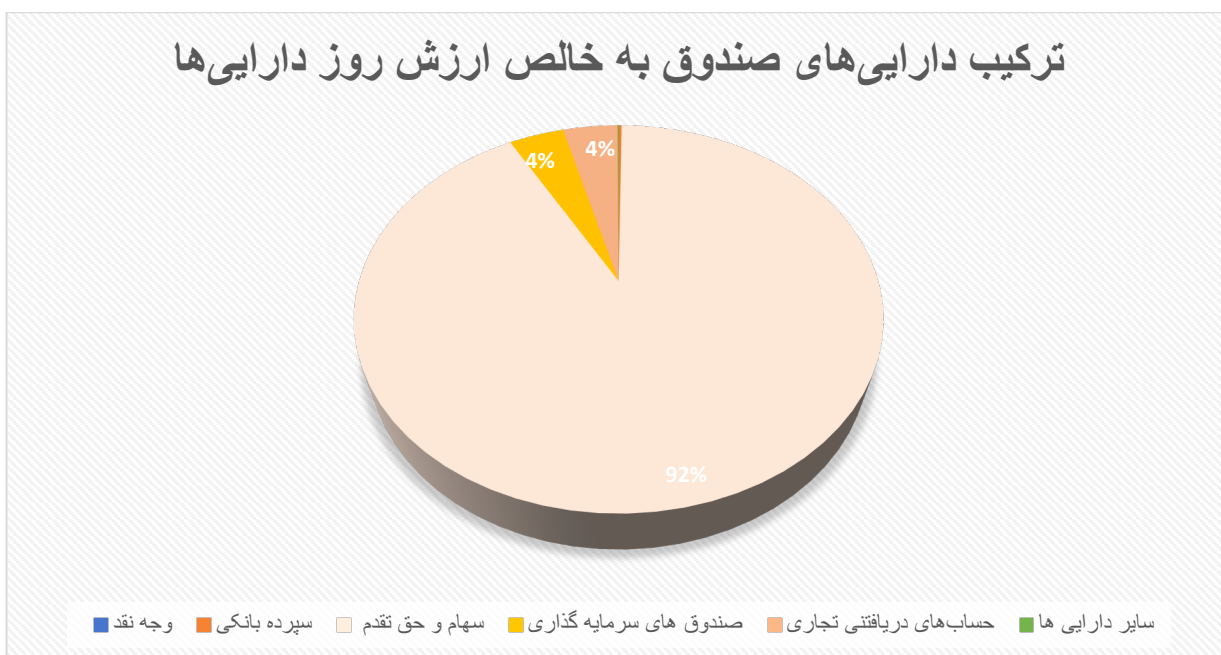
در نمودار زیر روند تغییرات ارزش خالص دارایی های صندوق اختصاصی بازارگردانی دانایان طی سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ نمایش داده شده است.



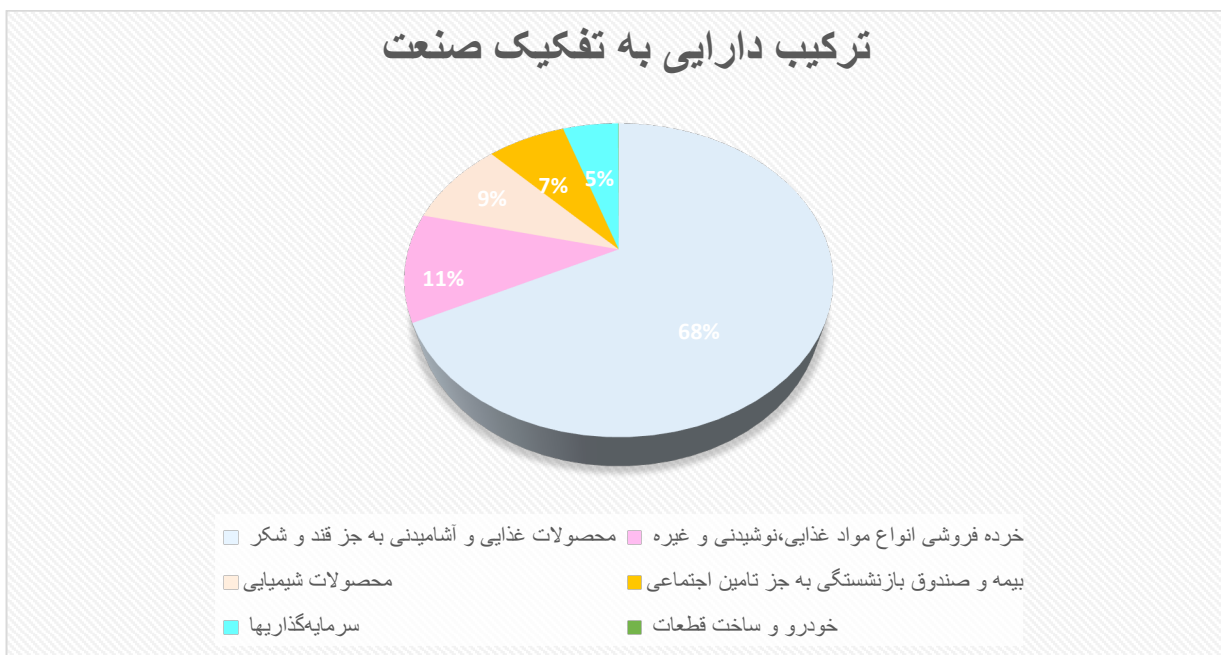
۴- ترکیب دارایی‌های صندوق در طی سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱

عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارایی به ارزش روز
وجه نقد	۱,۵۳۲,۴۱۲	٪۰.۰۰۰۱
سپرده بانکی	۳,۹۰۹,۰۰۹,۴۹۶	٪۰.۲۱
سهام و حق تقدم	۱,۷۳۴,۹۸۵,۶۱۱,۳۷۴	٪۹۱
صندوق های سرمایه گذاری	۸۲,۴۹۶,۷۷۱,۵۲۹	٪۴
حساب‌های دریافتی تجاری	۷۹,۷۲۸,۳۹۲,۲۴۶	٪۴
سایر دارایی ها	۱,۴۵۶,۴۰۰,۱۴۲	٪۰.۰۰۸
	<b>۱,۹۰۲,۵۷۷,۷۱۷,۱۹۸</b>	<b>٪۱۰۰</b>

ترکیب دارایی‌های صندوق به خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



همچنین ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک صنعت سرمایه‌گذاری در سهام در تاریخ ۱۴۰۳/۰۳/۳۱ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



#### ۵- خرید و فروش سهام طی دوره :

مجموع خرید و فروش سهام در صندوق بازارگردانی دانایان به تفکیک نماد به شرح جدول زیر می‌باشد:

نماد	خرید		فروش	
	تعداد	مبلغ (ریال)	تعداد	مبلغ (ریال)
باران	۸۸,۱۶۴,۴۱۵	۵۲۰,۷۷۵,۳۶۹,۳۵۵	۹۵,۹۶۰,۶۶۵	۵۱۰,۶۲۵,۸۵۷,۲۳۰
زنجان	۷۰,۰۴۹,۷۱۸	۲۴۸,۲۱۸,۶۸۵,۹۳۲	۴۵,۳۹۰,۴۹۲	۲۰۷,۰۲۷,۹۱۷,۲۷۹
ودانا	۷۴,۸۸۷,۵۵۵	۸۳۸,۷۲۴,۹۵۳,۰۲۰	۷۰,۰۰۱,۶۰۷	۸۴۸,۶۱۴,۴۸۶,۴۵۱
غپینو	۳۹,۴۰۱,۸۵۸	۲۲۲,۷۸۸,۱۷۰,۲۷۷	۱۵,۸۹۷,۲۲۳	۲۱۸,۶۱۷,۱۲۷,۸۵۹
غصینو	۳۳,۰۸۲,۶۶۷	۴۰۰,۶۹۵,۷۵۷,۷۸۵	۱۸,۵۶۷,۷۸۰	۳۶۷,۷۴۵,۳۰۶,۷۷۶
قاسم	۳۴,۶۱۸,۳۳۶	۲۵۳,۸۳۹,۴۶۴,۰۴۱	۱۴,۶۷۹,۹۰۷	۱۲۵,۸۳۵,۷۰۶,۰۸۳
غمینو	۱۶,۲۴۶,۶۶۶	۱۶۴,۴۳۱,۴۷۱,۵۲۱	۱۳,۲۴۴,۹۹۱	۱۵۳,۹۷۰,۴۹۴,۳۲۹
خودکفا	۸۳,۵۱۴,۳۶۵	۷۱۳,۸۹۱,۲۴۹,۲۳۲	۲۷,۲۹۷,۳۴۳	۲۷۲,۴۵۵,۱۶۰,۵۲۶
دانیک	۸,۳۸۴,۱۷۰	۸۷,۲۱۶,۰۹۱,۲۳۱	۳,۷۷۸,۳۱۴	۴۱,۵۸۰,۹۹۹,۷۹۰

