



صندوق اختصاصی بازارگردانی دانا یان

گزارش عملکرد مدیر صندوق برای دوره ۶ ماهه منتهی به

۱۴۰۳/۰۹/۳۰

با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانیان برای دوره ۶ ماهه منتهی به ۳۰ آذرماه 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 دانیان 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 ۲-۳ این امیدنامه سرمایه‌گذاری می‌کند.

۱-۲ اطلاع رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانیان مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق سرمایه‌گذاری به آدرس www.danayan.fund درج گردیده است.

۲- ارکان صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانیان، 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 سرمایه گذاری ممتاز	شماره ثبت	شناسه / کد ملی	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۱	شرکت کارگزاری دانیان (سهامی خاص)	۲۳۳۶۳	۱۰۱۰۲۸۲۸۰۰۴	۶۳,۰۰۰	٪۶۰
۲	گروه مالی دانیان (سهامی عام)	۲۵۲۲۷۹	۱۰۱۰۲۹۲۷۱۹۸	۴۲,۰۰۰	٪۴۰
	جمع			۱۰۵,۰۰۰	٪۱۰۰

- **مدیر صندوق:** شرکت کارگزاری دانیان 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 سهروردی جنوبی، پایین تر از مطهری، خیابان برادران نوبخت، شماره ۲۹، طبقه اول، واحدهای یک و دو کد پستی: ۹۱۳۳۹۱۳۱۱۵
- **حسابرس صندوق:** موسسه حسابرسی و انیا 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 (چردن) ، 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 دانیان در تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ :

تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی): ۱۰ نفر

تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری: ۵,۰۶۴,۵۳۸ واحد

NAV ابطال: ۴۶۲,۵۴۶ ریال

NAV صدور: ۴۶۳,۳۶۲ ریال

کل خالص ارزش دارایی های صندوق: ۲,۳۴۲,۵۸۳,۱۵۹,۷۲۶ ریال

۴- ترکیب دارایی‌های صندوق طی دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

عنوان دارایی	خالص ارزش دارایی	نسبت از کل دارائی به ارزش روز
وجه نقد	۳۸۷,۲۱۲	۰٪
سپرده بانکی	۲۱۸,۰۵۱,۲۱۱,۳۹۹	۶/۸۷٪
سهام و حق تقدم	۲,۷۳۶,۳۶۷,۵۶۰,۸۴۰	۸۶/۱۹٪
صندوق های سرمایه گذاری	۲۰,۶۳۶,۹۹۶,۳۵۹	۰/۶۵٪
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۳۶,۱۳۳,۵۴۱,۶۴۵	۰/۱۱٪
حساب‌های دریافتی تجاری	۳,۵۰۶,۵۶۹,۴۸۰	۵/۰۲٪
پیش پرداخت‌ها	۱۵۹,۳۲۲,۱۹۶,۴۵۹	۰/۰۳٪
سایر دارایی ها	۸۸۳,۸۹۰,۰۰۷	۱/۱۴٪
	۳,۱۷۴,۹۰۲,۳۵۳,۴۰۱	٪۱۰۰

ترکیب دارایی‌های صندوق به خالص ارزش روز دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



همچنین ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک صنعت سرمایه‌گذاری در سهام در تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ به شرح نمودار زیر می‌باشد:



۵- خرید و فروش سهام طی دوره :

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

نماد	خرید		فروش	
	تعداد	مبلغ (ریال)	تعداد	مبلغ (ریال)
باران	۲۹,۱۱۴,۹۶۸	۴۸,۶۱۷,۸۳۲,۰۹۵	۱۱,۳۶۴,۸۸۹	۱۹,۶۸۲,۶۱۴,۸۴۷
زنجان	۱۹,۹۹۲,۴۵۴	۳۷,۹۲۵,۰۳۳,۹۱۲	۲۴,۹۶۴,۷۶۸	۴۳,۷۷۷,۷۹۶,۸۲۳
ودانا	۱۷,۳۳۶,۶۲۰	۱۸۱,۴۵۹,۳۷۳,۵۹۷	۱۸,۰۳۶,۷۹۵	۱۸۸,۶۷۲,۶۷۱,۲۴۸
غپینو	۱۴,۹۸۱,۵۸۵	۷۳,۰۸۹,۵۲۳,۲۴۱	۹۹۱,۰۹۴	۵۲,۶۲۱,۸۸۹,۰۷۰
غصینو	۳,۰۲۱,۰۵۲	۲۲,۲۸۲,۹۶۱,۷۶۴	۵۰۰,۰۰۰	۴,۷۵۱,۷۷۱,۳۵۳
قاسم	۶,۰۲۹,۴۲۸	۲۰,۹۶۹,۰۶۴,۹۰۹	۳۵۴,۰۰۰	۱,۲۳۰,۱۷۶,۳۹۹
غمینو	۴,۸۸۶,۰۱۴	۲۵,۶۰۱,۷۷۱,۶۰۲	۲۱۹,۹۵۰	۳,۳۷۶,۶۰۰,۳۲۴
خودکفا	۵۳,۵۳۱,۲۷۳	۲۸۵,۵۱۱,۱۶۶,۱۶۳	۸۰,۱۹۳	۴۰۰,۶۶۰,۲۸۲
دانیک	۱۴,۰۱۰,۴۱۸	۱۹۵,۵۹۹,۰۹۷,۹۶۳	۱۶,۹۷۴,۳۵۹	۱۹۹,۰۴۳,۰۴۴,۲۷۶
صمپنا	۵	۴,۲۵۵,۶۱۵	-	-

