



دانا‌یان

صندوق بازارگردانی

گزارش عملکرد مدیر

گزارش عملکرد مدیر صندوق برای سال مالی منتهی به

۱۴۰۵/۰۳/۳۱



دانا‌یان

سبدگردان



۱- اطلاعات کلی صندوق

۱-۱ تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی دانایان در تاریخ ۱۴۰۰/۰۸/۰۸ تحت مجوز شماره ۱۱۸۹۵ از سازمان بورس و اوراق بهادار (سبا) به عنوان صندوق سرمایه گذاری 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 دارایی های صندوق که عمدتاً شامل اوراق مشارکت، اوراق صکوک و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت است و سهم توسط مدیر سرمایه گذاری صندوق صورت می گیرد. این صندوق از نوع صندوق سرمایه گذاری اختصاصی با هدف مشخص بازارگردانی مجموعه ای از سهام و صندوق و اوراق اعلام شده 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، سرمایه گذاری نمی کند؛ و تنها در راستای اجرای تعهدات و مدیریت نقدینگی دارایی های خود به منظور اجرای صحیح تعهدات بازارگردانی، در سپرده های بانکی و سایر اوراق با مشخصات بند ۲-۲ این امیدنامه سرمایه گذاری می کند.

۱-۲ اطلاع رسانی

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

۲- ارکان صندوق

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

• **مجمع صندوق:** مجمع صندوق با حضور دارندگان حداقل نصف به علاوه یک از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز دارای حق رای صندوق تشکیل و رسمیت می یابد. در تاریخ صورت خالص دارایی دارندگان واحدهای سرمایه گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده اند شامل اشخاص زیر است:

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه گذاری ممتاز	شماره ثبت	شناسه ملی	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد از کل واحدهای سرمایه گذاری ممتاز
۱	شرکت سیدگردان دارایی دانایان (سهامی خاص)	۶۴۱۲۸۸	۱۴۰۱۳۹۲۹۱۵۱	۶۲,۹۰۰	٪۵۹.۹
۲	گروه مالی دانایان (سهامی عام)	۲۵۲۲۷۹	۱۰۱۰۲۹۲۷۱۹۸	۴۲,۰۰۰	٪۴۰
	شرکت کارگزاری دانایان (سهامی خاص)	۲۳۳۶۳	۱۰۱۰۲۸۲۸۰۰۴	۱۰۰	٪۰.۱
	جمع			۱۰۵,۰۰۰	٪۱۰۰



گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



• **مدیر صندوق:** شرکت سبذگردان دارایی دانایان که در تاریخ ۱۴۰۳/۰۸/۲۰ با شماره ثبت ۶۴۱۲۸۸ و شناسه ملی ۱۴۰۱۳۹۲۹۱۵۱ نزد مرجع ثبت شرکت ها تهران به ثبت رسیده است طی نامه شماره ۱۲۲/۱۷۲۱۲۵ مورخ ۱۴۰۳/۱۲/۲۶ سازمان بورس و اوراق بهادار مدیر جدید صندوق اختصاصی بازارگردانی دانایان می باشد. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ملاصدرا، خیابان شیراز شمالی، خیابان زاینده رود غربی، پلاک ۳ کدپستی ۱۹۹۱۶۳۴۴۱۳.

• **متولی صندوق:** مؤسسه مشاور سرمایه گذاری نگین نوید که در تاریخ ۱۴۰۲/۱۱/۱۱ به شماره ثبت ۶۲۶۲۱۳ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان گاندی جنوبی، کوچه شانزدهم، پلاک ۹، طبقه ۴، واحد ۷. کد پستی: ۱۵۱۷۹۱۶۱۳۱.

• **حسابرس صندوق:** مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت سامان پندار که در تاریخ ۱۳۸۱/۰۲/۲۹ به شماره ثبت ۱۳۹۱۹ نزد مرجع ثبت شرکت های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از: بلوار آفریقا، نبش عاطفی غربی، پلاک ۱۵۲، برج صبا، طبقه ۱۲، واحد ۱۲۳. کد پستی ۱۹۶۷۹۳۶۱۱۱.