## ۶- گزارشات مالی صندوق

### صورت خالص دارایی ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی داناان

صورت خالص دارایی‌ها

به تاریخ ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۱۴۰۳/۰۳/۳۱	
ریال	ریال	
		دارایی ها:
۱,۵۵۲,۴۵۲,۹۷۳,۹۶۵	۱,۷۳۴,۹۸۵,۶۱۱,۳۷۴	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۶,۲۸۸,۱۴۲,۱۴۰	۸۲,۴۹۶,۷۷۱,۵۲۸	سرمایه گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳,۲۷۷,۳۹۸,۶۳۵	۳,۹۰۹,۰۰۹,۴۹۶	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۳۱۵,۹۵۰,۵۳۴,۸۶۶	.	سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۱,۲۶۱,۱۵۷,۹۲۴	۷۹,۷۲۸,۳۹۲,۲۴۶	حساب‌های دریافتی
۱,۸۷۳,۵۰۵,۲۹۰	۱,۴۵۶,۴۰۰,۱۴۲	سایر دارایی ها
۵۶۲,۸۱۲	۱,۵۳۲,۴۱۲	موجودی نقد
.	.	جاری کارگزاران
۱,۹۵۱,۱۰۴,۱۷۵,۶۳۲	۱,۹۰۲,۵۷۷,۷۱۷,۱۹۸	جمع دارایی ها
		بدهی ها:
۷۱,۵۵۵,۲۳۸,۶۷۳	۶۴۴,۸۵۰,۰۳۷,۶۶۴	جاری کارگزاران
۷,۴۹۹,۵۸۶,۲۹۰	۱۴,۵۲۹,۸۶۷,۳۱۱	پرداختی به ارکان صندوق
۷۲,۵۶۰,۰۰۰,۰۰۰	.	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۲,۴۸۵,۷۱۷,۲۹۴	۳,۲۵۱,۹۳۸,۴۰۶	سایر حساب های پرداختی و ذخایر
۱۵۴,۱۰۰,۵۴۲,۲۵۷	۶۶۲,۶۳۱,۸۴۳,۳۸۱	جمع بدهی ها
۱,۷۹۷,۰۰۳,۶۳۳,۳۷۵	۱,۲۳۹,۹۴۵,۸۷۳,۸۱۷	خالص دارایی ها
۱,۳۹۳,۳۴۱	۵۷۰,۵۰۴	خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری- ریال

## صورت سود و زیان :

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان

صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

سال مالی منتهی به ۳۱ خرداد ۱۴۰۳

سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۳/۰۳/۳۱	
		درآمدها:
۳۳۲,۴۱۹,۱۰۱,۰۳۹	۶,۹۱۵,۲۴۸,۰۸۴	سود فروش اوراق بهادار
(۶۰,۱۳۳,۲۴۳,۸۲۵)	(۷۲۷,۵۷۲,۷۳۴,۸۹۵)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۴۴,۲۵۲,۵۹۸,۰۳۷	۹۸,۸۶۷,۹۶۱,۷۴۸	سود سهام
۸,۹۵۱,۴۶۸,۶۹۷	۴۶۸,۰۰۷,۸۸۰	سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷۶۴,۲۶۶	۷,۸۸۷,۵۶۳,۵۵۷	سایر درآمدها
۳۲۵,۴۹۰,۶۸۸,۲۱۴	(۶۱۳,۴۳۳,۹۵۳,۶۲۶)	جمع درآمدها(زیان‌ها)
		هزینه‌ها:
۱۲,۱۹۵,۲۷۹,۶۵۲	۴۰,۰۶۸,۵۵۲,۲۸۳	هزینه کارمزد ارکان
۳,۰۰۸,۸۶۴,۳۸۳	۴,۶۹۰,۸۷۲,۵۳۶	سایر هزینه‌ها
۱۵,۲۰۴,۱۴۴,۰۳۵	۴۴,۷۵۹,۴۲۴,۸۱۹	جمع هزینه‌ها
۳۱۰,۲۸۶,۵۴۴,۱۷۹	(۶۵۸,۱۹۳,۳۷۸,۴۴۵)	سود (زیان) قبل از هزینه مالی
۶,۰۴۴,۷۴۶,۶۷۰	۱۳۰,۹۲۶,۲۷۰,۰۶۰	هزینه مالی
۳۰۴,۲۴۱,۷۹۷,۵۰۹	(۷۸۹,۱۱۹,۶۴۸,۵۰۵)	سود (زیان) خالص
۴۳/۴۰٪	-۴۹/۵۷٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
۱۷/۰۵٪	-۶۳/۶۴٪	بازده سرمایه‌گذاری پایان دوره (درصد)

## ۷- تعهدات صندوق

نام شرکت	حداقل سفارش انباشته	حداقل سفارش روزانه	دامنه مظنه
بیمه زندگی باران	۳۲۶,۰۲۵	۶,۵۲۰,۵۰۰	٪۴
صنایع کشاورزی و کود زنجان	۱۲۹,۱۲۵	۲,۵۸۲,۵۰۰	٪۳
سرمایه‌گذاری دانایان	۴۵,۲۰۰	۹۰۴,۰۰۰	٪۴
صنعتی پارس مینو	۱۱۴,۱۰۰	۲,۲۸۲,۰۰۰	٪۲.۲۵
شرکت صنعتی مینو	۶۰,۰۵۰	۱,۲۰۱,۰۰۰	٪۲.۲۵
شرکت قاسم ایران	۱۰۱,۰۵۰	۲,۰۲۱,۰۰۰	٪۲.۵
صنایع غذایی مینو شرق	۵۷,۶۷۵	۱,۱۵۳,۵۰۰	٪۲
شرکت اقتصادی و خودکفائی آزادگان	۱۲۴,۱۰۰	۲,۴۸۲,۰۰۰	٪۳
صندوق املاک و مستغلات نیک رای	۷,۵۰۰	۱۵۰,۰۰۰	٪۱