



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

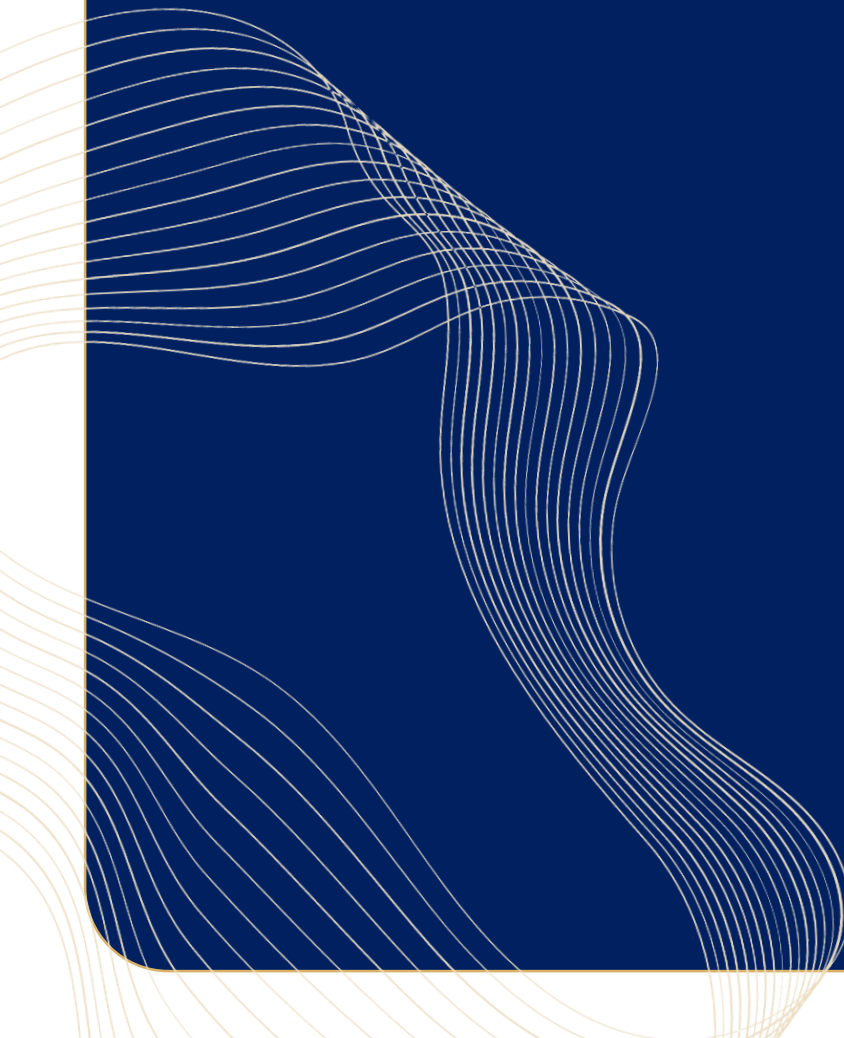
صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱



شرکت سرمایه‌گذاری صبا

מסורת
מסורת



فهرست

مقدمه و معرفی

ارکان و واحد های سرمایه گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در دوره منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

۱

۲

۳

۴

۵

خالص ارزش دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق

معاملات سهام صندوق

عملکرد صندوق به تفکیک نمادهای موضوع بازارگردانی

اهم اقدامات انجام شده و برنامه های آتی صندوق

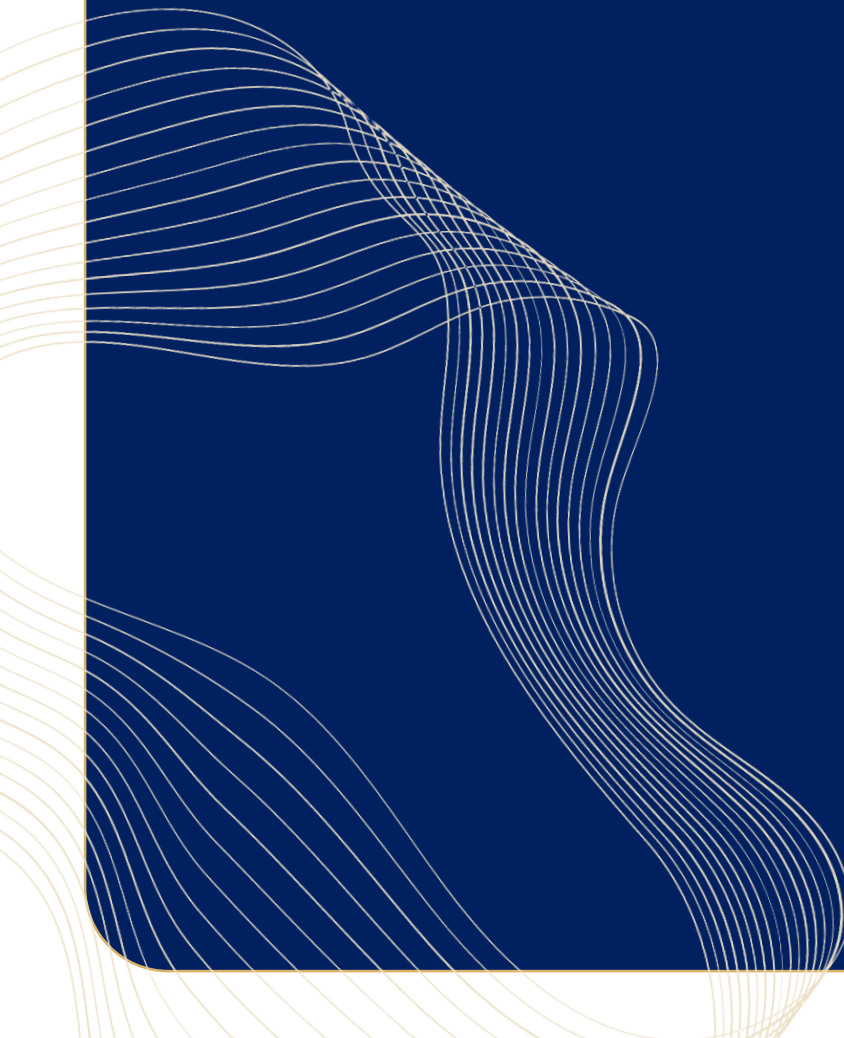
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه



صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد. بلکه طبق بند چ ماده ۱ دستورالعمل فعالیت بازارگردانی، هدف از فعالیت بازارگردانی عبارتست از:

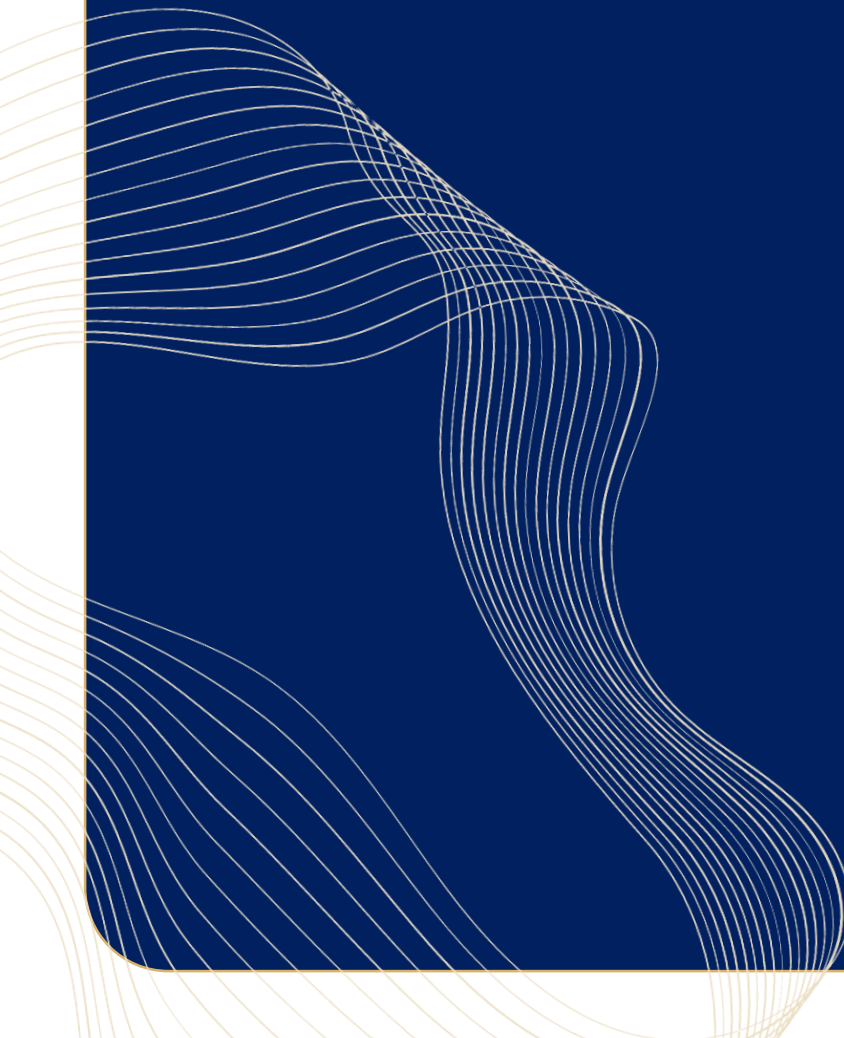
- ✓ تنظیم عرضه و تقاضا
- ✓ کاهش نوسان قیمت
- ✓ افزایش نقد شوندگی ورقه بهادار



صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی صبا گستر نفت و گاز تامین به منظور تسهیل اجرای سیاست های کلی اصل چهل و چهارم قانون اساسی مصوب آذر ماه سال ۱۳۸۴، با مجوز سازمان بورس و اوراق بهادار در تاریخ ۱۳۹۷/۰۸/۲۸ تحت شماره ۴۵۹۲۲ و شناسه ملی ۱۴۰۰۷۹۵۴۲۶۷ نزد مرجع ثبت شرکت ها و موسسات غیر تجاری تهران ثبت شده و به عنوان نهاد مالی در تاریخ ۱۳۹۷/۰۹/۰۳ تحت شماره ۱۱۶۱۵ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است.

در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۷۹ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازار سرمایه کشور از این حیث شناخته می شود.

در این تاریخ خالص ارزش دارایی های صندوق ۷۵,۹۶۹ میلیارد ریال می باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ افزایش ۷ درصدی داشته است.