۲-۱ مدیر سرمایه گذاری :

• طلا اقبال افسری

۳- خالص ارزش روز و تعداد سرمایه گذاران

صندوق اختصاصی بازارگردانی دانایان در تاریخ ۱۴۰۵/۰۳/۳۱	
تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی)	۱۶ سرمایه گذار
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۱۶,۵۸۹,۱۰۴ واحد
خالص ارزش دارایی (NAV) صدور	۱,۱۶۸,۹۱۹ ریال
خالص ارزش دارایی (NAV) ابطال	۱,۱۶۷,۲۲۵ ریال
کل خالص ارزش دارایی های صندوق	۱۹,۳۶۳,۲۱۹,۳۶۸,۳۶۳

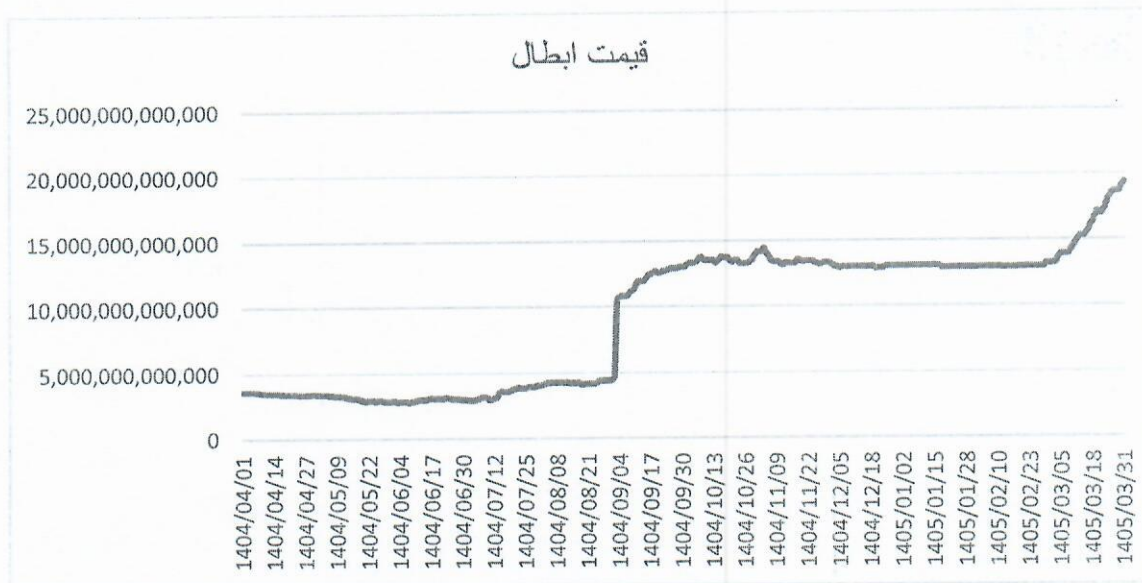


گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



۳ - بازدهی صندوق:

۳-۱ خالص ارزش روزانه



۳-۲ خالص ارزش دارایی





گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



۴- خالص دارایی‌های صندوق

۱۴۰۴/۰۳/۳۱	۱۴۰۵/۰۳/۳۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
		دارایی‌ها:
۳,۸۸۷,۵۴۶	۱۶,۸۳۶,۷۴۳	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۳۰۸,۰۵۷	۱,۶۶۹,۳۵۵	سرمایه گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۱۳۰,۰۰۰	۲۶۵,۰۰۰	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۹	۱,۳۱۷,۵۹۷	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۱۲,۰۲۴	۳۶۵,۷۳۹	حساب‌های دریافتی
۱۳۰,۲۶۸	۲۱۲,۸۱۲	پیش پرداخت‌ها
۱,۸۶۹	۳,۵۲۹	سایر دارایی‌ها
۵,۴۷۴	۲۸۹,۵۷۱	موجودی نقد
۴,۵۷۵,۲۴۸	۲۱,۰۱۹,۷۰۷	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
۷۳۷,۴۰۴	۹۷۲,۴۶۵	تسهیلات مالی دریافتی
۲۰,۷۵۴	۴۴,۷۷۷	پرداختی به ارکان صندوق
۰	۶,۱۶۹	پرداختی به سرمایه‌گذاران
۴,۰۳۳	۷۰,۲۷۵	سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر
۲۰۰,۹۷۱	۵۶۲,۸۰۱	پیش دریافت‌ها
۹۶۳,۱۶۲	۱,۶۵۶,۴۸۸	جمع بدهی‌ها
۳,۶۱۲,۵۸۳	۱۹,۳۶۳,۲۱۹	خالص دارایی‌ها
۴۸۱,۵۳۹	۱,۱۶۷,۲۲۵	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال



گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



۵- صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۴۰۴/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
		درآمدها:
۲۰۰,۹۵۳	۲,۳۵۱,۹۲۷	سود فروش اوراق بهادار
۷۹۹,۱۹۱	۶,۴۹۹,۶۰۷	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۶۴,۱۸۱	۵۲۵,۴۰۰	سود سهام
۳۷,۱۵۰	۳۷۳,۸۶۶	سود سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۱۵۲,۰۸۷	۴۶۳,۰۹۳	درآمد بازارگردانی
۱۱,۵۳۹	۱۶,۴۸۲	سایر درآمدها
۱,۳۶۵,۱۰۳	۱۰,۲۳۰,۳۷۶	جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۵۱,۶۹۲)	(۱۰۴,۱۸۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۵۰,۴۱۷)	(۲۰۹,۳۹۷)	سایر هزینه ها
(۱۰۲,۱۰۸)	(۳۱۳,۵۸۵)	جمع هزینه ها
۱,۲۶۲,۹۹۴	۹,۹۱۶,۷۹۱	سود قبل از هزینه مالی
(۱۷۹,۳۸۴)	(۲۷۸,۲۵۸۹)	هزینه مالی
۱,۰۸۳,۶۱۰	۹,۶۳۸,۵۳۱	سود خالص



گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



۶- تعهدات سرمایه‌ای و بدهی‌ها

نام شرکت	حداقل سفارش انباشته	حداقل معاملات روزانه	دامنه مظنه
بیمه زندگی باران	۱۳۵,۶۳۲	۲,۷۱۲,۶۲۹	۴٪
صنایع کشاورزی و کود زنجان	۱۰۳,۳۲۴	۲,۰۶۶,۴۷۵	۳٪
صنعتی پارس مینو	۱۴۲,۶۰۰	۲,۸۵۲,۰۰۰	۲.۲۵٪
صنعتی مینو	۲۹۳,۵۹۰	۵,۸۷۱,۷۷۴	۲.۵٪
قاسم ایران	۱۳۹,۷۳۸	۲,۷۹۴,۷۴۹	۲.۵٪
صنایع غذایی مینو شرق	۸۷,۵۹۱	۱,۷۵۱,۸۰۹	۲.۵٪
شرکت اقتصادی و خودکفائی آزادگان	۶۷,۰۵۴	۱,۳۴۱,۰۷۴	۳٪
صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات نیک رای	۷,۵۰۰	۱۵۰,۰۰۰	۱٪
شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مپنا	۶,۲۵۰	۱۲۵,۰۰۰	۱٪
شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مپنا	۳,۱۲۵	۶۲,۵۰۰	۱٪
تولیدی کوچین	۴۵۸,۵۳۴	۹,۱۷۰,۶۶۴	۲.۷۵٪
صندوق بخشی صنایع دانایان	۱۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰	۳٪
فرآورده‌های گوشتی کاله آمل	۵,۰۰۰	۸۰,۰۰۰	۱٪
شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مپنا	۵,۶۲۵	۱۱۲,۵۰۰	۱٪



۷- ریسک‌ها:

۷-۱- هر چند تمهیدات لازم توسط مدیر به عمل می‌آید تا سرمایه‌گذاری در صندوق سودآور باشد، ولی احتمال وقوع زیان در سرمایه‌گذاری‌های صندوق همواره وجود دارد؛ بنابراین سرمایه‌گذاران باید به ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق از جمله ریسک‌های یاد شده در این بخش از امیدنامه، توجه ویژه داشته باشند. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و عادی با سرمایه‌گذاری در صندوق، تمام ریسک‌های فراروی صندوق را می‌پذیرند. در سایر بندهای این بخش، برخی از ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق برشمرده شده‌اند.

