



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی

صباکستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

دوره شهری به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

فهرست مطالب

۲	مقدمه
۲	ارکان صندوق :
۲	موضوع فعالیت صندوق :
۳	فعالیت اصلی صندوق :
۷	عملکرد صندوق در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ :
۱۰	ترکیب داراییها صندوق :
۱۰	ارزش معاملات خرد سهام صندوق :
۱۱	سهام خرید از معاملات صندوق :
۱۲	عملکرد صندوق صباکستر به تفکیک نمادهای موضوع بازارگردانی :
۱۵	ریسک سرمایه‌گذاری در صندوق :
۱۶	برنامه های آتی صندوق :

مقدمه

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی صباکستر نفت و گاز تامین به منظور تسهیل اجرای سیاست‌های کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، با مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۲۸ / ۰۸ / ۱۳۹۷ تحت شماره ۴۵۹۲۲ و شناسه ملی ۱۴۰۰۷۹۵۴۲۶۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌ها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت شده و به عنوان نهاد مالی در تاریخ ۰۳ / ۰۹ / ۱۳۹۷ تحت شماره ۱۱۶۱۵ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است. مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، ۳ سال است. مرکز اصلی صندوق در تهران، میدان آرژانتین، خیابان شهید احمد قصیر، خیابان شهید احمدیان (پانزدهم)، شماره ۱۴، طبقه چهارم واقع شده و صندوق فاقد شعبه می باشد.

ارکان صندوق:

مدیر صندوق، شرکت سرمایه‌گذاری صبا تامین است که در تاریخ ۱۳۷۷/۱۱/۲۱ با شماره ثبت ۱۴۷۹۶۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است: تهران، میدان آرژانتین، خیابان شهید احمد قصیر، خیابان شهید احمدیان (پانزدهم)، شماره ۱۴.

متولی صندوق، موسسه حسابرسی هوشیار ممیز است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ به شماره ۱۱۰۲۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، خیابان انتهای گاندی شمالی پلاک ۸ طبقه ۵ واحد ۱۹.

حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر است که در تاریخ ۱۳۶۱/۰۷/۰۴ به شماره ثبت ۲۳۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران، خیابان وصال شیرازی، بزرگمهر غربی، کوی اسکو، پلاک ۱۴.

موضوع فعالیت صندوق:

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام‌شده در امیدنامه این صندوق با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق منقسم به ۸۹۶۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز با ارزش پایه هر واحد ۱،۰۰۰،۰۰۰ ریال می باشد. در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ ارزش خالص ترکیبی هر واحد سرمایه‌گذاری (NAV) برای تمامی

صندوق جهت صدور، ۱،۱۳۳،۵۹۴ ریال و جهت ابطال، ۱،۱۳۲،۰۲۵ ریال بوده است. تغییرات دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز و تعداد واحدهای عادی صندوق به شرح جدول شماره ۱ بوده است.

جدول ۱

ردیف	سرمایه‌گذار	۱۴۰۱/۰۳/۳۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	نوع واحد
۱	شرکت سرمایه‌گذاری صباتأمین (مدیر صندوق)	۴۵،۶۹۶	۴۵،۶۹۶	۴۵،۶۹۶	ممتاز
۲	شرکت سرمایه‌گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	۴۳،۰۰۸	۴۳،۰۰۸	۴۳،۰۰۸	ممتاز
۳	شرکت کارگزاری صباتأمین	۸۹۶	۸۹۶	۸۹۶	ممتاز
مجموع واحدهای ممتاز		۸۹،۶۰۰	۸۹،۶۰۰	۸۹،۶۰۰	ممتاز
مجموع واحدهای عادی		۷۳،۸۸۸،۵۳۹	۷۰،۳۹۶،۶۹۶	۶۲،۶۷۴،۰۹۳	عادی
جمع کل واحدهای سرمایه‌گذاری		۷۳،۹۷۸،۱۳۹	۷۰،۴۸۶،۲۹۶	۶۲،۷۶۳،۶۹۳	-

فعالیت اصلی صندوق :

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق امیدنامه میباشد. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. همچنین صندوق می‌تواند مازاد منابع خود را در دارایی‌های مالی واجد شرایط زیر سرمایه‌گذاری نماید:

▪ اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت که دارای تمامی شرایط زیر هستند، سرمایه‌گذاری نماید:

الف- مجوز انتشار آن‌ها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛

ب- سود حداقلی برای آن‌ها مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه‌گذاری و سود آن‌ها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه‌گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد؛

ج- در یکی از بورس‌ها پذیرفته شده و معاملات ثانویه آن‌ها در بورس امکان‌پذیر باشد.

- گواهی‌های سپرده منتشره توسط بانک‌ها یا مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.
 - هر نوع سپرده‌گذاری نزد بانک‌ها و مؤسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.
 - اتخاذ موقعیت فروش قراردادهای آتی اوراق بهادار، صرفاً به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت اوراق بهادار موجود در صندوق سرمایه‌گذاری و اتخاذ موقعیت خرید در قراردادهای آتی اوراق بهادار صرفاً به منظور بستن موقعیت‌های فروشی که قبلاً در قراردادهای آتی اوراق بهادار اتخاذ نموده‌اند.
- در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ تعهدات بازارگردانی صندوق با شرایط مندرج در امیدنامه شامل بازارگردانی سهام نماد ها به شرح جدول ۲ می‌باشد :