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری



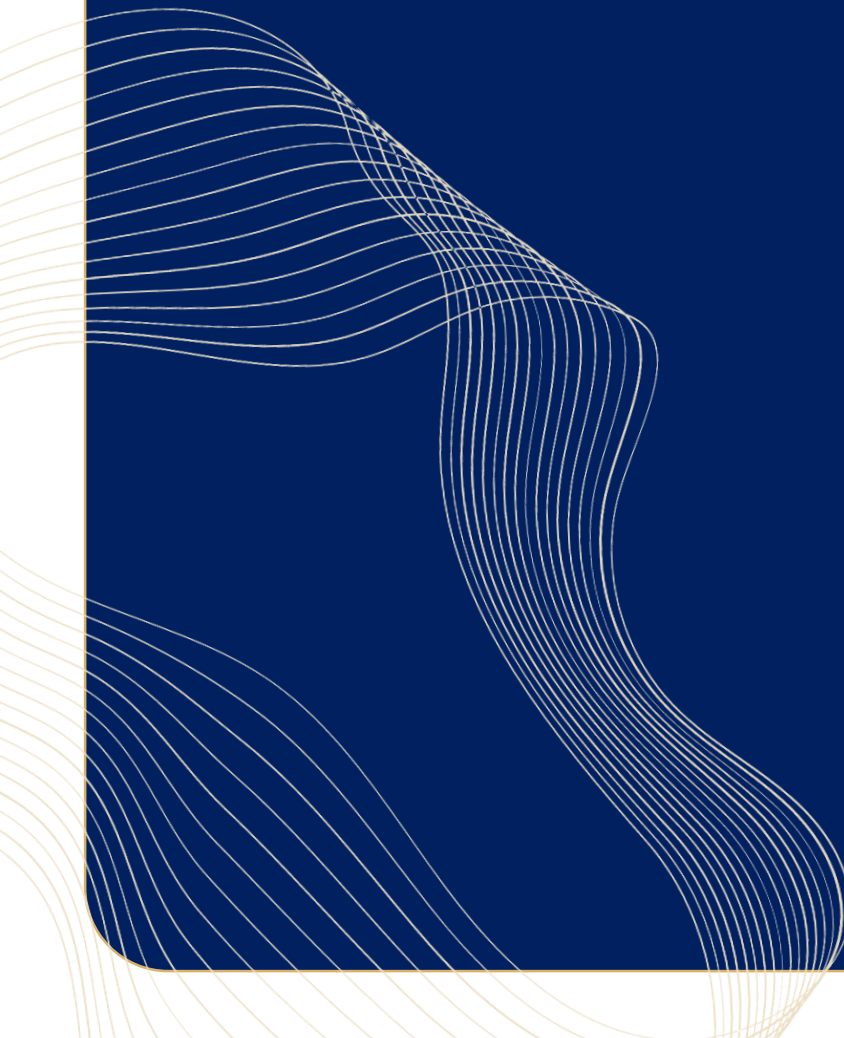
رکن	دوره منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	دوره منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
مدیر	شرکت سرمایه گذاری صبا تامین	شرکت سرمایه گذاری صبا تامین
متولی	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	موسسه حسابرسی دش و همکاران
کارگزار	شرکت کارگزاری صبا تامین	شرکت کارگزاری صبا تامین

در دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ تمام ارکان صندوق به جز رکن حسابرس (به دلیل پایان دوره مجاز ۴ ساله) نسبت به دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ بدون تغییر بوده است.



واحدهای سرمایه گذاری صندوق

سرمایه گذار	۱۴۰۱/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۰۶/۳۱	نوع واحد
شرکت سرمایه گذاری صبا تامین	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	ممتاز
شرکت سرمایه گذاری نفت، گاز و پتروشیمی تامین	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	ممتاز
شرکت کارگزاری صبا تامین	۸۹۶	۸۹۶	۸۹۶	ممتاز
مجموع واحدهای ممتاز	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	ممتاز
مجموع واحدهای عادی	۷۳,۹۶۰,۳۶۴	۷۰,۳۹۶,۶۹۶	۶۶,۵۵۸,۵۳۹	عادی
مجموع کل واحدهای سرمایه گذاری	۷۴,۰۴۹,۹۶۴	۷۰,۴۸۶,۲۹۶	۶۶,۶۴۸,۱۳۹	-



بخش سوم: عملیات بازارگردانی

هدف از تشکیل و موضوع فعالیت صندوق

طبق ماده ۳ اساسنامه، هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آن‌ها به خرید انواع اوراق بهادار موضوع ماده (۴) به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه‌جویی‌های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه‌گذاران است.

طبق ماده ۴ اساسنامه، موضوع فعالیت صندوق بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه و سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار پذیرفته شده در بورس تهران / فرابورس ایران، اوراق بهادار با درآمد ثابت، سپرده‌ها و گواهی‌های سپرده بانکی در راستای انجام فعالیت بازارگردانی است. کلیه دارایی‌ها، بدهی‌ها و هزینه‌های مربوط به هریک از عملیات بازارگردانی شرکت‌های مورد نظر به صورت جداگانه نگهداری و گزارش می‌گردد. خصوصیات دارایی‌های موضوع سرمایه‌گذاری و حد نصاب سرمایه‌گذاری مربوطه در امیدنامه ذکر شده است.

طبق بند الف ماده ۱ دستورالعمل فعالیت بازارگردانی، بازارگردانی مبتنی بر حراج عبارتست از : یک روش فعالیت بازارگردانی که طی آن بازارگردان ورقه بهادار به طور همزمان سفارش خرید و فروش را با رعایت حداقل سفارش انباشته و دامنه مظنه در سامانه معاملاتی ثبت می نماید.

طبق بند پ این ماده حداقل سفارش انباشته عبارتست از : حداقل تعدادی از ورقه بهادار است که بازارگردان باید در سفارش های خرید و فروش خود در دامنه مظنه تا زمان ایفای تعهدات روزانه در سامانه معاملات نگهداری نماید. طبق بند ث این ماده دامنه مظنه عبارتست از : حداکثر اختلاف بین پائین ترین قیمت سفارش خریدی که مجموع حجم سفارشهای خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته بوده و بالاترین قیمت سفارش فروشی که مجموع حجم سفارشهای فروش تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته به درصد است که بازارگردان آن ورقه بهادار، در سامانه معاملات بورس وارد مینماید. این درصد نسبت به پائین ترین قیمت سفارش خریدی که مجموع حجم سفارشهای خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته است، محاسبه میشود.

عملیات بازارگردانی

طبق بند ت این ماده حداقل معاملات روزانه عبارتست از : تعداد ورقه بهاداری است که در صورتی که بازارگردان با رعایت سایر تعهدات بازارگردانی، به میزان آن تعداد از ورقه بهادار در یک روز معاملاتی، معامله کند، تعهدات بازارگردان در آن روز ایفا شده تلقی میگردد. در

تصویر زیر نمونه عملیات بازارگردانی یک نماد در طول یک روز کاری نشان داده شده است :



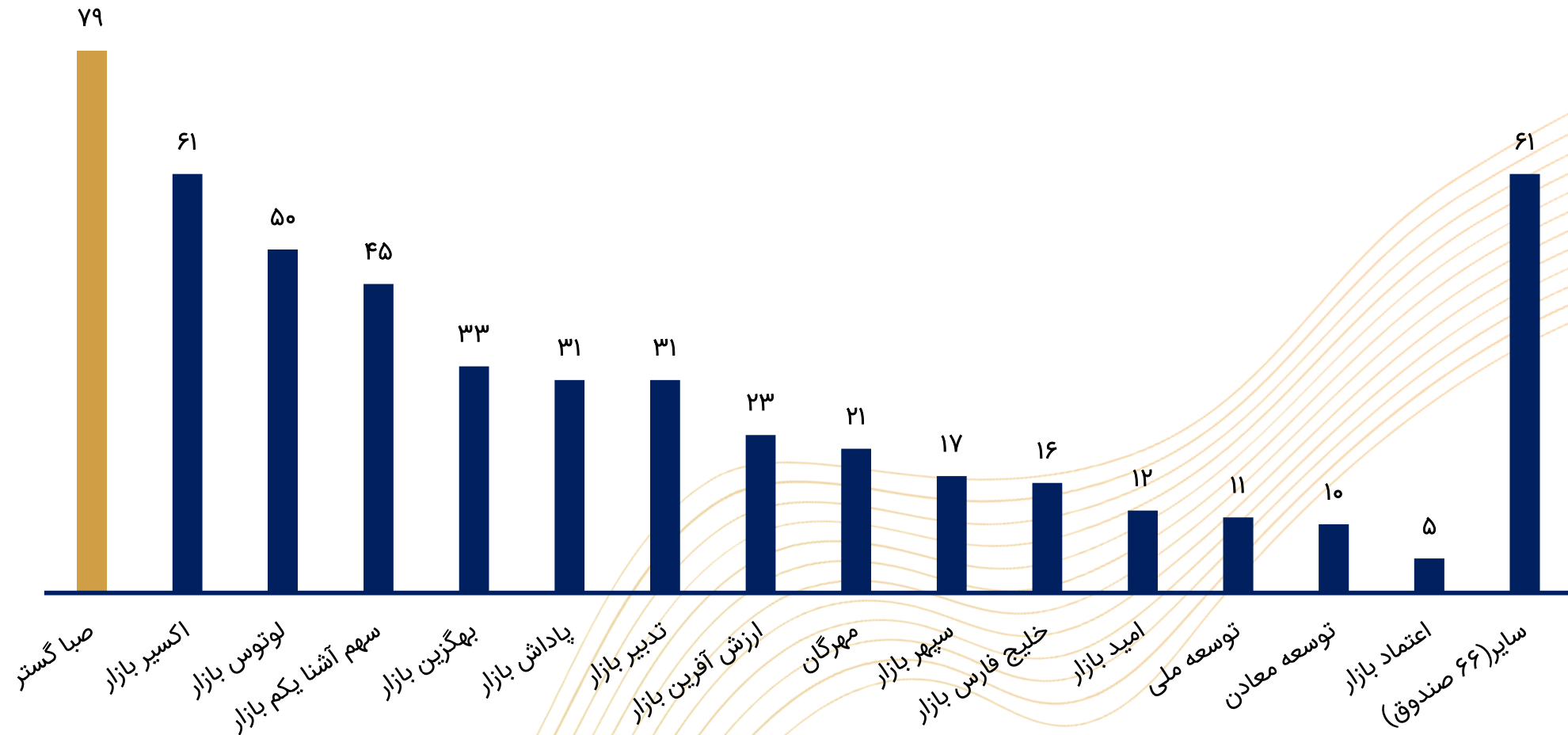
نمادهای موضوع بازارگردانی به تفکیک هلدینگ