۷-۲- **ریسک کاهش ارزش دارایی‌های صندوق:** قیمت اوراق بهادار در بازار، تابع عوامل متعددی از جمله وضعیت سیاسی، اقتصادی، اجتماعی، صنعت موضوع فعالیت و وضعیت خاص ناشر آن است. با توجه به آنکه ممکن است در مواقعی تمام یا بخشی از دارایی‌های صندوق در اوراق بهادار سرمایه‌گذاری شده باشند و از آنجا که قیمت این اوراق می‌تواند در بازار کاهش یابد، لذا صندوق از این بابت ممکن است متضرر شده و این ضرر به سرمایه‌گذاران منتقل شود.

۷-۳- **ریسک نکول سایر اوراق بهادار:** گرچه صندوق به غیر از سهام و حق تقدم سهام، در اوراق بهاداری سرمایه‌گذاری می‌کند که سود حداقل برای آن‌ها تعیین و پرداخت سود و اصل سرمایه‌گذاری آن توسط یک مؤسسه معتبر تضمین شده است، یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه‌گذاری در آن‌ها، وثایق معتبر و کافی وجود دارد؛ ولی این احتمال وجود دارد که طرح سرمایه‌گذاری مرتبط با این اوراق، سودآوری کافی نداشته باشد یا ناشر به تعهدات خود در پرداخت به موقع سود و اصل اوراق بهادار، عمل ننماید یا ارزش وثایق به طرز قابل توجهی کاهش یابد به طوری که پوشش‌دهنده اصل سرمایه‌گذاری و سود متعلق به آن نباشند. وقوع این اتفاقات می‌تواند باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً سرمایه‌گذاران شوند.

۷-۴- **ریسک نوسان بازده بدون ریسک:** در صورتی که نرخ بازده بدون ریسک (نظیر سود علی‌الحساب اوراق مشارکت دولتی) افزایش یابد، به احتمال زیاد قیمت اوراق مشارکت و سایر اوراق بهاداری که سود حداقل یا ثابتی برای آن‌ها تعیین شده است، در بازار کاهش می‌یابد. اگر صندوق در این نوع اوراق بهادار سرمایه‌گذاری کرده باشد و بازخريد آن به قیمت معین توسط یک مؤسسه معتبر (نظیر بانک) تضمین نشده باشد، افزایش نرخ بازده بدون ریسک، ممکن است باعث تحمیل ضرر به صندوق و متعاقباً سرمایه‌گذاران گردد.

۷-۵- **ریسک نقدشوندگی واحدهای ابطال‌شده:** از آنجایی که این صندوق فاقد رکن ضامن نقدشوندگی است، لذا در صورتی که دارنده واحد سرمایه‌گذاری قصد ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری را داشته باشد، مدیر در ابتدا از محل وجوه نقد صندوق اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده می‌نماید. چنانچه وجوه نقد صندوق کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش دارایی‌های صندوق می‌نماید تا وجه مورد نیاز را تهیه کند. اگر به هر دلیلی از جمله بسته بودن نماد سهم، صف فروش و گره معاملاتی مدیر صندوق نتواند دارایی‌های صندوق را به وجه نقد تبدیل کند، مبالغ مربوط به واحدهای ابطال شده تا تأمین وجه نقد به حساب بستنکاری سرمایه‌گذار منظور می‌گردد و بازپرداخت این بدهی‌ها با روش FIFO و بر اساس تاریخ و ساعت ثبت سفارشات ابطال انجام می‌گیرد.



گزارش عملکرد مدیر صندوق
سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱



امضاء

نماینده

رکن صندوق

سید

بابک جهان آرا

شرکت سبدگردان
دارایی داناایان
(مدیر صندوق)


داناایان
سبدگردان دارایی
شماره ثبت: ۶۴۱۲۸۸