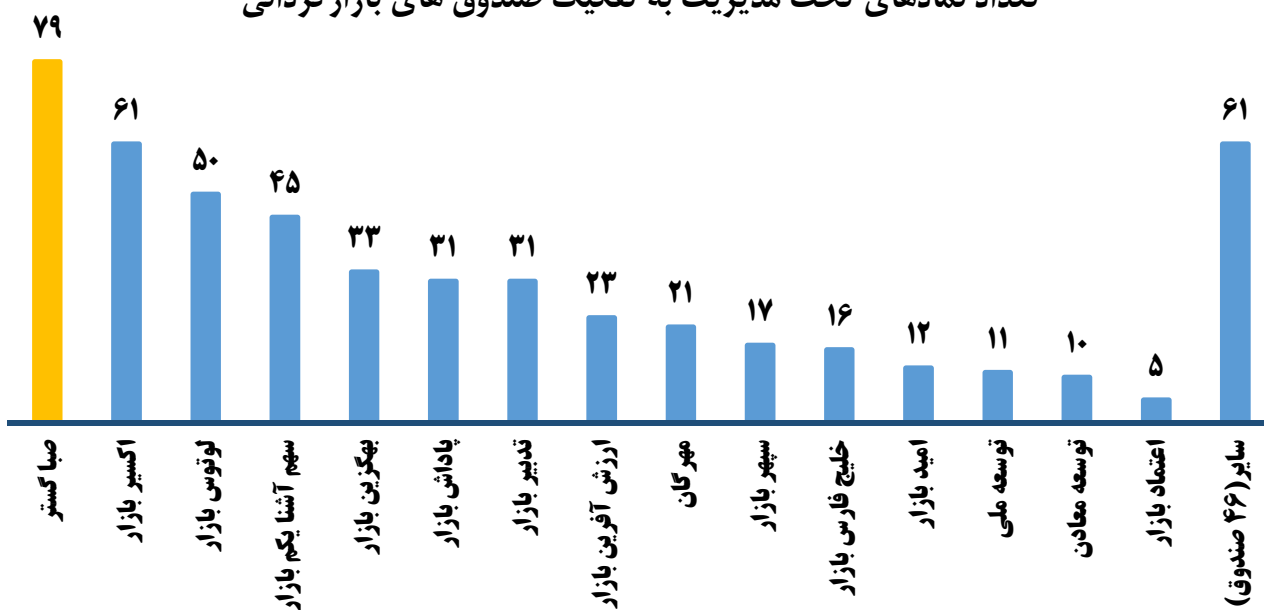
جدول ۲

نماد های موضوع بازارگردانی صندوق صبا کستر نفت و گاز تامین					
ردیف	نام شرکت	نماد	ردیف	نام شرکت	نماد
۱	سر. تامین اجتماعی	شستا	۴۱	سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	وپترو
۲	سر. صبا تامین	صبا	۴۲	پتروشیمی فارابی	شفارا
۳	سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۴۳	پتروشیمی آبادان	شپترو
۴	سر. صدر تامین	تاصیکو	۴۴	سیمان آبیک	سآبیک
۵	سر. سیمان تامین	سیتا	۴۵	لاستیک سهند	پسهند
۶	سر. دارویی تامین	تیپیکو	۴۶	کربن ایران	شکربن
۷	سیمان فارس و خوزستان	سفارس	۴۷	دوده صنعتی پارس	شدوص
۸	سیمان صوفیان	سصوفی	۴۸	تکین کو	رتکو
۹	سیمان ارومیه	ساروم	۴۹	کاغذ سازی کاوه	چکاوه
۱۰	سیمان قائن	سقاین	۵۰	کارتن ایران	چکارن
۱۱	سیمان شاهرود	سرود	۵۱	داروپخش	وپخش
۱۲	سیمان ساوه	ساوه	۵۲	پارس دارو	دپارس
۱۳	سیمان خوزستان	سخوز	۵۳	دارو اکسیر	دلر
۱۴	سیمان فارس	سفار	۵۴	دارو فارابی	دفارا
۱۵	سیمان خزر	سخزر	۵۵	داروسازی قاضی	دقاضی
۱۶	سیمان فارس نو	سفانو	۵۶	کارخانجات داروپخش	دارو

نماد های موضوع بازارگردانی صندوق صبا کستر نفت و گاز تامین					
ردیف	نام شرکت	نماد	ردیف	نام شرکت	نماد
۱۷	سیمان بجنورد	سبجنو	۵۷	دارو زهراوی	دزهراوی
۱۸	سیمان بهبهان	سبهان	۵۸	توزیع داروپخش	دتوزیع
۱۹	سیمان غرب	سغرب	۵۹	دارو رازک	درازک
۲۰	سیمان خاش	سخاش	۶۰	پخش هجرت	هجرت
۲۱	سیمان سفید نی ریز	سنیر	۶۱	مواد داروپخش	دتماد
۲۲	سیمان دورود	سدور	۶۲	کلر پارس	کلر
۲۳	خاک چینی ایران	کخاک	۶۳	دارو ابوریحان	دابور
۲۴	مس باهنر	فباهنر	۶۴	کاسپین تامین	کاسپین
۲۵	معدنی املاح ایران	شاملا	۶۵	شیمی داروپخش	دشیمی
۲۶	فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۶۶	زاگرس فارمد پارس	ددام
۲۷	کاشی سعدی	کسعدی	۶۷	شیرین دارو	دشیری
۲۸	کاشی الوند	کلوند	۶۸	تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول
۲۹	پشم شیشه ایران	کپشیر	۶۹	دارویی ره آورد تامین	دره‌آور
۳۰	لعبیران	شلعاب	۷۰	داده پردازی ایران	مداران
۳۱	پارس الکتریک	لپارس	۷۱	پالایش نفت لاوان	شاولان
۳۲	کشت و دامداری فکا	زفکا	۷۲	پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر
۳۳	کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۷۳	کارتن ایران	چکارن
۳۴	کشت و دام گلدشت نمونه اصفهان	زگلدشت	۷۴	لوازم خانگی پارس	لخانه
۳۵	پتروشیمی فن آوران	شفن	۷۵	فارسیت اهواز	سفاسی
۳۶	پتروشیمی خراسان	خراسان	۷۶	زغال سنگ پروده طبس	کزغال
۳۷	نفت پاسارگاد	شپاس	۷۷	محصولات کاغذی لطیف	لطیف
۳۸	پتروشیمی غدیر	شغدیر	۷۸	سرمایه‌گذاری هامون صبا	وهامون
۳۹	نفت ایرانول	شرانل	۷۹	صندوق اندیشه ورزان صباتامین	اوصتا
۴۰	صنعتی بارز	پکرمان	۸۰	گاز لوله	پلوله