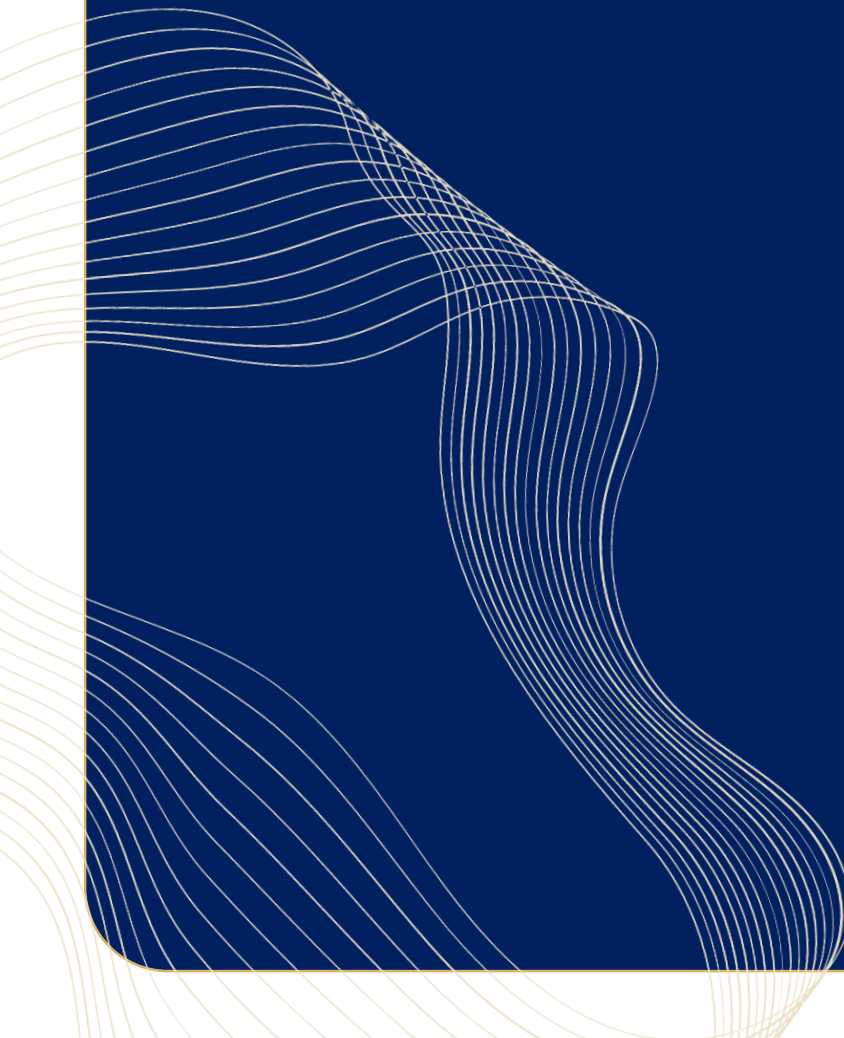


هلدینگ	نماد				
هلدینگ شستا	شستا	تاپیکو	صبا	تاصیکو	سیتا
هلدینگ تاپیکو	شفن	خراسان	شپاس	شغدیر	شرانل
	وپترو	شفارا	شپترو		
هلدینگ تیپیکو	وپخش	دیپارس	دلر	دفارا	دقاضی
	دزهرای	دتوزیع	درازک	هجرت	دتماد
	دابور	کاسپین	دشیمی	ددام	دشیری
	دره‌آور				
هلدینگ تاصیکو	کخاک	فباهنر	شاملا	کفرا	کسعدی
	کپشیر	کزغال	شلعاب		
هلدینگ سیتا	سفارس	سصوفی	ساروم	سقاین	سرود
	سخوز	سفار	سخزر	سفانو	سبجنو
	سغرب	سخاش	سنیر	سدور	سفاسی
هلدینگ صنایع عمومی	لپارس	زفکا	زملارد	زگلدشت	لخانه
هلدینگ وپترو	پسهند	شکرین	شدوص	رتکو	پلوله
هلدینگ سلولزی	چکاوه	چخزر	لطیف		
سایر مجموعه ها	مداران	شاوان	شکبیر		
هلدینگ صبا تامین	وهامون	صندوق اوصتا			

بزرگترین صندوق بازارگردانی بازار سرمایه کشور به لحاظ تعداد نماد موضوع بازارگردانی

صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی ۷۹ نماد، بازارگردان ۱۰ درصد کل شرکتهای بازار سرمایه کشور می باشد.





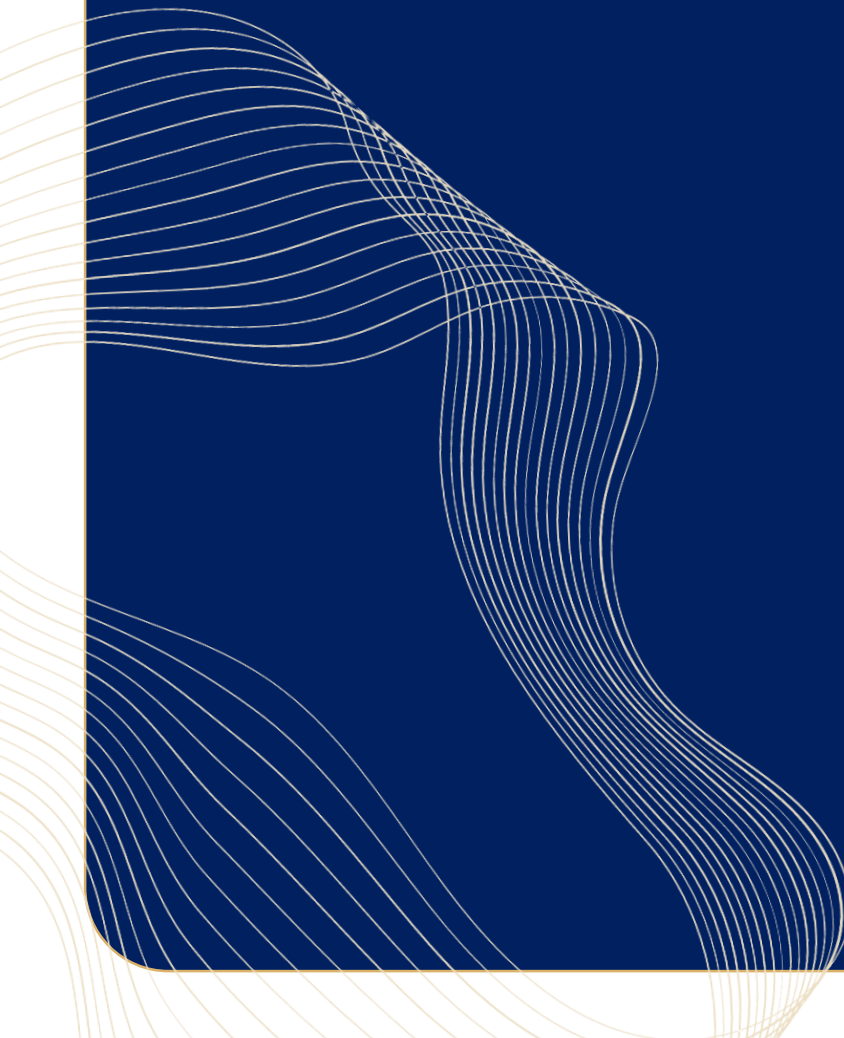
بخش چهارم:

صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	شش ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
درآمد ها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۲,۱۸۳,۹۱۸	۸۲۰,۵۲۳
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	(۴,۲۳۵,۹۶۵)	(۲,۰۳۱,۰۴۹)
سود سهام	۶,۱۸۷,۹۸۴	۴,۷۴۱,۶۶۶
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۴۷۰,۴۷۶	۲۴۶,۹۴۲
سایر درآمدها	۵۴,۷۱۶	۱,۴۴۲
جمع درآمدها	۴,۶۶۱,۱۲۹	۳,۷۷۹,۵۲۵
هزینه ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۳۶۰,۶۹۷)	(۲۸۸,۷۳۲)
هزینه مالی	(۸۷,۸۰۱)	(۳۳,۶۶۰)
سایر هزینه‌ها	(۵,۲۱۶)	(۱,۲۹۱)
جمع هزینه ها	(۴۵۳,۷۱۴)	(۳۲۳,۶۸۳)
سود (زیان)خالص	۴,۲۰۷,۴۱۵	۳,۴۵۵,۸۴۲



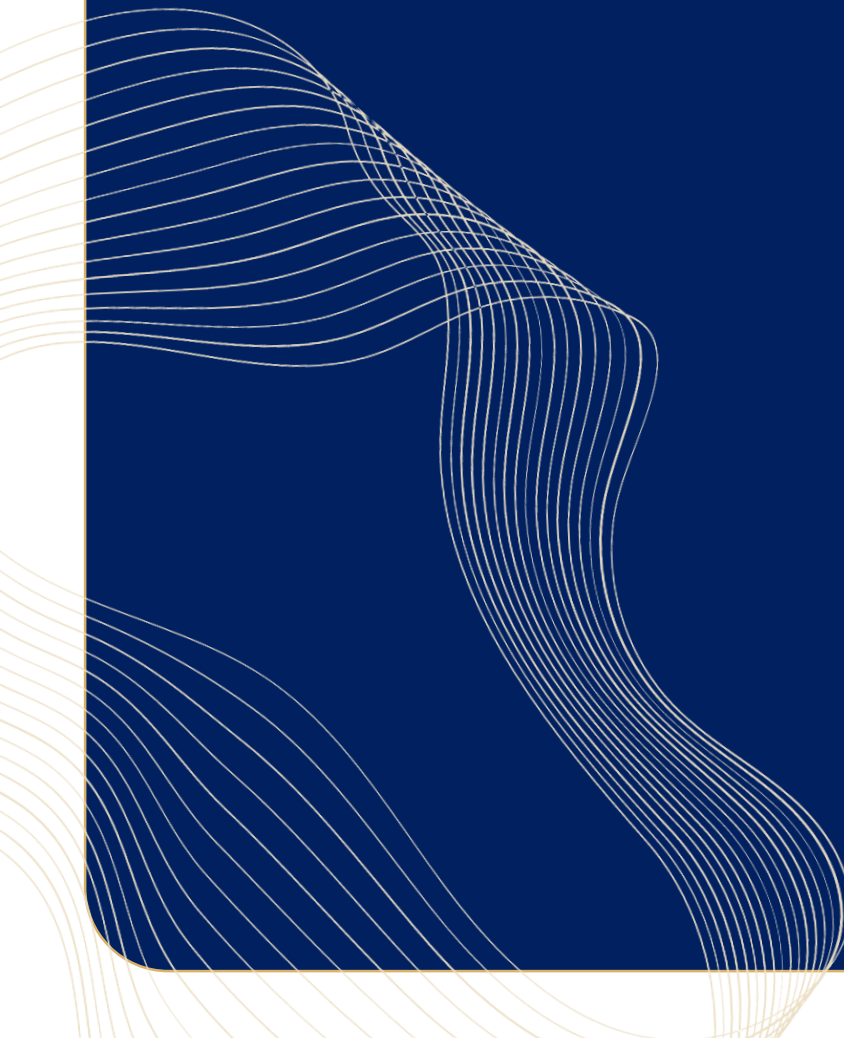
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی ها

