



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

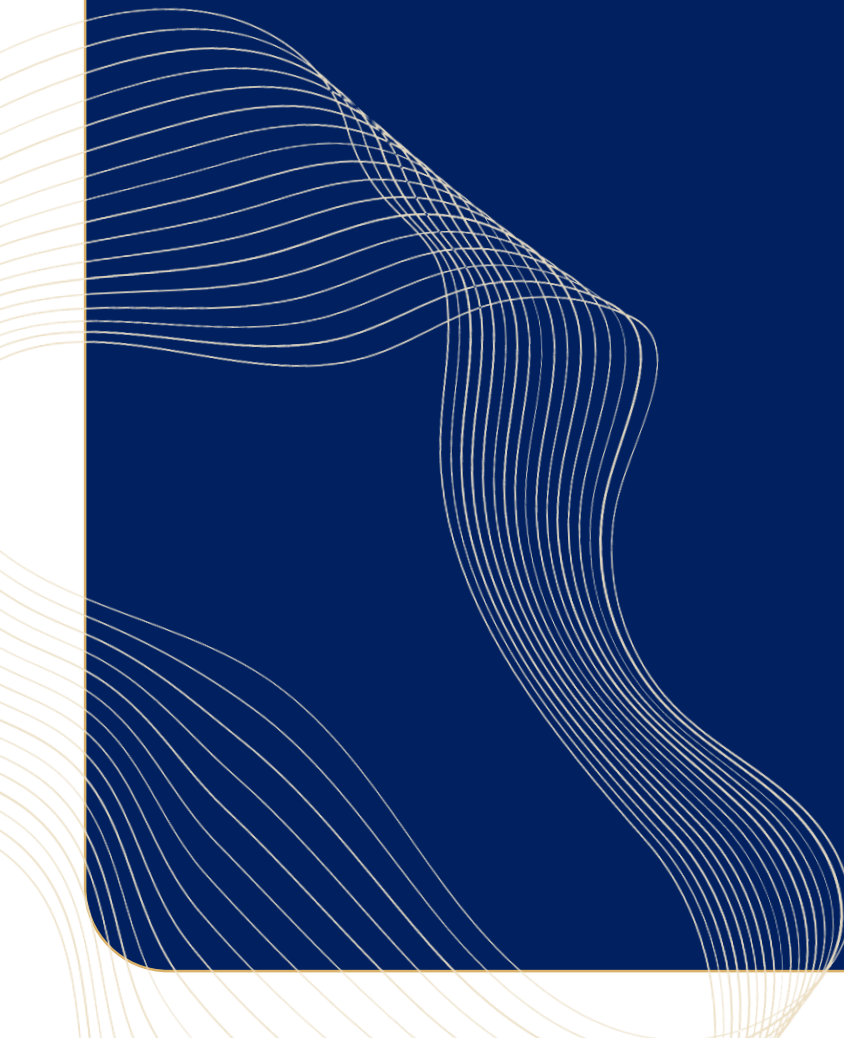
صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰



سبدگردان
اندیشه 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 ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