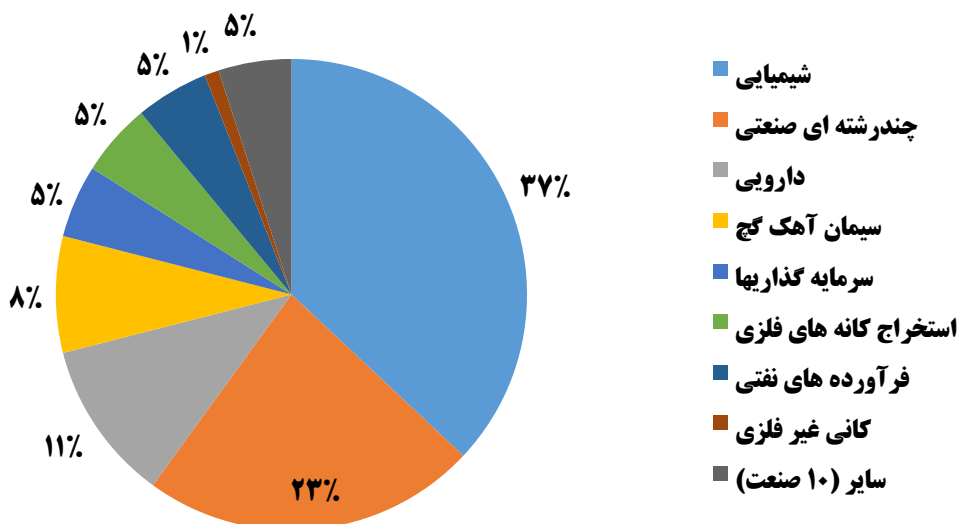
صندوق بازارگردانی صباکستر نفت و گاز تامین با انجام تعهدات بازارگردانی ۷۹ نماد (شرکت بورسی و فرابورسی) در میان ۶۱ صندوق بازارگردانی فعال در بازار سرمایه کشور، رتبه نخست را به خود اختصاص داده است.

تعداد نمادهای تحت مدیریت به تفکیک صندوق های بازارگردانی



مجموع ارزش بازار این ۷۹ نماد در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ برابر ۶,۸۶۳ هزار میلیارد ریال بوده است که این مبلغ حدود ۹ درصد ارزش بازار سرمایه کشور در این تاریخ می‌باشد.

سهم صنایع از ارزش بازار شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق



عملکرد صندوق در دوره مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱:

صورت سود و زیان صندوق در دوره های مالی مختلف به شرح جدول ۳ می‌باشد.

جدول ۳

صورت سود و زیان صندوق (میلیون ریال)			
دوره منتهی به	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱
درآمدها	حسابرسی نشده	حسابرسی شده	حسابرسی نشده
سود (زیان) فروش اوراق بهادار	۱,۹۴۱,۰۵۵	۲۵۸,۶۶۸	(۷۱۳,۲۵۸)
(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۸,۱۷۹,۰۳۶	(۸,۸۶۱,۶۱۸)	(۷۰,۳۴۰,۰۰۷)
سود سهام	۱,۷۵۱,۷۳۳	۶,۸۳۴,۵۸۱	۱,۰۲۸,۵۲۱
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۳۰۸,۶۳۵	۶۷۴,۶۳۶	۳۲,۱۰۸
سایر درآمدها	۴۸,۸۵۰	۱۲,۳۰۷	۷۸
جمع درآمدها	۱۲,۲۲۹,۳۱۱	(۱,۰۸۱,۴۲۴)	(۶,۶۸۶,۵۸۵)
هزینه‌ها	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱
هزینه کارمزد ارکان	(۱۸۳,۴۹۴)	(۵۷۸,۴۹۹)	(۱۳۶,۵۱۹)
سایر هزینه‌ها	(۳۷,۸۸۰)	(۱۶۰,۶۷۸)	(۲۴,۶۴۴)
جمع هزینه‌ها	(۲۲۱,۳۷۴)	(۷۳۹,۱۷۸)	(۱۶۱,۱۶۴)
سود (زیان) قبل از هزینه‌های مالی	۱۲,۰۰۷,۹۳۷	(۱,۸۲۰,۶۰۲)	(۶,۸۴۷,۸۵۰)
هزینه‌های مالی	.	.	.
سود (زیان) خالص	۱۲,۰۰۷,۹۳۷	(۱,۸۲۰,۶۰۲)	(۶,۸۴۷,۸۵۰)

