



دانیان

صندوق بازارگردانی

گزارش عملکرد مدیر

گزارش عملکرد مدیر صندوق برای دوره مالی منتهی به

۱۴۰۵/۰۶/۳۱



دانیان
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 سبذگردان 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
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱



• **مدیر صندوق:** شرکت سبدگردان 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، نیش 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

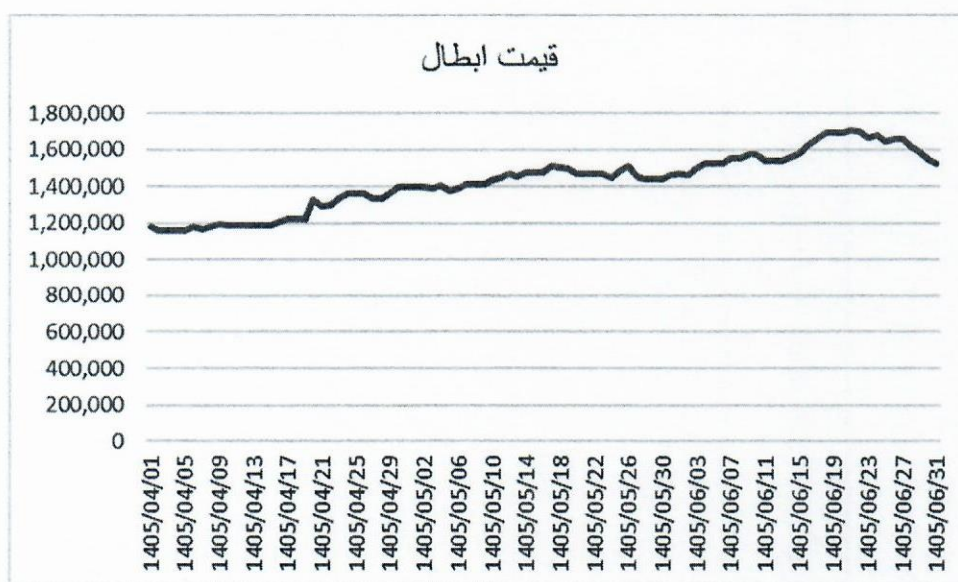
صندوق اختصاصی بازارگردانی دانایان در تاریخ ۱۴۰۵/۰۶/۳۱	
تعداد سرمایه گذاران (حقیقی و حقوقی)	۱۶ سرمایه گذار
تعداد کل واحدهای سرمایه گذاری	۱۸,۴۱۸,۴۴۰ واحد
خالص ارزش دارایی (NAV) صدور	۱,۵۲۳,۶۹۵ ریال
خالص ارزش دارایی (NAV) ابطال	۱,۵۲۱,۵۶۳ ریال
کل خالص ارزش دارایی های صندوق	۲۸,۰۲۴,۸۱۳,۴۱۶,۴۹۹



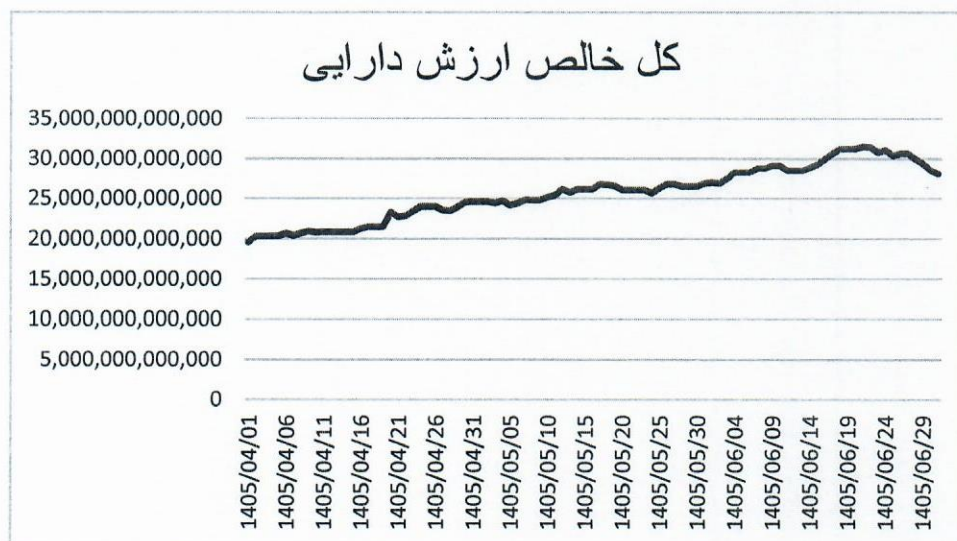
گزارش عملکرد مدیر صندوق
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱

۳ - بازدهی صندوق:

۳-۱ خالص ارزش روزانه



۳-۲ - خالص ارزش دارایی





گزارش عملکرد مدیر صندوق
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱



۴- خالص دارایی‌های صندوق

۱۴۰۵/۰۳/۳۱	۱۴۰۵/۰۶/۳۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
		دارایی‌ها:
۱۶,۸۳۶,۷۴۳	۲۳,۱۱۶,۵۹۹	سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۶۶۹,۳۵۵	۴,۳۲۱,۵۰۳	سرمایه گذاری در صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲۶۵,۰۰۰	۲۶۵,۰۰۰	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۱,۳۱۷,۵۹۷	۱,۲۸۶,۶۸۰	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۳۶۵,۷۳۹	۵۹۶,۳۵۷	حساب‌های دریافتنی
۲۱۲,۸۱۲	۶۶۸,۱۲۸	پیش پرداخت‌ها
۳,۵۲۹	۲,۶۴۳	سایر دارایی‌ها
۵۹,۳۶۰	.	جاری کارگزاران
۲۸۹,۵۷۱	۱۸۷,۱۳۹	موجودی نقد
۲۱,۰۱۹,۷۰۷	۳۰,۴۴۴,۰۵۰	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها:
.	۴۸,۳۵۴	جاری کارگزاران
۹۷۲,۴۶۵	۱,۱۶۲,۶۶۳	تسهیلات مالی دریافتنی
۴۴,۷۷۷	۵۸,۴۹۷	پرداختنی به ارکان صندوق
۶,۱۶۹	۴۰,۰۶۵	پرداختنی به سرمایه‌گذاران
۷۰,۲۷۵	۱۷,۸۵۲	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۵۶۲,۸۰۱	۱,۰۹۱,۸۰۶	پیش دریافت‌ها
۱,۶۵۶,۴۸۸	۲,۴۱۹,۲۳۷	جمع بدهی‌ها
۱۹,۳۶۳,۲۱۹	۲۸,۰۲۴,۸۱۳	خالص دارایی‌ها
۱,۱۶۷,۲۲۵	۱,۵۲۱,۵۶۳	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری - ریال



گزارش عملکرد مدیر صندوق
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱



۵- صورت سود و زیان

سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
		درآمدها:
(۳۸,۰۰۰)	۱,۲۷۳,۸۲۹	سود فروش اوراق بهادار
(۸۹۱,۷۶۵)	۶,۲۷۸,۳۳۱	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۱۷۳,۱۱۳	۳۲۶,۷۸۲	سود سهام
۲۵,۶۸۱	۱۳۵,۴۲۲	سود سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۷۴,۲۴۲	۲۷۲,۱۴۰	سایر دارایی ها
(۶۵۶,۷۱۹)	۱۰,۲۳۰,۳۷۶	جمع درآمدها
		هزینه ها:
(۱۳,۰۵۷)	(۱۰۴,۱۸۹)	هزینه کارمزد ارکان
(۱۶,۷۳۱)	(۲۰۹,۳۹۷)	سایر هزینه ها
(۲۹,۷۸۸)	(۳۱۳,۵۸۵)	جمع هزینه ها
(۶۸۶,۵۰۸)	۹,۹۱۶,۷۹۱	سود قبل از هزینه مالی
(۶۳,۴۱۲)	(۲۷۸,۲۵۸۹)	هزینه مالی
(۷۴۹,۹۲۰)	۹,۶۳۸,۵۳۱	سود خالص



گزارش عملکرد مدیر صندوق
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱



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	۷۱۸,۰۳۰	۱۴,۳۶۱,۰۰۰	۲.۲۵٪
صنعتی مینو	۲۹۳,۵۹۰	۵,۸۷۱,۷۷۴	۲.۵٪
قاسم ایران	۹۵۲,۵۲۴	۱۹,۰۵۰,۴۷۷	۲.۷۵٪
صنایع غذایی مینو شرق	۱۰۴,۸۱۰	۲,۰۹۶,۱۸۲	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٪
اوراق اجاره شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مینا- مرحله اول (صمپنا ۶۰۷)	۶,۲۵۰	۱۲۵,۰۰۰	۱٪
اوراق اجاره شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مینا- مرحله دوم (صمپنا ۶۱۲)	۳,۱۲۵	۶۲,۵۰۰	۱٪
تولیدی کوچین	۴۵۸,۵۳۴	۹,۱۷۰,۶۶۴	۲.۷۵٪
صندوق بخشی صنایع دانایان	۱۰۰,۰۰۰	۲,۰۰۰,۰۰۰	۳٪
اوراق مرابحه شرکت تولید فرآورده‌های گوشتی کاله آمل (آمل ۰۸)	۵,۰۰۰	۸۰,۰۰۰	۱٪
اوراق اجاره شرکت تولید انرژی‌های تجدید پذیر مینا- مرحله سوم (صمپنا ۷۱۱)	۵,۶۲۵	۱۱۲,۵۰۰	۱٪
شرکت سولیکو کاله (عکاله ۷)	۱۱,۹۵۰	۲۳,۹۰۰	۲٪
صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت دوام دانایان (دوام)	۳۰,۰۰۰	۳۰۰,۰۰۰	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 بستانکاری 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
دوره مالی منتهی به ۱۴۰۵/۰۶/۳۱



امضاء

نماینده

رکن صندوق



مسعود مددی

شرکت سبدگردان
دارایی دانا یان
(مدیر صندوق)