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

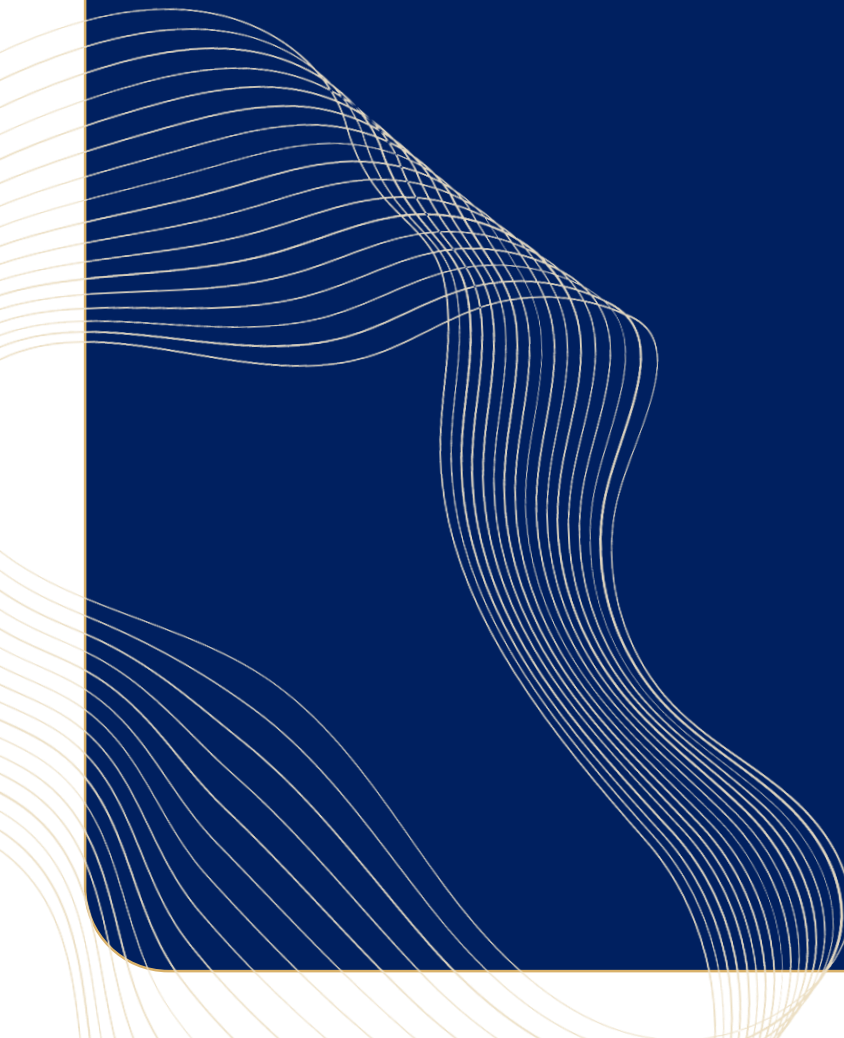
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه

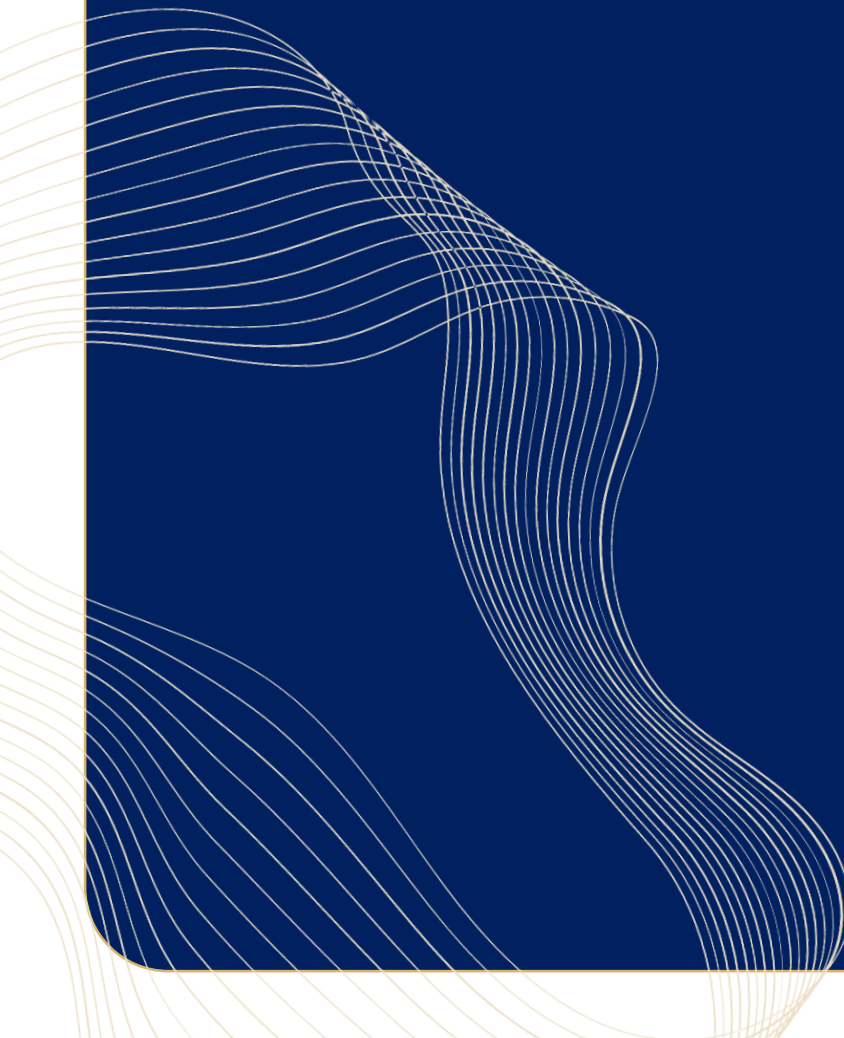
صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد. بلکه 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 ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۷۸ 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 ۸۵,۶۹۲ میلیارد ریال می باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ افزایش ۲۹ درصدی داشته است.