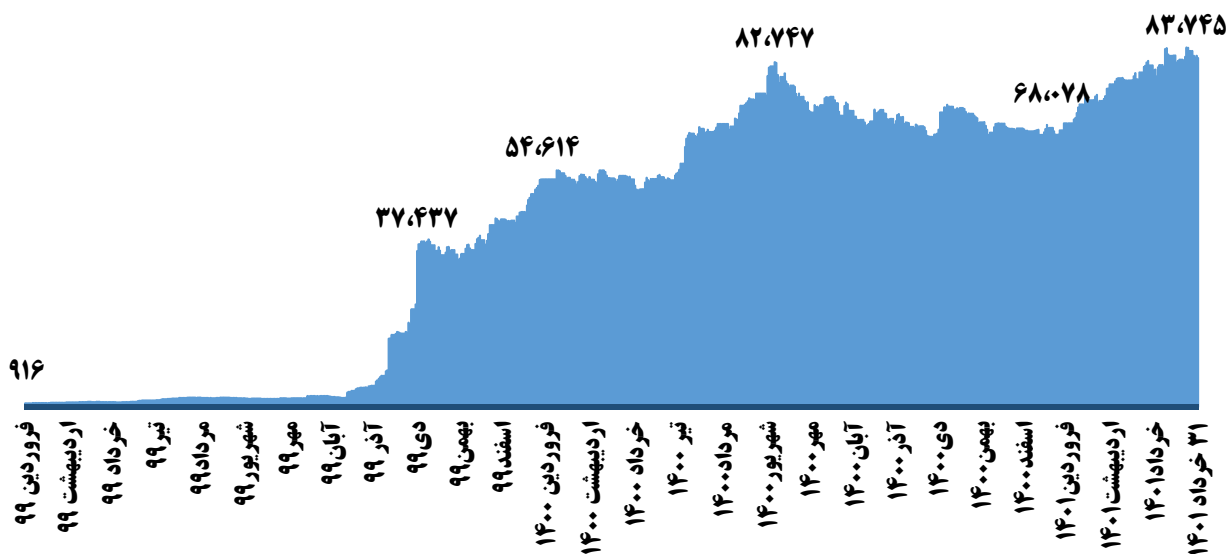
صورت خالص دارایی صندوق در دوره های مالی مختلف به شرح جدول ۴ می‌باشد.

جدول ۴

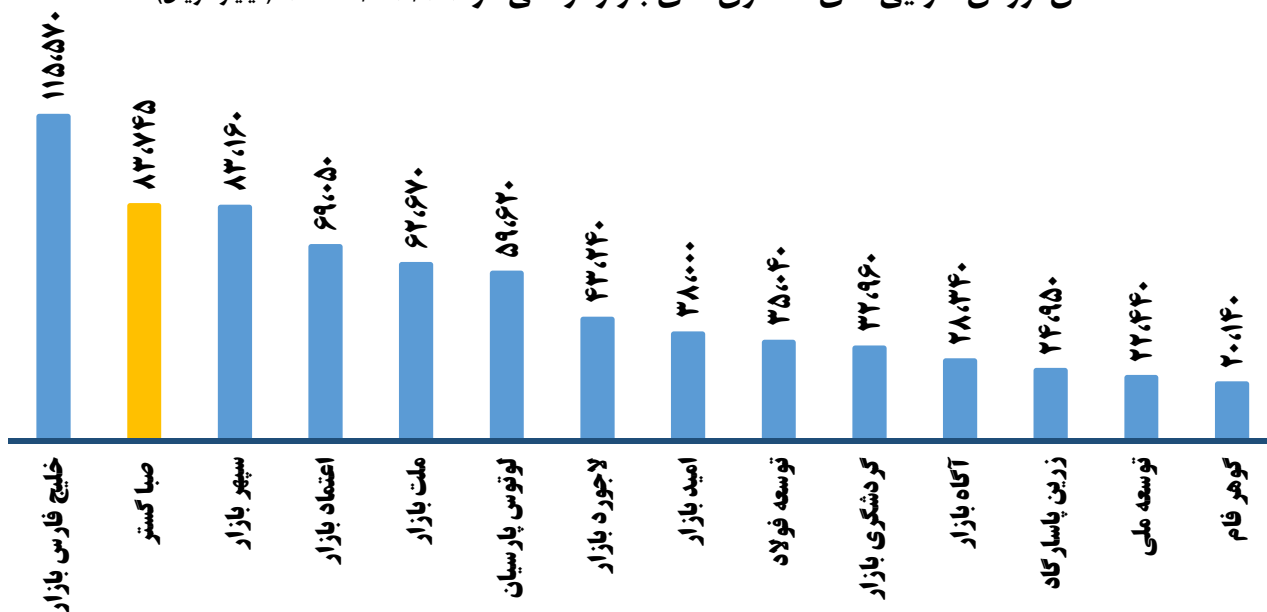
سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	دارایی‌ها
۵۱,۹۳۳,۷۰۵	۵۹,۷۷۸,۲۵۳	۶۸,۹۶۱,۳۶۸	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۱,۳۴۹,۹۵۵	۵۶۱,۳۸۶	۷۹۰,۵۴۷	سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی
۱,۵۱۹,۹۹۸	۴,۶۷۷,۸۹۲	۹,۰۲۹,۱۶۱	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب
۴۱,۲۳۰	۷۷۴,۶۷۹	۳۳۲,۰۶۴	سرمایه‌گذاری در واحدهای صندوق های سرمایه‌گذاری
۱۰,۲۸,۶۴۵	۲,۵۱۸,۴۱۰	۳,۸۹۵,۵۹۳	حساب های دریافتنی
۳۴۷,۲۸۰	۱۷,۱۱۸	۱,۱۵۹,۰۹۴	جاری کارگزاران
۲۲۱,۹۴۱	۵۵	۴,۲۴۶	موجودی نقد
۵۶,۴۴۲,۷۵۴	۶۸,۳۲۷,۷۹۶	۸۴,۱۷۴,۳۰۲	جمع دارایی‌ها
سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	سال مالی منتهی ۱۴۰۰/۱۲/۲۹	سه ماهه منتهی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱	بدهی‌ها :
۱۶۸,۶۷۹	۲۴۱,۶۹۰	۴۲۵,۱۸۴	پرداختنی به ارکان صندوق
۳,۷۱۱	۱,۷۰۹	۳,۸۸۷	سایر حساب‌های پرداختنی و ذخایر
۶,۵۵۸	۶,۲۲۳	۱۰۴	بدهی به سرمایه‌گذاران
۱۷۸,۹۴۸	۲۴۹,۶۲۳	۴۲۹,۱۷۵	جمع بدهی‌ها
۵۶,۲۶۳,۸۰۵	۶۸,۰۷۸,۱۷۲	۸۳,۷۴۵,۱۲۶	خالص دارایی‌ها
۸۹۷,۲۹۳	۹۶۵,۸۳۵	۱,۱۳۲,۰۲۵	خالص دارایی های هر واحد سرمایه‌گذاری