صورت خالص دارایی ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۱/۰۶/۳۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹
دارایی ها :		
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۵۹,۲۴۰,۹۶۴	۵۹,۷۷۸,۲۵۳
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۲۱۸,۳۵۷	۵۶۱,۳۸۷
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۳۶۵,۱۴۳	۴,۶۷۷,۸۹۳
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۹,۵۵۵,۴۳۸	۷۷۴,۶۷۹
حساب های دریافتی	۶,۱۹۲,۱۷۵	۲,۵۱۸,۴۱۱
سایر دارایی ها	۲۳,۰۰۵	۰
موجودی نقد	۱۷,۳۶۲	۵۵
جاری کارگزاران و صندوق ها	۶۲۸,۸۳۱	۱۷,۱۱۹
جمع دارایی‌ها	۷۶,۲۴۱,۲۷۶	۶۸,۳۲۷,۷۹۶
بدهی ها :		
پرداختی به ارکان صندوق	۲۴۳,۱۴۵	۲۴۱,۶۹۰
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۲۸,۷۱۶	۱,۷۱۰
بدهی به سرمایه گذاران	۱۶۲	۶,۲۲۴
جمع بدهی‌ها	۲۷۲,۰۲۳	۲۴۹,۶۲۴
خالص دارایی‌ها	۷۵,۹۶۹,۲۵۳	۶۸,۰۷۸,۱۷۲
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۱,۰۲۵,۹۱۸	۹۶۵,۸۳۵



بخش ششم:

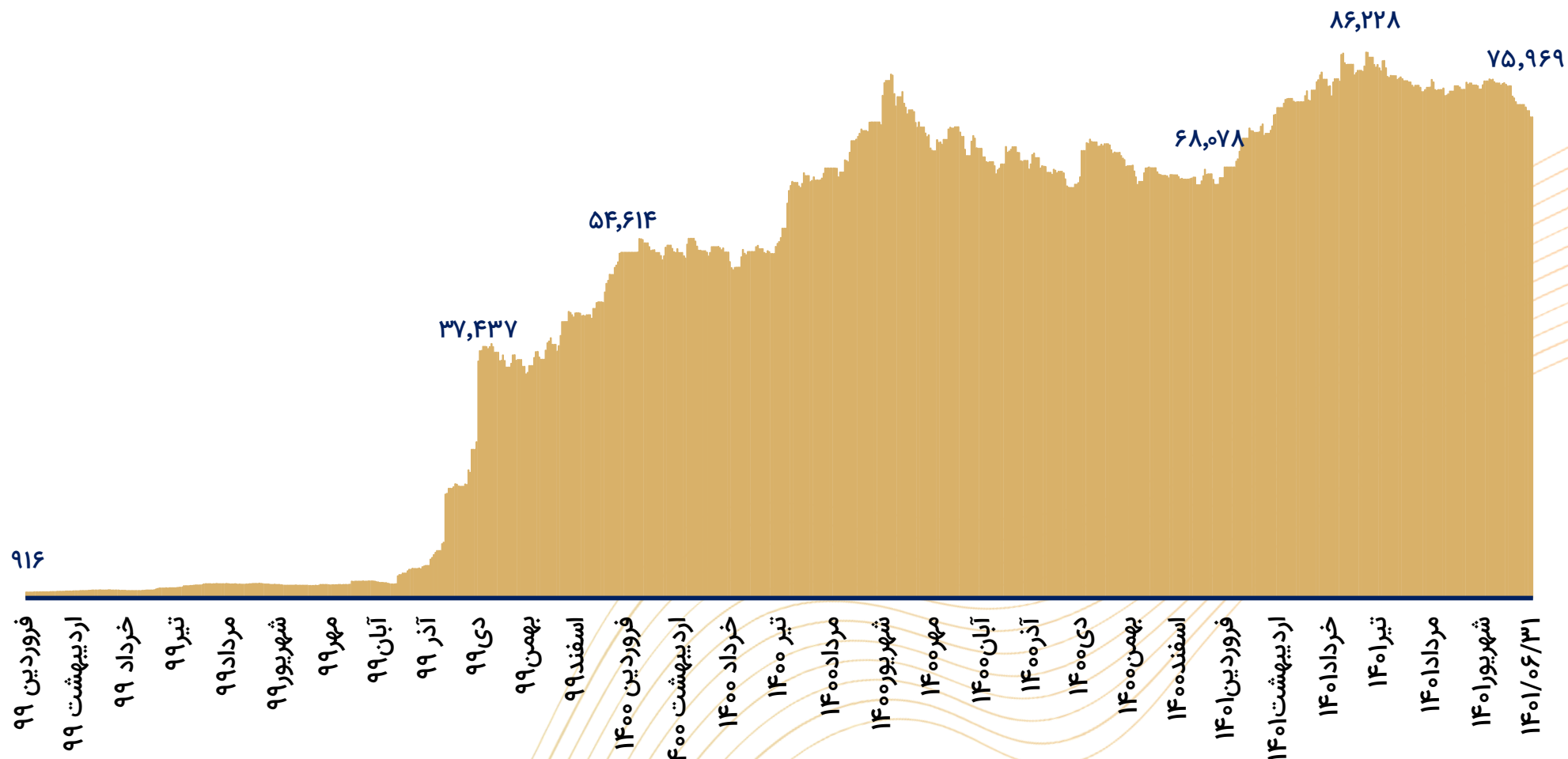
خالص ارزش دارایی ها صندوق



شرکت سرمد کداری سهامین

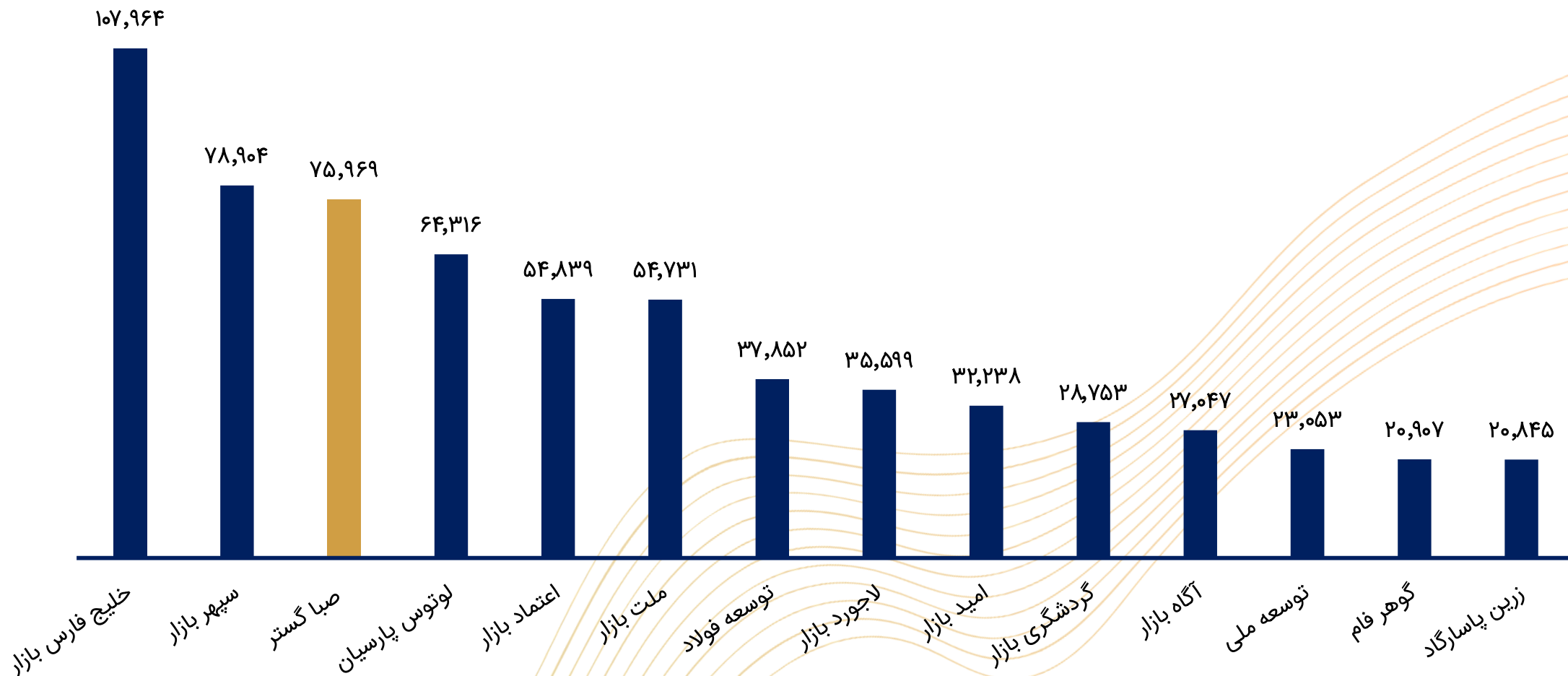
روند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