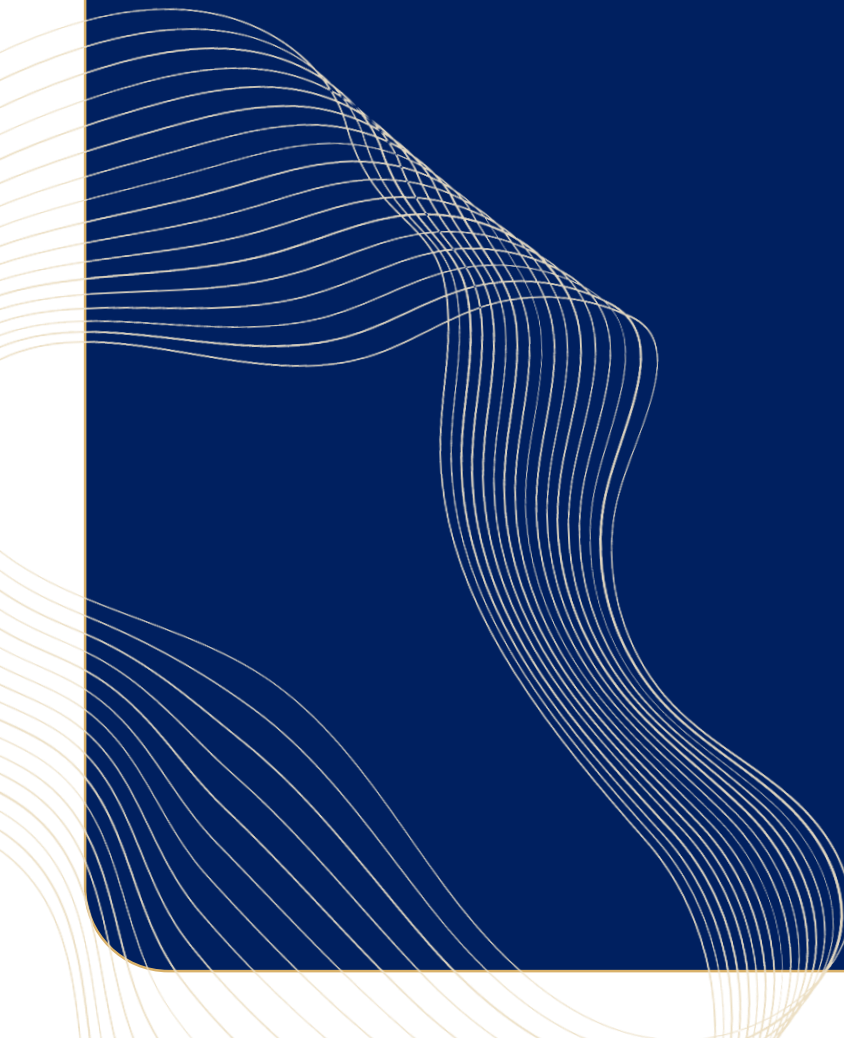
بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