افزایش خالص ارزش دارایی های صندوق از ۵۶،۲۶۴ میلیارد ریال در ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ به ۸۳،۷۴۵ میلیارد ریال در ۱۴۰۱/۰۳/۳۱

روند خالص ارزش دارایی های صندوق صباکستر (میلیارد ریال)

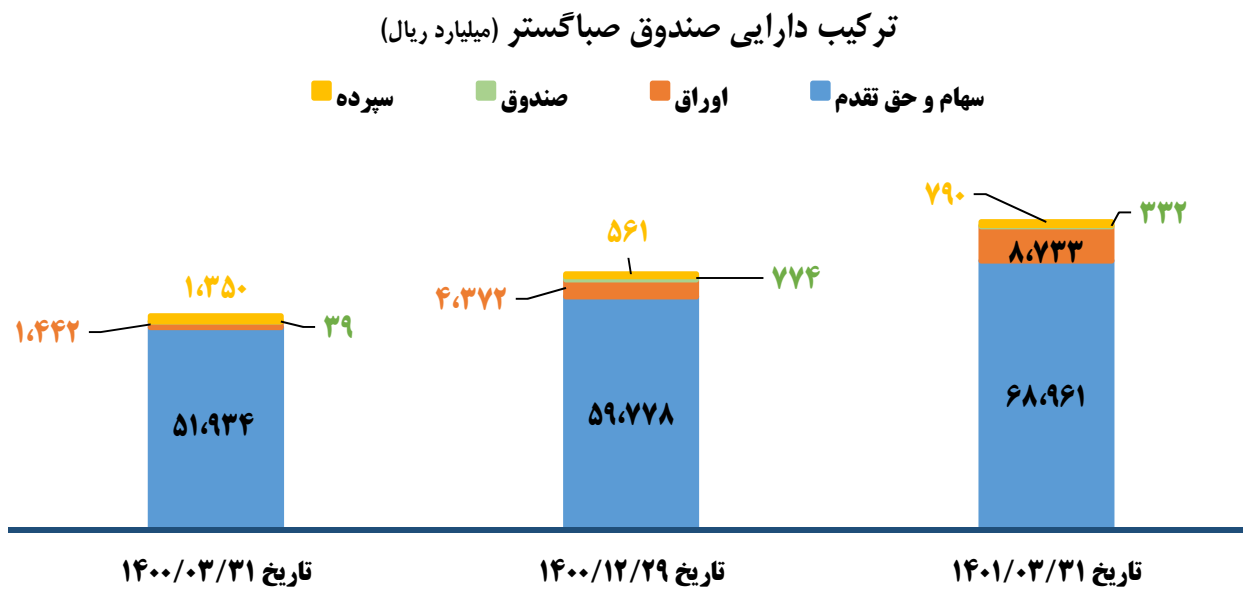


خالص ارزش دارایی های صندوق های بازارگردانی در ۱۴۰۰/۰۳/۳۱ (میلیارد ریال)



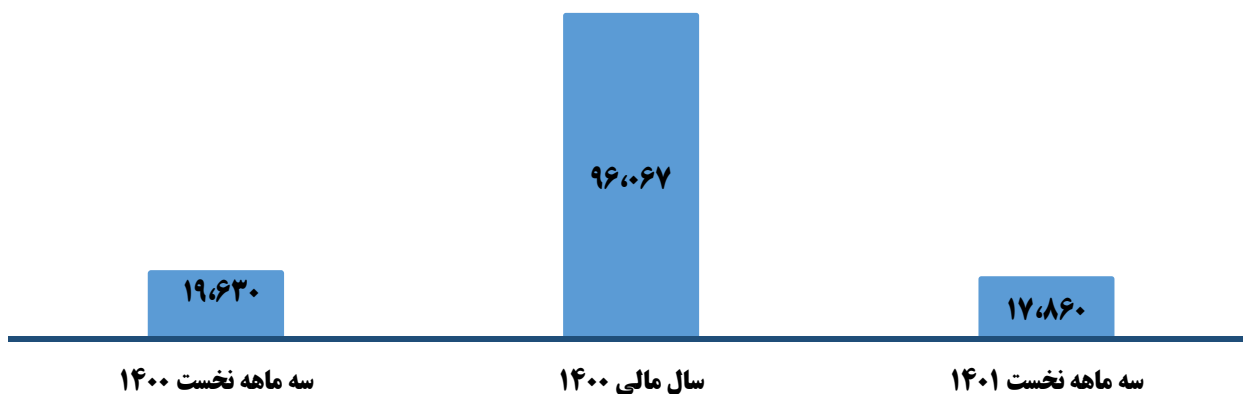
ترکیب دارایی‌ها صندوق :