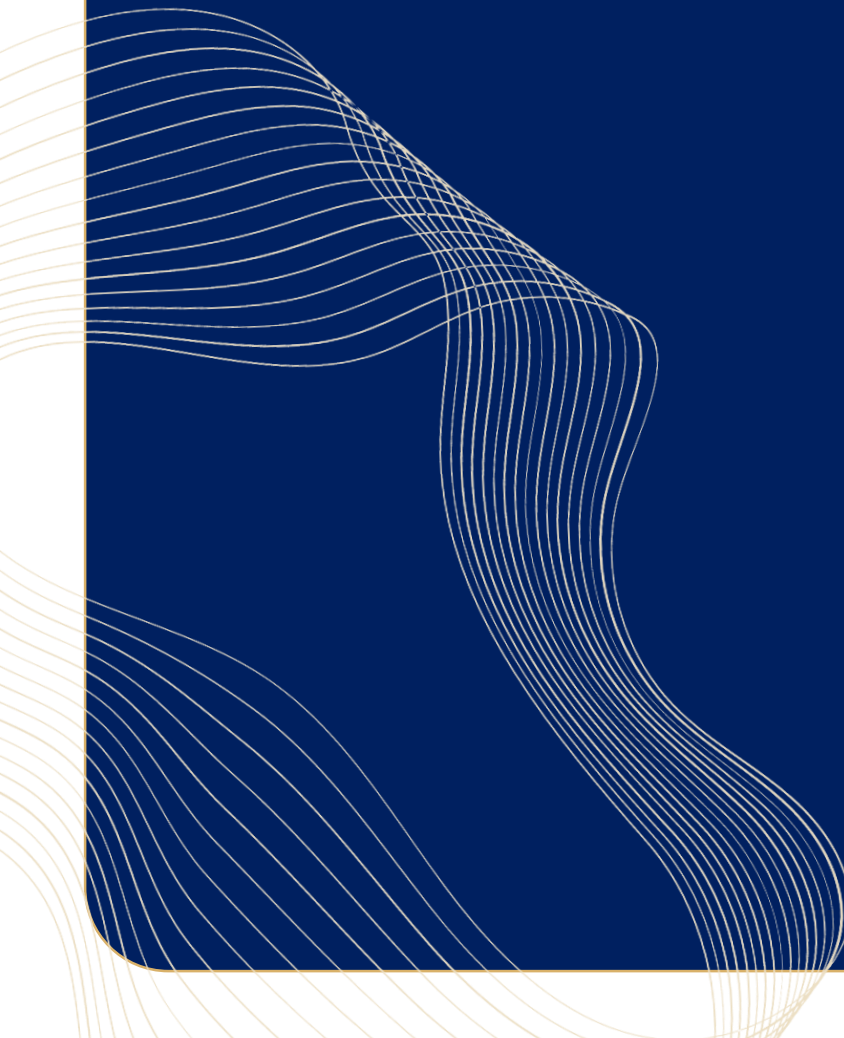
در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۷۵,۹۶۹ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ **افزایش ۷ درصدی** را تجربه کرده است.



سومین صندوق بازارگردانی بازار سرمایه کشور به لحاظ خالص ارزش دارایی صندوق

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)



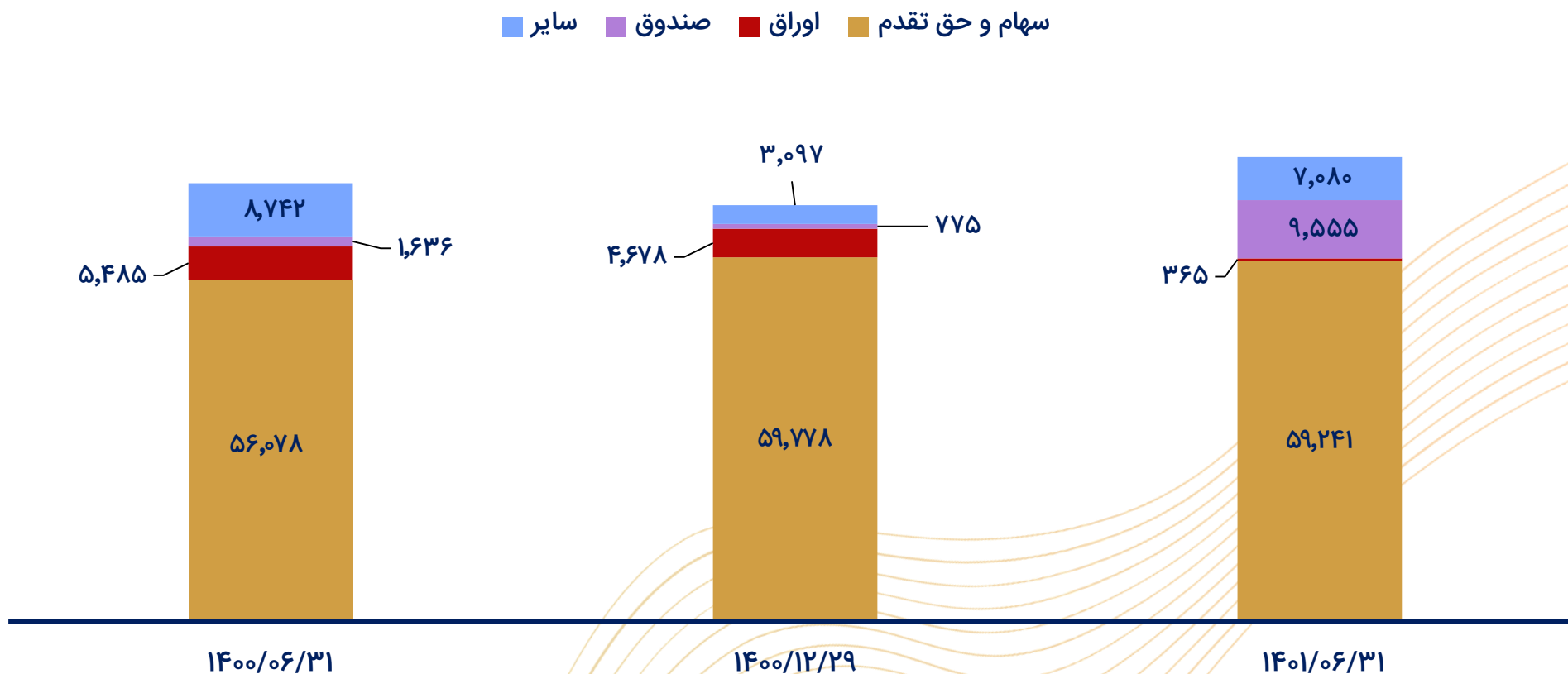


بخش هفتم:

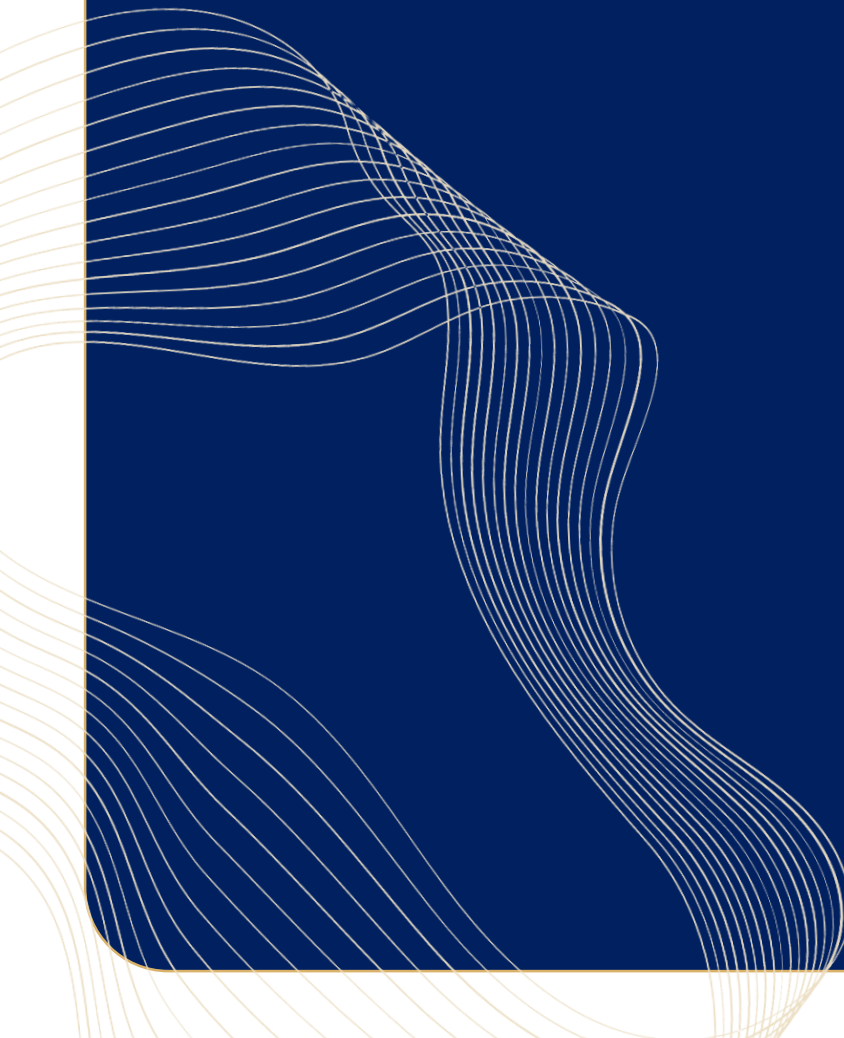
ترکیب دارایی ها صندوق

ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)



عمده (۸۷ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتی (سررسید نشده) می باشد که به تدریج از شرکتها وصول می گردد.



بخش هشتم:

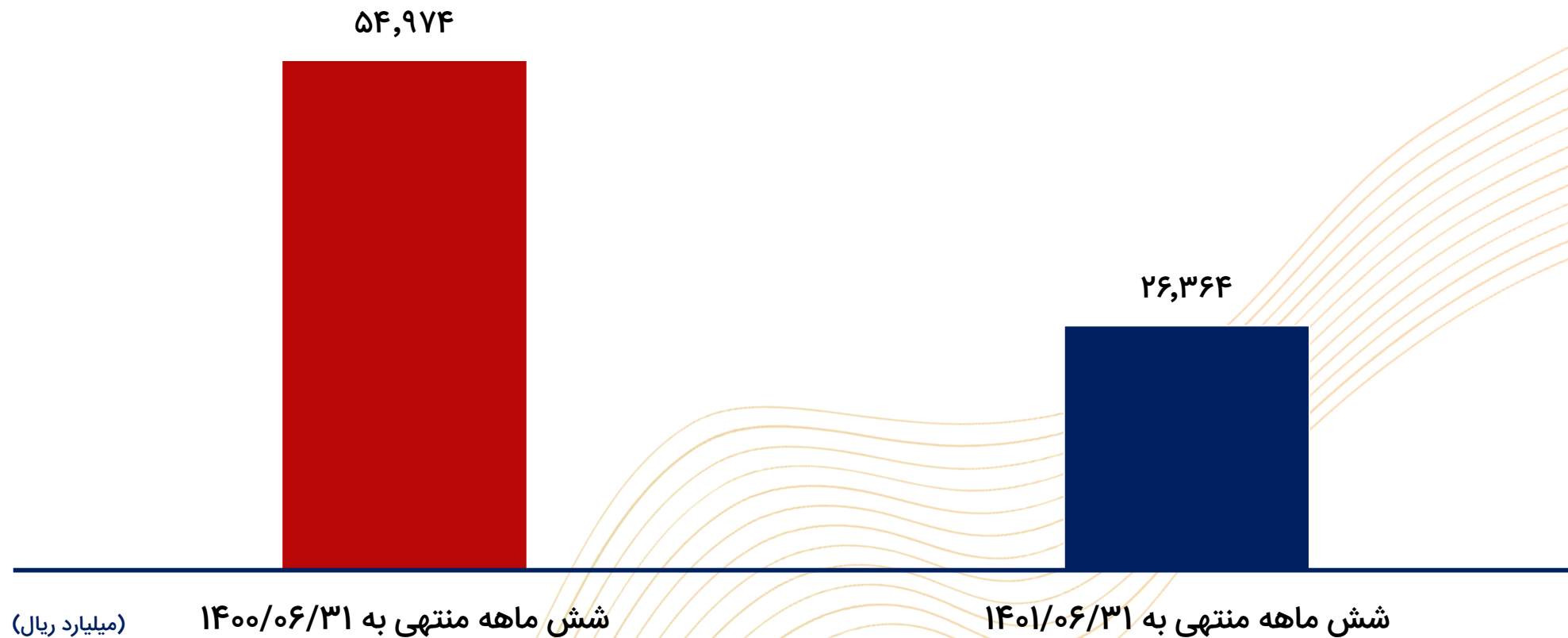
معاملات سهام صندوق



شرکت سرمایه‌گذاری بهائین

ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر

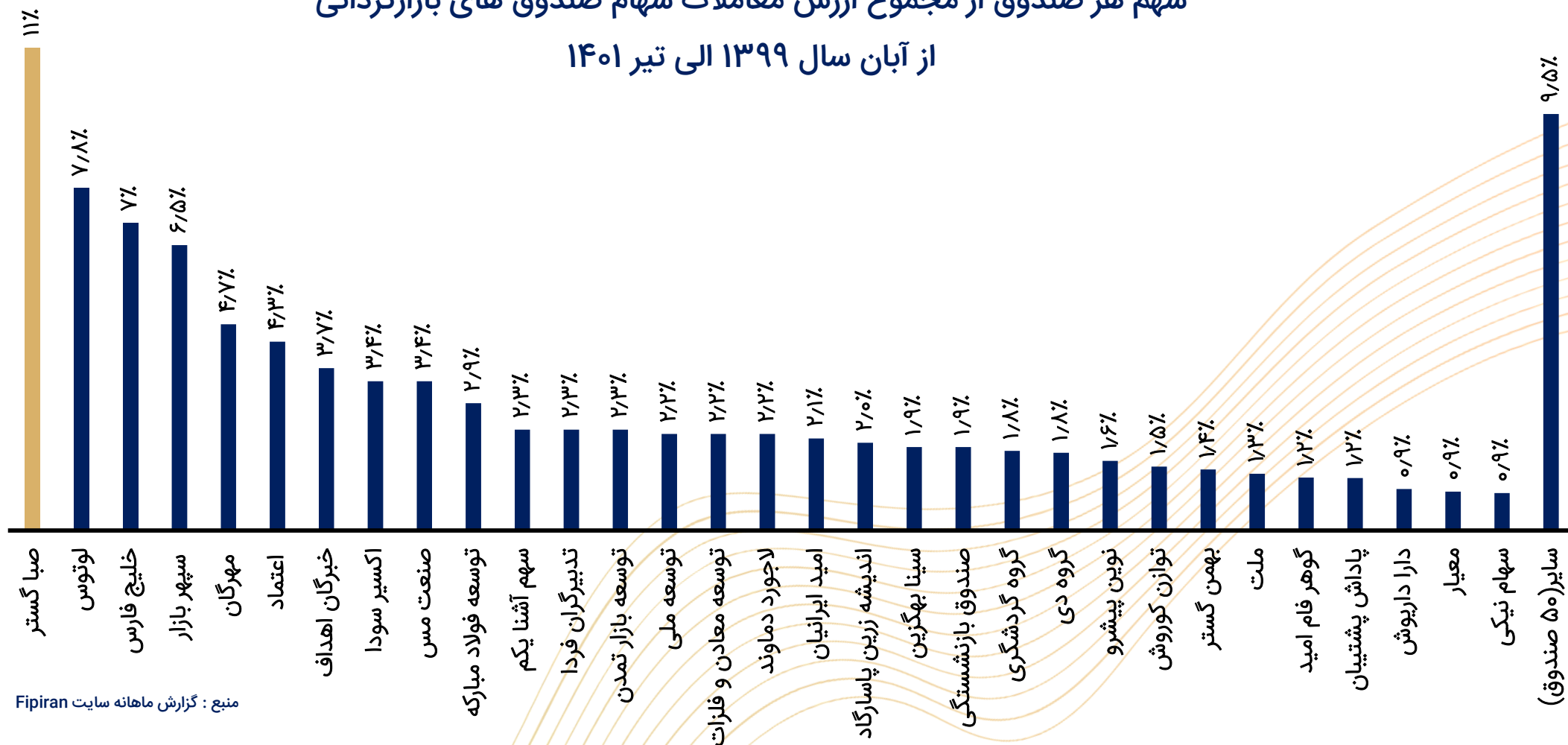
با توجه به کاهش ارزش معاملات در بازار سرمایه، در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱ نسبت به مدت مشابه سال گذشته ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر کاهش ۴۸ درصدی را تجربه کرده است



فعال ترین صندوق بازارگردانی سرمایه کشور

با در اختیار داشتن سهم ۱۱ درصدی از کل ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

سهم هر صندوق از مجموع ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی
از آبان سال ۱۳۹۹ الی تیر ۱۴۰۱