۶- گزارشات مالی صندوق

صورت خالص دارایی ها

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانیان

صورت خالص دارایی‌ها

در تاریخ ۳۰ آذر ۱۴۰۳

۱۴۰۳/۰۳/۳۱	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	یادداشت
ریال	ریال	
		دارایی ها:
۱.۷۳۴.۹۸۵.۶۱۱.۳۷۴	۲.۷۳۶.۳۶۷.۵۶۰.۸۴۰	۵ سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۸۲.۴۹۶.۷۷۱.۵۲۸	۲۰.۶۳۶.۹۹۶.۳۵۹	۶ سرمایه‌گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۳.۹۰۹.۰۰۹.۴۹۶	۲۱۸.۰۵۱.۲۱۱.۳۹۹	۷ سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
.	۳۶.۱۳۳.۵۴۱.۶۴۵	۸ سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷۹.۷۲۸.۳۹۲.۲۴۶	۲۳۸.۵۰۶.۵۶۹.۴۸۰	۹ حساب‌های دریافتنی
۱.۴۵۶.۴۰۰.۱۴۲	۸۸۳.۸۹۰.۰۰۷	۱۰ سایر دارایی ها
۱.۵۳۲.۴۱۲	۳۸۷.۲۱۲	۱۱ موجودی نقد
۱.۹۰۲.۵۷۷.۷۱۷.۱۹۸	۳.۲۵۰.۵۸۰.۱۵۶.۹۴۲	جمع دارایی ها
		بدهی ها:
۶۴۴.۸۵۰.۰۳۷.۶۶۴	۴۸۷.۴۷۰.۵۶۴.۴۵۶	۱۲ جاری کارگزاران
۱۴.۵۲۹.۸۶۷.۳۱۱	۱۳.۱۴۶.۷۱۷.۷۵۲	۱۳ پرداختنی به ارکان صندوق
.	۶۸.۰۵۲.۸۰۴.۳۸۵	۱۴ پرداختنی به سرمایه‌گذاران
۳.۲۵۱.۹۳۸.۴۰۶	۳۳۹.۳۲۶.۹۱۰.۶۲۳	۱۵ سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۶۶۲.۶۳۱.۸۴۳.۳۸۱	۹۰۷.۹۹۶.۹۹۷.۲۱۶	جمع بدهی ها
۱.۲۳۹.۹۴۵.۸۷۳.۸۱۷	۲.۳۴۲.۵۸۳.۱۵۹.۷۲۶	۱۶ خالص دارایی ها
۵۷۰.۵۰۴	۴۶۲.۵۴۶	خالص دارایی های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال

صورت سود و زیان :

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان

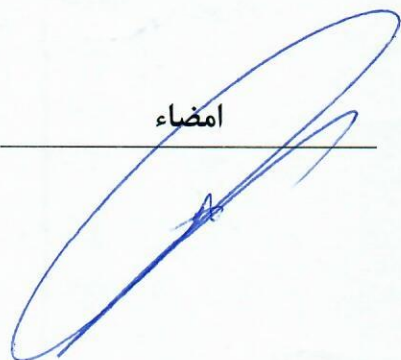
صورت سود و زیان و گردش خالص دارایی‌ها

دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۲۰

دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰	دوره ۶ ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰	یادداشت
ریال	ریال	
۶,۷۱۵,۶۶۰,۶۵۱	۷,۹۳۲,۹۱۹,۹۷۴	۱۷ سود فروش اوراق بهادار
(۱۲۳,۳۸۰,۸۸۲,۶۵۲)	۵۹۰,۷۱۹,۹۳۹,۷۲۹	۱۸ سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۹,۴۰۹,۸۲۶,۴۴۶	۶۴,۲۸۷,۸۰۶,۷۷۶	۱۹ سود سهام
۱۵۱,۳۵۰,۳۴۷	۴,۴۴۱,۹۲۷,۴۸۲	۲۰ سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۶,۰۳۸,۲۸۰,۰۰۰	۴۲,۵۹۰,۵۵۰,۶۳۴	۲۱ سایر درآمدها
(۹۱,۰۶۵,۷۶۵,۱۸۸)	۷۰۹,۴۷۳,۱۴۴,۵۹۵	جمع درآمدها(زیان‌ها)
		هزینه ها:
(۱۸,۶۳۲,۸۸۱,۴۳۷)	(۲۱,۵۳۵,۵۸۵,۵۴۳)	۲۲ هزینه کارمزد ارکان
(۲,۳۲۶,۸۱۷,۵۰۷)	(۳,۹۲۷,۹۴۴,۵۵۹)	۲۳ سایر هزینه ها
(۲۰,۹۵۹,۶۹۸,۹۴۴)	(۲۵,۴۶۳,۵۳۰,۱۰۳)	جمع هزینه ها
(۱۱۲,۰۲۵,۴۴۴,۱۳۲)	۶۸۴,۰۰۹,۶۱۴,۴۹۳	سود (زیان) قبل از هزینه مالی
۴۵,۰۰۲,۰۸۴,۵۸۵	۷۹,۶۱۷,۸۱۲,۹۶۸	۲۴ هزینه مالی
(۱۵۷,۰۰۲۸,۵۴۸,۷۱۷)	۶۰۴,۳۹۱,۸۰۱,۵۲۵	سود (زیان) خالص
-۹/۲۳٪	۳۹/۳۶٪	بازده میانگین سرمایه‌گذاری (درصد)
-۹/۱۳٪	۲۵/۸۰٪	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 دانیان	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٪
شرکت تولید انرژی‌های تجدیدپذیر مینا	۶,۲۵۰	۱۲۵,۰۰۰	۱٪

امضاء 	نماینده احمد کاظمی	رکن صندوق شرکت کارگزاری دانیان (مدیر صندوق)
--	----------------------------------	--