در نمودار زیر ارزش و ترکیب دارایی‌های (سرمایه‌گذاری) صندوق صباگستر به تفکیک مقایسه شده است :



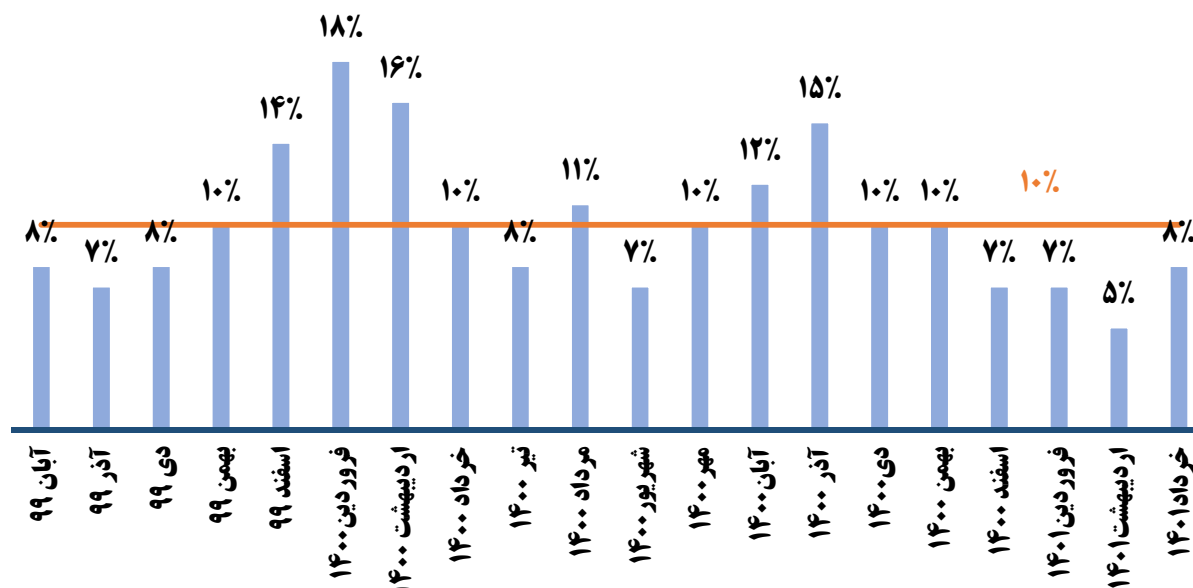
ارزش معاملات خرد سهام صندوق :

ارزش معاملات سهام در صندوق صباگستر (میلیارد ریال)



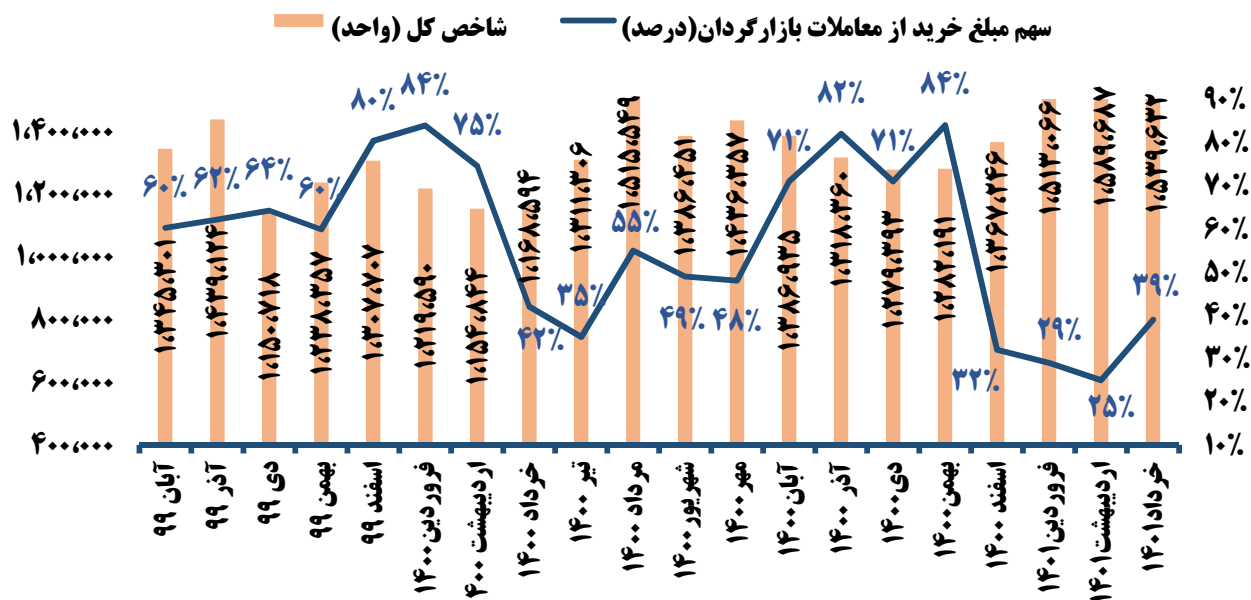
سهم ارزش معاملات خرد صندوق از ارزش معاملات بازار در نمادهای موضوع بازارگردانی :

سهم صندوق از ارزش معاملات خرد ماهانه بازار در نمادهای موضوع بازارگردانی



سهم خرید از معاملات صندوق :

در نمودار زیر روند سهم خرید از ارزش معاملات ماهانه صندوق و شاخص کل نشان داده شده است.