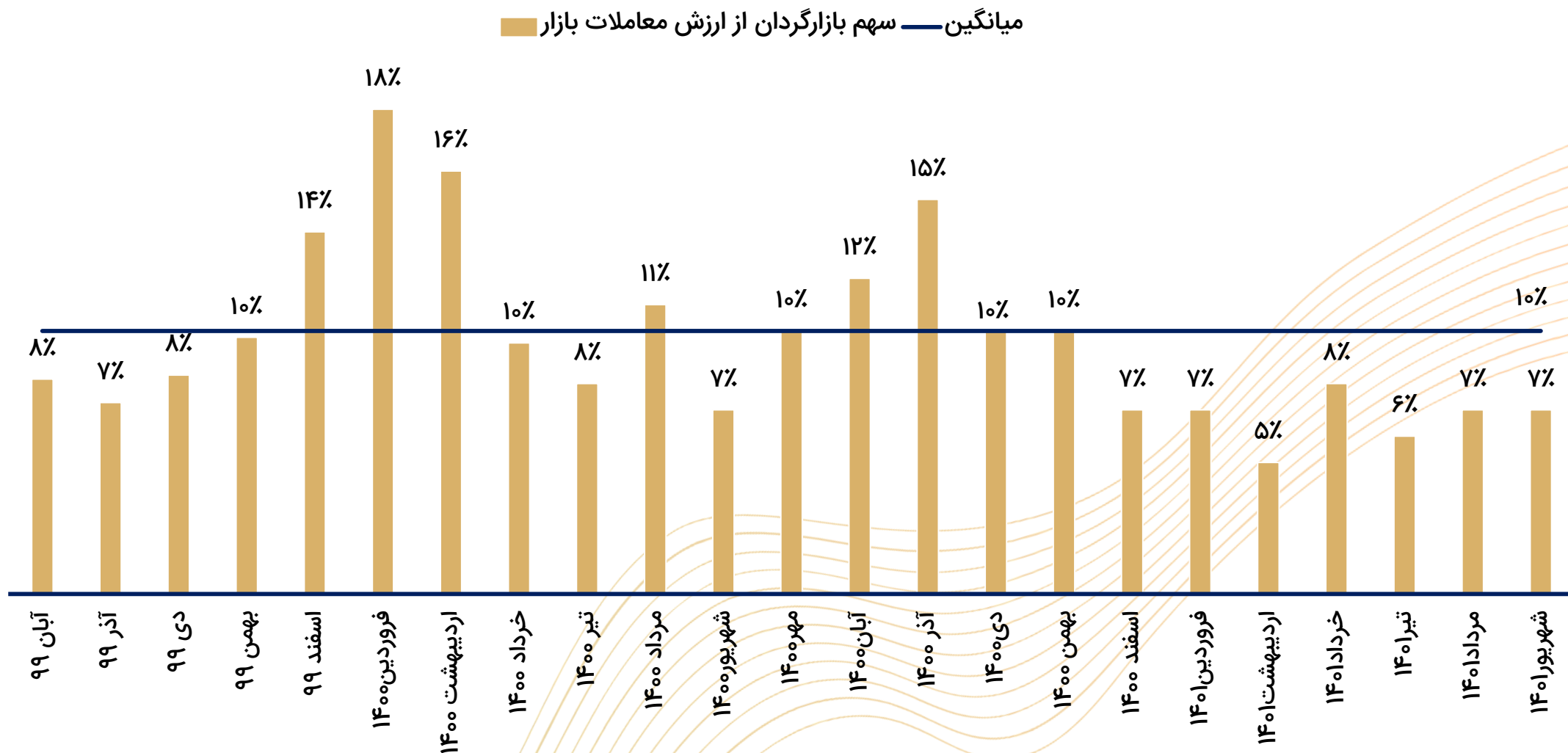


منبع : گزارش ماهانه سایت Fipiran



شرکت سرمایه‌گذاری بهائین

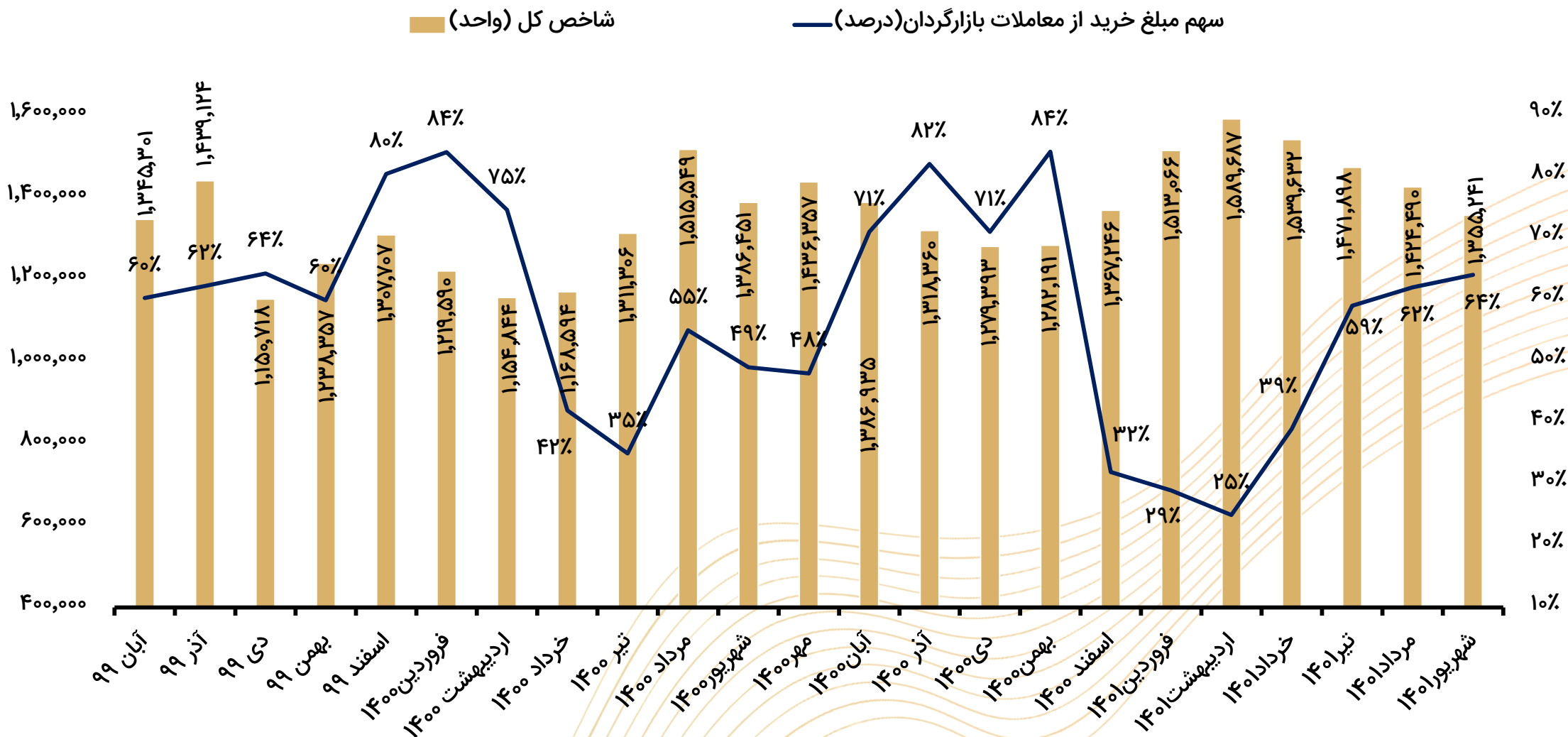
روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملات نمادهای موضوع بازارگردانی

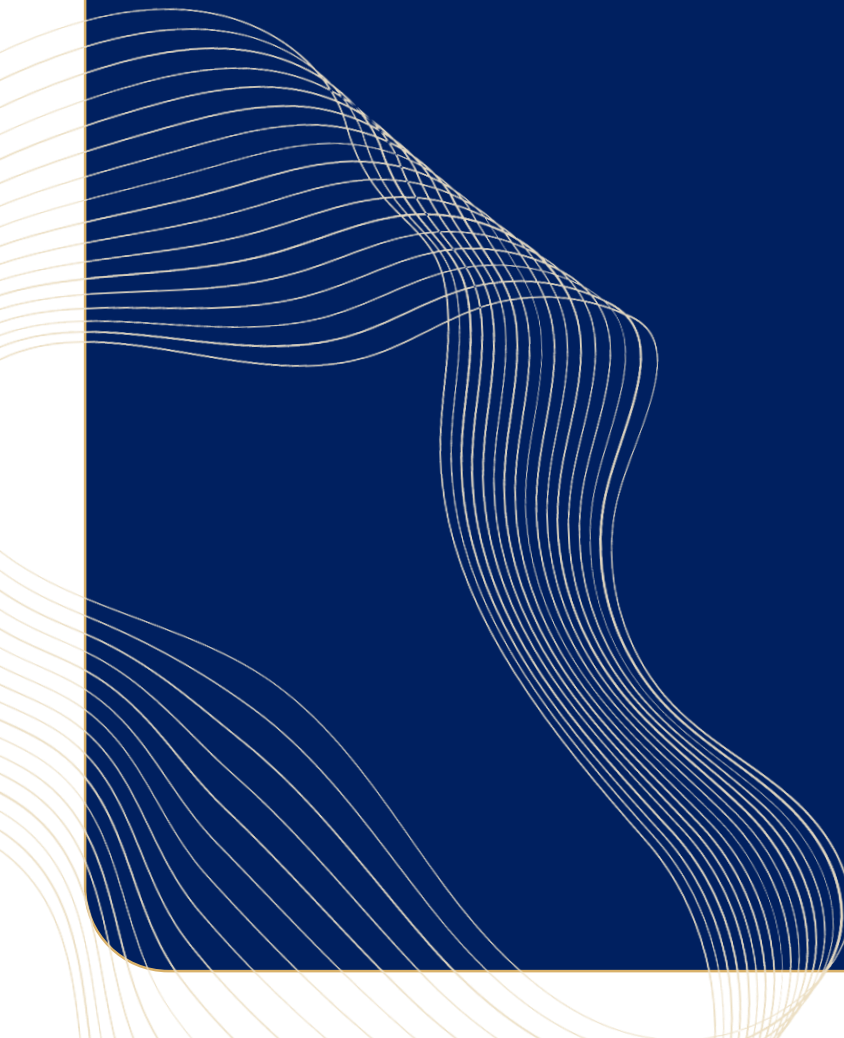




شرکت سرمایه‌گذاری صباپارس

روند سهم خرید از ارزش معاملات ماهانه صندوق صباگستر





بخش نهم:

عملکرد صندوق به تفکیک نماد



خرید و فروش بازارگردان در شستا و هلدینگ ها

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
سر. تامین اجتماعی	شستا	۱,۴۱۴	۱,۴۳۷	۲,۸۵۱	۵۰%	۳%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۲۶۴	۹۰۲	۱,۱۶۶	۲۳%	۷%
سر. صبا تامین	صبا	۵۸۴	۲۴۸	۸۳۲	۷۰%	۸%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۱۱۴	۱۵۸	۲۷۲	۴۲%	۳%
سر. سیمان تامین	سیتا	۱۵۳	۴۱۴	۵۶۷	۲۷%	۱۰%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۴۸	۶۰	۱۰۸	۴۴%	۲%
مجموع		۲,۵۷۸	۳,۲۱۷	۵,۷۹۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
پتروشیمی فن آوران	شفن	۱۸۲	۹۷	۲۷۹	۶۵%	۴%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۶۶	۸۸	۱۵۴	۴۳%	۳%
نفت پاسارگاد	شپاس	۳۹	۵۸	۹۷	۴۰%	۹%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۲۳۰	۳۳۲	۵۶۲	۴۱%	۶%
نفت ایرانول	شرانل	۱۰۳	۱۹۵	۲۹۸	۳۴%	۶%
صنعتی بارز	پکرمان	۱۴۰	۱۹۰	۳۲۹	۴۲%	۱۲%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۰۱	۱۶۶	۲۶۷	۳۸%	۹%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۱۲۰	۹۰	۲۰۹	۵۷%	۲۰%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۲۵۴	۲۱۳	۴۶۷	۵۴%	۱۴%
مجموع		۱,۲۳۴	۱,۴۲۸	۲,۶۶۲		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
خاک چینی ایران	کخاک	۶۴	۵۷	۱۲۱	۵۳%	۹%
مس باهنر	فباهنر	۲۸	۴۶	۷۴	۳۸%	۱%
معدنی املاح ایران	شاملا	۵۲	۳۹	۹۱	۵۷%	۴%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۸۹	۱۰۳	۱۹۲	۴۶%	۷%
کاشی سعدی	کسعدی	۴۳	۴۳	۸۶	۵۰%	۳%
کاشی الوند	کلوند	۱۰۹	۲۱۳	۳۲۱	۳۴%	۹%
زغال پرورده طبس	کزغال	۹۱	۳۳۵	۴۲۶	۲۱%	۷%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۹۳	۱۰۲	۱۹۴	۴۸%	۶%
لعبیران	شلعاب	۱۵۷	۱۲۸	۲۸۵	۵۵%	۸%
مجموع		۷۲۶	۱,۰۶۵	۱,۷۹۱		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
داروپخش	وپخش	۴۸	۴۴	۹۲	۵۲%	۶%
پارس دارو	دپارس	۴۰	۵۱	۹۱	۴۴%	۹%
دارو اکسیر	دلر	۳۰	۴۹	۷۹	۳۸%	۲%
دارو فارابی	دفار	۳۵	۴۲	۷۷	۴۵%	۳%
داروسازی قاضی	دقاضی	۵۷	۶۰	۱۱۶	۴۹%	۷%
کارخانجات داروپخش	دارو	۴۱	۶۵	۱۰۶	۳۸%	۹%
دارو زهراوی	دزهراوی	۷۳	۸۸	۱۶۱	۴۵%	۶%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۵۹	۹۱	۱۵۰	۳۹%	۵%
دارو رازک	درازک	۶۷	۷۳	۱۴۰	۴۸%	۱۳%
پخش هجرت	هجرت	۴۱	۷۱	۱۱۲	۳۷%	۶%
مواد داروپخش	دتماد	۶۷	۹۴	۱۶۱	۴۲%	۶%
کلر پارس	کلر	۲۱۵	۲۰۰	۴۱۴	۵۲%	۵%
دارو ابوریحان	دابور	۶۵	۱۰۷	۱۷۱	۳۸%	۹%
کاسپین تامین	کاسپین	۱۰۰	۱۲۸	۲۲۸	۴۴%	۱۳%
شیمی داروپخش	دشیمی	۷۲	۲۲۰	۲۹۱	۲۵%	۱۰%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۲۶۶	۳۱۴	۵۸۰	۴۶%	۲۰%
شیرین دارو	دشیری	۹۷	۱۰۵	۲۰۲	۴۸%	۲۳%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۳۹	۷۱	۱۰۹	۳۶%	۳%
دارویی ره آورد تامین	درهآور	۷۶	۱۳۷	۲۱۳	۳۶%	۳%
مجموع		۱,۴۸۵	۲,۰۱۰	۳,۴۹۵		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
سیمان فارس و خوزستان	سفارس	۱۲۲	۱۶۴	۲۸۶	۴۳%	۳%
سیمان صوفیان	سصوفی	۶۳	۱۷۲	۲۳۵	۲۷%	۶%
سیمان ارومیه	ساروم	۱۱۷	۱۸۳	۲۹۹	۳۹%	۸%
سیمان قائن	سقاین	۱۴۹	۲۲۷	۳۷۶	۴۰%	۲۵%
سیمان شاهرود	سرود	۷۶	۸۲	۱۵۸	۴۸%	۹%
سیمان ساوه	ساوه	۱۷	۱۰۳	۱۲۰	۱۴%	۶%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۰۶	۱۷۱	۲۷۸	۳۸%	۸%
سیمان فارس	سفار	۲۰۵	۴۰۲	۶۰۷	۳۴%	۱۷%
سیمان خزر	سخزر	۱۴۶	۹۴	۲۴۰	۶۱%	۱۱%
سیمان فارس نو	سفانو	۷۱	۱۶۴	۲۳۶	۳۰%	۹%
سیمان بجنورد	سبجنو	۷۶	۷۵	۱۵۲	۵۰%	۱۰%
سیمان بهبهان	سبهان	۹۵	۹۴	۱۸۹	۵۰%	۱۰%
سیمان غرب	سغرب	۲۵۴	۲۱۷	۴۷۱	۵۴%	۱۳%
سیمان خاش	سخاش	۸۹	۱۰۲	۱۹۱	۴۷%	۱۱%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۱۵۳	۱۸۲	۳۳۶	۴۶%	۴%
سیمان دورود	سدور	۲۰۵	۲۳۵	۴۴۰	۴۷%	۱۸%
فارسیت اهواز	سفاسی	۷۵	۷۵	۱۴۹	۵۰%	۷%
سیمان آبیک	سآبیک	۲۹۴	۱,۸۸۹	۲,۱۸۳	۱۳%	۱۱%
مجموع		۲,۳۱۴	۴,۶۳۲	۶,۹۴۶		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
پارس الکترونیک	لپارس	۷۸	۲۱۳	۲۹۰	۲۷%	۲%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۳۶	۳۵	۷۱	۵۱%	۱%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۱۸۵	۲۲۱	۴۰۶	۴۵%	۱۱%
کشت و دام گلدهشت نمونه اصفهان	زگلدهشت	۳۳	۴۶	۷۹	۴۲%	۲%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۱۰۲	۹۸	۲۰۰	۵۱%	۲۲%
مجموع		۴۳۴	۶۱۳	۱,۰۴۷		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
لاستیک سهند	پسهند	۱۴۴	۱۵۹	۳۰۳	۴۷%	۱۱%
کربن ایران	شکربن	۲۵۱	۲۹۹	۵۵۰	۴۶%	۱۲%
لوله و گاز	پلوله	۱۶۱	۱۵۱	۳۱۲	۵۲%	۱۷%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۹۱	۱۲۷	۲۱۸	۴۲%	۸%
تکین کو	رتکو	۲۶	۵۷	۸۳	۳۱%	۱۴%
مجموع		۶۷۲	۷۹۳	۱,۴۶۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سلولزی