عملکرد صندوق صباکستر به تفکیک نمادهای موضوع بازارگردانی :

در جدول زیر عملکرد صندوق بازارگردانی صباکستر به تفکیک نمادهای موضوع بازارگردانی برای دوره سه ماهه منتهی به خرداد ۱۴۰۱ نشان داده شده است :

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباکستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱						
نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	خالص خرید	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از معاملات بازار سهم در دوره مذکور
شستا	۱,۰۵۹	۱,۱۲۷	(۶۸)	۲,۱۸۶	۴۸٪	۴٪
تاپیکو	۴۶	۷۹۱	(۷۴۵)	۸۳۷	۵٪	۸٪
صبا	۱۰۰	۲۳۴	(۱۳۴)	۳۳۴	۳۰٪	۵٪
تاصیکو	۵۸	۱۲۷	(۶۹)	۱۸۵	۳۱٪	۳٪
سیتا	۱۰۲	۳۵۵	(۲۵۳)	۴۵۷	۲۲٪	۱۱٪
تیپیکو	۱۸	۴۶	(۲۸)	۶۴	۲۸٪	۲٪
سفارس	۸۴	۱۴۱	(۵۸)	۲۲۵	۳۷٪	۴٪
سصوفی	۳۷	۱۵۸	(۱۲۱)	۱۹۵	۱۹٪	۱۰٪
ساروم	۵۷	۱۴۴	(۸۷)	۲۰۲	۲۸٪	۷٪
سقاین	۶۴	۸۷	(۲۳)	۱۵۱	۴۲٪	۱۹٪
سرود	۳۲	۶۷	(۳۵)	۹۹	۳۲٪	۸٪
ساوه	۱۱	۸۳	(۷۱)	۹۴	۱۲٪	۸٪
سخوز	۷۱	۱۳۲	(۶۱)	۲۰۳	۳۵٪	۹٪
سفار	۸۶	۳۰۴	(۲۱۸)	۳۹۰	۲۲٪	۱۵٪
سخزر	۱۲۹	۹۱	۳۸	۲۲۰	۵۹٪	۱۴٪
سفانو	۴۶	۱۴۶	(۱۰۰)	۱۹۲	۲۴٪	۱۱٪
سبجنو	۷۴	۷۳	۱	۱۴۷	۵۰٪	۱۴٪
سپهان	۴۲	۷۶	(۳۴)	۱۱۸	۳۶٪	۱۰٪
سغرب	۱۵۷	۱۵۴	۳	۳۱۱	۵۰٪	۱۱٪
سختاش	۶۵	۸۸.۳	(۲۴)	۱۵۳	۴۲٪	۱۲٪
سنیر	۷۸	۸۵	(۶)	۱۶۳	۴۸٪	۳٪
سدور	۱۱۶	۱۸۷	(۷۱)	۳۰۳	۳۸٪	۱۹٪
سفاسی	۴۲	۳۲.۰	۱۰	۷۴	۵۷٪	۶٪
سآبیک	۸۰	۱,۸۶۴	(۱,۷۸۴)	۱,۹۴۴	۴٪	۱۳٪
کخاک	۳۳	۴۲.۹۷	(۱۰)	۷۶	۴۴٪	۹٪

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباکستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱						
نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	خالص خرید	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از معاملات بازار سهم در دوره مذکور
فباهر	۱۷	۴۴	(۲۷)	۶۱	۲۸٪	۱٪
شاملا	۲۸	۲۶	۲	۵۵	۵۲٪	۴٪
کفرا	۴۲	۶۵	(۲۲)	۱۰۷	۴۰٪	۷٪
کسعدی	۱۵	۲۴	(۸.۴)	۳۹	۳۹٪	۲٪
کلوند	۶۲	۱۴۹	(۸۶)	۲۱۱	۲۹٪	۸٪
کزغال	۴۷	۲۵۳	(۲۰۷)	۳۰۰	۱۶٪	۷٪
کپشیر	۳۴	۶۳	(۲۹)	۹۷	۳۵٪	۵٪
شلعاب	۱۰۱	۶۹	۳۱	۱۷۰	۵۹٪	۷٪
لپارس	۵۰	۱۷۱	(۱۲۱)	۲۲۱	۲۳٪	۲٪
زفکا	۲۱	۲۸	(۷)	۴۹	۴۳٪	۱٪
زملارد	۱۰۱	۱۶۹	(۶۸)	۲۶۹	۳۷٪	۱۱٪
زگلدشت	۲۰	۲۹	(۱۰)	۵۰	۴۱٪	۱٪
لخانه	۵۱	۹۵	(۴۴)	۱۴۶	۳۵٪	۲۱٪
شفن	۱۴	۹۲	(۷۹)	۱۰۶	۱۳٪	۵٪
خراسان	۵۳	۶۳	(۱۱)	۱۱۶	۴۵٪	۳٪
شپاس	۲۲	۵۴	(۳۱)	۷۵	۲۹٪	۱۱٪
شغدیر	۹۴	۳۲۴	(۲۳۰)	۴۱۸	۲۳٪	۶٪
شرانل	۴۴	۱۸۸	(۱۴۴)	۲۳۳	۱۹٪	۷٪
پکرمان	۷۳	۱۰۹	(۳۶)	۱۸۲	۴۰٪	۱۰٪
وپترو	۳۹	۱۴۲	(۱۰۳)	۱۸۲	۲۲٪	۸٪
شفارا	۵۲	۵۲	۰	۱۰۵	۵۰٪	۱۵٪
شپترو	۱۴۸	۱۲۷	۲۱	۲۷۵	۵۴٪	۱۳٪
پسهند	۵۴	۱۱۲	(۵۸)	۱۶۷	۳۳٪	۸٪
شکربن	۹۸	۱۷۸	(۷۹)	۲۷۶	۳۶٪	۱۳٪
پلوله	۵۳	۹۳	(۴۰)	۱۴۶	۳۶٪	۱۴٪
شدوص	۵۵	۹۱	(۳۶)	۱۴۶	۳۸٪	۸٪
رتکو	۲۶	۵۷	(۳۱)	۸۳	۳۱٪	۲۱٪
چکاو	۲۳	۵۰	(۲۷)	۷۳	۳۱٪	۴٪
چخزر	۹۲	۱۰۳	(۱۱)	۱۹۶	۴۷٪	۹٪