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
کاغذ سازی کاوه	چکاوه	۶۳	۸۱	۱۴۴	۴۴%	۵%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۱۴۴	۱۸۴	۳۲۸	۴۴%	۱۰%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۱۷۳	۲۳۸	۴۱۱	۴۲%	۲۰%
مجموع		۳۸۱	۵۰۲	۸۸۳		

خرید و فروش بازارگردان در سایر مجموعه ها



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)

صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
داده پردازی ایران	مداران	۲۷۲	۲۷۰	۵۴۳	۵۰%	۸%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۳۳۴	۳۸۹	۷۲۲	۴۶%	۵%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۳۳۰	۲۷۴	۶۰۴	۵۵%	۲۸%
سرمایه گذاری هامون صبا	وهامون	۸۱	۲۰۴	۲۸۵	۲۸%	۱۱%
مجموع		۲,۵۰۱	۳,۱۴۷	۵,۶۴۸		

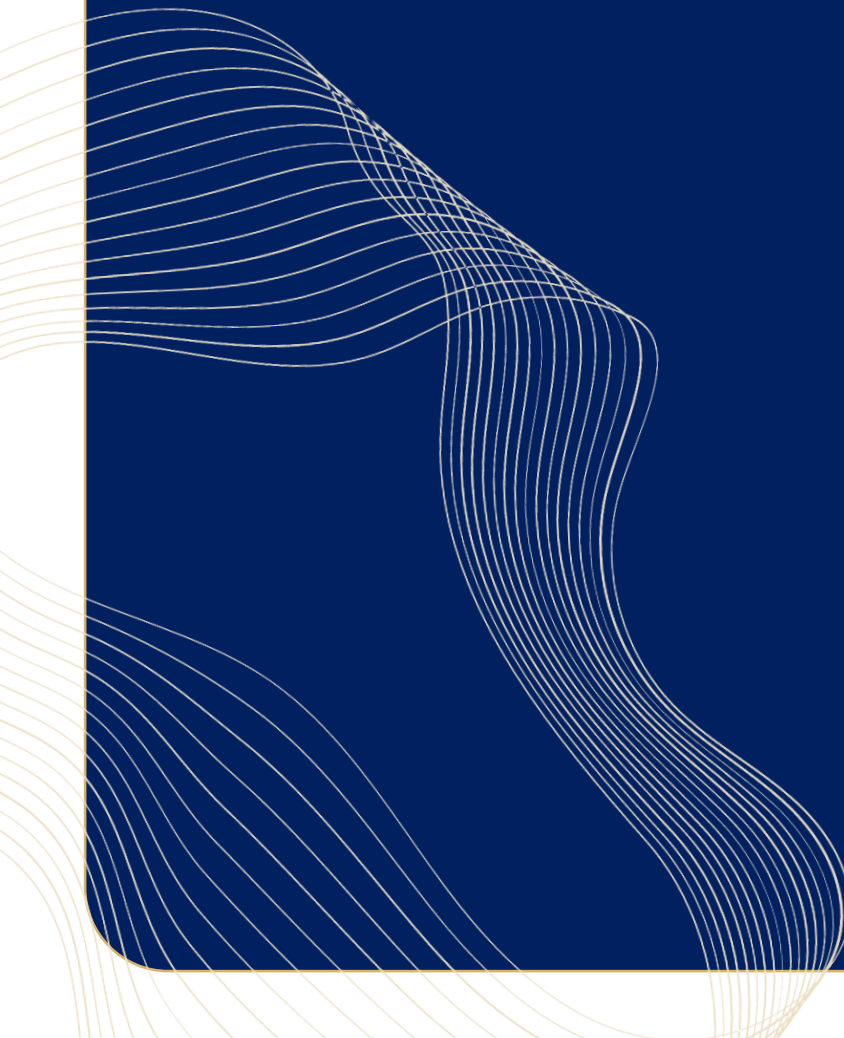
۱۵.۵ درصد میانگین بازدهی شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر

در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱

درحالیکه در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱ بازده شاخص کل **۰.۸۸٪-** بوده است، ۶۴ نماد (۸۱ درصد) از شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
دره‌آور	۱۰۶٪	سنیر	۲۷٪	شکرین	۲۱٪	شلعاب	۱۴٪	پکرمان	۸٪	کلر	۲٪-
سفار	۶۵٪	وهامون	۲۶٪	کخاک	۲۱٪	سفاسی	۱۳٪	سبجنو	۸٪	شاملا	۴٪-
زملارد	۶۱٪	لطیف	۲۶٪	ساوه	۲۰٪	هجرت	۱۲٪	سفاین	۶٪	دزهرای	۴٪-
سفانو	۵۸٪	شدوص	۲۵٪	خراسان	۲۰٪	درازک	۱۱٪	پسهند	۵٪	شستا	۴٪-
کپشیر	۵۰٪	سخاش	۲۵٪	سدور	۲۰٪	دپارس	۱۰٪	سآبیک	۵٪	شاوان	۵٪-
دشیمی	۴۸٪	ساروم	۲۵٪	کلوند	۱۹٪	لخانه	۱۰٪	سرود	۴٪	شغدیر	۶٪-
دکپسول	۴۷٪	دتوزیع	۲۳٪	کاسپین	۱۷٪	سیتا	۱۰٪	فباهر	۴٪	شپاس	۶٪-
وپخش	۳۴٪	دابور	۲۳٪	چخزر	۱۷٪	سخوز	۱۰٪	سفارس	۴٪	دشیری	۱۱٪-
شرانل	۳۳٪	ویپترو	۲۳٪	سغرب	۱۷٪	تاصیکو	۱۰٪	کسعدی	۴٪	شپترو	۱۱٪-
کفرا	۳۲٪	کزغال	۲۲٪	چکاو	۱۶٪	دلر	۱۰٪	دتماد	۲٪	شفارا	۱۴٪-
سخزر	۳۰٪	زگلدشت	۲۲٪	تیپیکو	۱۵٪	تاپیکو	۹٪	دارو	۱٪	لپارس	۲۳٪-
ددام	۲۸٪	مداران	۲۲٪	سبهان	۱۵٪	دفارا	۹٪	شکبیر	۱٪-	شفن	۴۳٪-
سصوفی	۲۸٪	پلوله	۲۱٪	دقاضی	۱۴٪	زفکا	۹٪	صبا	۱٪-		



بخش دهم:

اهم اقدامات انجام شده و برنامه

های آتی صندوق

اهم اقدامات انجام شده در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱

✓ **جایگزینی سرمایه گذاری در اوراق درآمد ثابت (با میانگین سود سالیانه ۱۸ درصد) با صندوق های ETF درآمد ثابت (با میانگین سود سالیانه ۲۱ درصد) :**

این رخداد موجب شد میانگین مجموع مانده روزانه سپرده بانکی صندوق از ۸۰۰ میلیارد ریال در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۰ به ۳۰۰ میلیارد ریال در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱ کاهش یابد.

✓ **طراحی سامانه معاملاتی زیرک :**

استفاده از سامانه معاملاتی زیرک (طراحی و تولید شده توسط شرکت خدمات مدیریت صبا تامین) موجب شده است از یکسو با کاهش عملیات معامله گر، خطای مرتبط با این حوزه را به حداقل برسد و دقت معاملات مبتنی بر دستورالعمل فعالیت بازارگردانی را افزایش یابد، و از سوی دیگر در هزینه کارمزد صرفه جویی قابل توجه صورت پذیرد.

اهم اقدامات انجام شده در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱

✓ استفاده از پتانسیل تحلیلی مجموعه صباتامین :

استفاده از مشاوره مدیران و کارشناسان تحلیل در شرکت سرمایه گذاری صبا تامین، شرکت سبدگردان اندیشه صبا و شرکت سرمایه گذاری هامون صبا موجب شد، در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۱ صندوق بازارگردان صبا گستر بتواند جنبه تحلیل (بنیادی و تکنیکال) در ایفای تعهدات بازارگردانی (با توجه به منابع در دسترس) خود را تقویت سازد.

برنامه های آتی صندوق

✓ بهبود عملکرد و بهینه سازی ایفای تعهدات فعلی بازارگردانی

✓ انجام فعالیت در بازار اختیار معامله جهت تامین مالی موثر نمادهای موضوع بازارگردانی

✓ تکمیل و بهبود سامانه زیرک

✓ افزایش تعداد نمادهای موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق های کالایی و ...