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباکستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۳/۳۱						
نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	خالص خرید	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از معاملات بازار سهم در دوره مذکور
لطیف	۹۶	۱۹۰	(۹۴)	۲۸۶	۳۴٪	۲۰٪
چکارن	۶۷	۵۹	۸	۱۲۶	۵۳٪	۴٪
وپخش	۷	۳۶	(۲۸)	۴۴	۱۷٪	۵٪
دپارس	۱۳	۴۲	(۲۹)	۵۵	۲۳٪	۷٪
دلر	۱۱	۳۹	(۲۸)	۵۰	۲۱٪	۲٪
دفارا	۲۱	۲۶.۵	(۶)	۴۷	۴۴٪	۳٪
دقاضی	۳۲	۳۷	(۵)	۶۸	۴۷٪	۶٪
دارو	۲۲	۵۷.۳	(۳۴)	۸۰	۲۸٪	۹٪
دزهرای	۴۳	۶۸	(۲۶)	۱۱۱	۳۸٪	۶٪
دتوزیع	۳۴	۶۱	(۲۷)	۹۵	۳۶٪	۴٪
درازک	۲۳	۵۰	(۲۶)	۷۳	۳۲٪	۱۲٪
هجرت	۳۰	۵۷	(۲۷)	۸۷	۳۴٪	۶٪
دتماد	۴۷	۷۸	(۳۱)	۱۲۵	۳۸٪	۷٪
کلر	۱۷۰	۱۸۳	(۱۳)	۳۵۳	۴۸٪	۶٪
دابور	۲۵	۷۲	(۴۷)	۹۸	۲۶٪	۸٪
کاسپین	۵۶	۹۶	(۴۰)	۱۵۲	۳۷٪	۱۳٪
دشیمی	۲۷	۱۵۴	(۱۲۷)	۱۸۰	۱۵٪	۹٪
ددام	۱۲۴	۲۳۳	(۱۰۹)	۳۵۷	۳۵٪	۱۷٪
دشیری	۴۰	۵۲	(۱۲)	۹۳	۴۳٪	۲۱٪
دکپسول	۲۹	۵۲	(۲۲)	۸۱	۳۶٪	۳٪
دره‌آور	۴۳	۹۱	(۴۸)	۱۳۳	۳۲٪	۴٪
مداران	۱۲۵	۱۷۵	(۵۱)	۳۰۰	۴۲٪	۱۱٪
شاوان	۱۰۲	۱۵۲	(۵۰)	۲۵۴	۴۰٪	۴٪
شکبیر	۲۶۴	۲۶۳	۱	۵۲۸	۵۰٪	۲۸٪
وهامون	۵۹	۱۵۰	(۹۱)	۲۰۹	۲۸٪	۱۲٪

ریسک سرمایه‌گذاری در صندوق :

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 فراوی صندوق را می‌پذیرند. در سایر بندهای این بخش، برخی از ریسک‌های سرمایه‌گذاری در صندوق برشمرده شده‌اند.

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.

ریسک نکول سایر اوراق بهادار: گرچه صندوق به غیر از سهام و حق تقدم سهام موضوع بازارگردانی، 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.

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 بازخرد 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.

ریسک نقدشوندگی واحدهای ابطال شده: از آن جایی 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 مربوط به عملیات بازارگردانی اوراق بهادار مورد نظر اقدام به پرداخت وجوه واحدهای سرمایه‌گذاری ابطال شده می‌نماید. چنانچه

وجوه نقد صندوق متعلق به عملیات بازارگردانی اوراق بهادار مورد نظر کفاف بازپرداخت واحدهای ابطال شده را نداشته باشد، مدیر صندوق مطابق اساسنامه اقدام به فروش دارایی‌های صندوق متعلق به عملیات بازارگردانی همان اوراق بهادار 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. در صورت عدم امکان تبدیل دارایی‌های غیرنقد در عملیات بازارگردانی هر یک از اوراق بهادار به نقد، مدیر مجاز به پرداخت به سرمایه‌گذاران اوراق بهادار مذکور از محل دارایی‌های عملیات بازارگردانی سایر اوراق بهادار نمی‌باشد.

برنامه های آتی صندوق :

- ✓ خرید و فروش صندوق های ETF با درآمد ثابت جهت استفاده حداکثری از منابع نقد موجود در صندوق
- ✓ انجام فعالیت در بازار اختیار معامله جهت تامین مالی موثر نمادهای موضوع بازارگردانی
- ✓ قبول رکن بازارگردانی صندوق های درآمد ثابت، سهامی و کالایی بازار سرمایه
- ✓ بازارگردانی سهام شرکتهای خارج از مجموعه شستا و کسب انتفاع از این محل
- ✓ حضور فعال در بازارگردانی عرضه های اولیه شرکتهای مجموعه شستا



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی صباکستر نفت و گاز تامین