رکن	دوره منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰	دوره منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
مدیر	شرکت سبدگردان اندیشه صبا	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

واحدهای سرمایه گذاری صندوق

نوع واحد	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	سرمایه گذار
ممتاز	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	شرکت سرمایه گذاری صبا تامین
ممتاز	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	شرکت سرمایه گذاری نفت، گاز و پتروشیمی تامین
ممتاز	۰	۰	۸۹۶	شرکت سبدگردان اندیشه صبا
ممتاز	۸۹۶	۸۹۶	۰	شرکت کارگزاری صبا تامین
ممتاز	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	مجموع واحدهای ممتاز
عادی	۶۸,۲۸۳,۲۸۳	۷۰,۳۹۶,۶۹۶	۷۴,۴۸۸,۵۹۱	مجموع واحدهای عادی
عادی و ممتاز	۶۸,۳۷۲,۸۸۳	۷۰,۴۸۶,۲۹۶	۷۴,۵۷۸,۱۹۱	مجموع کل واحدهای سرمایه گذاری



بخش سوم: عملیات بازارگردانی

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 هر یک 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 :



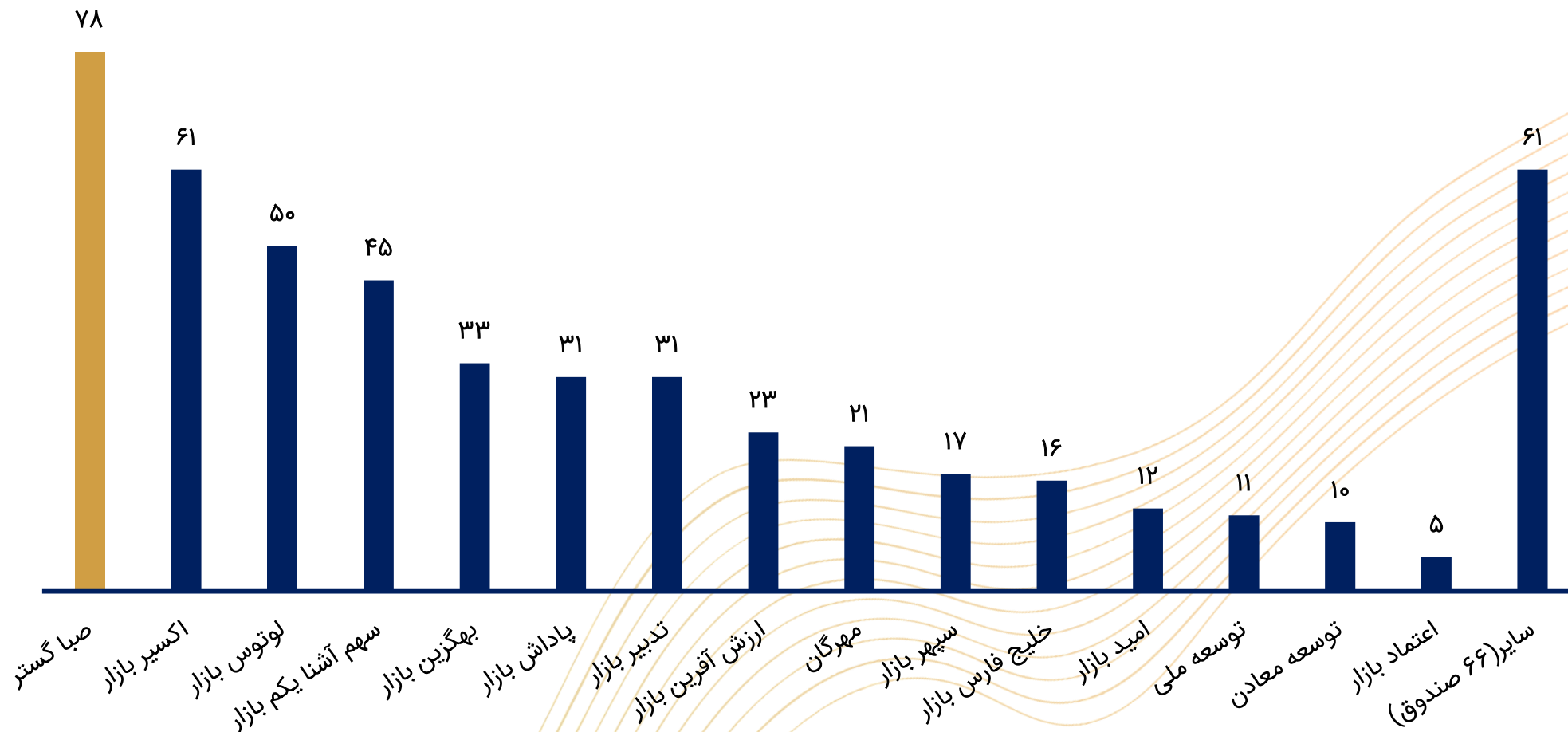


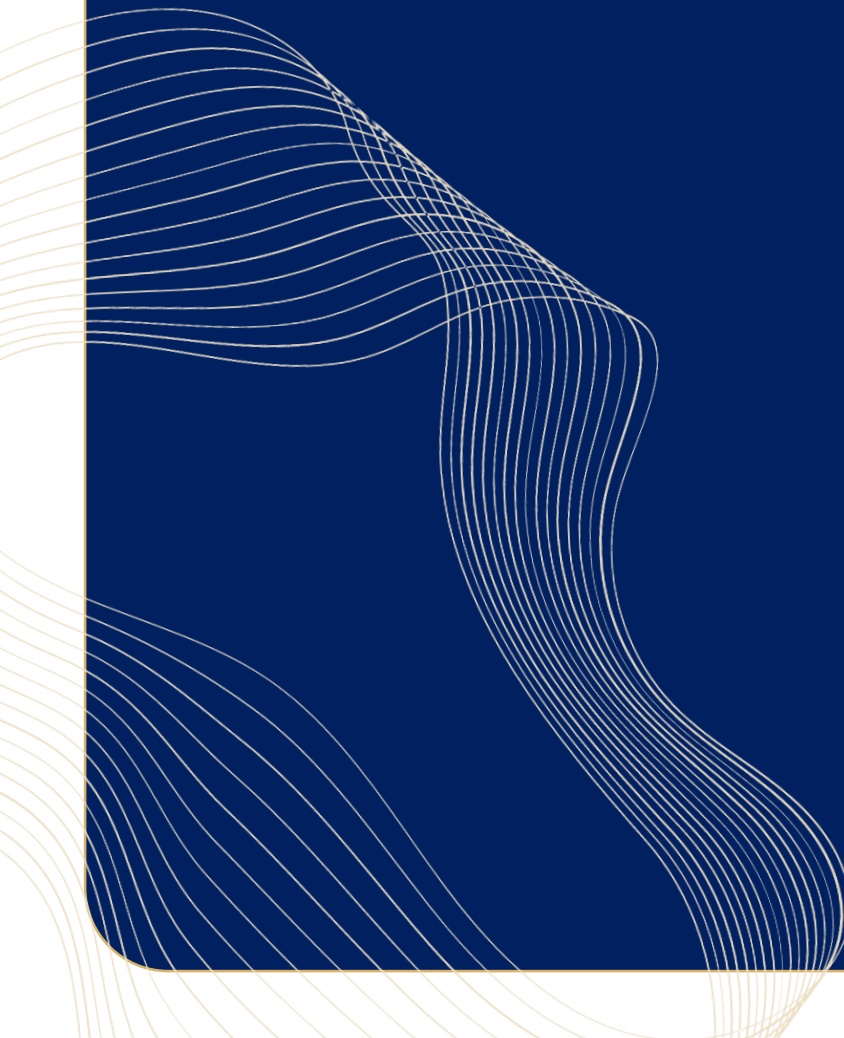
نمادهای موضوع بازارگردانی به تفکیک هلدینگ

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	شکربن	شدوص	رتکو	پلوله
هلدینگ سلولزی	چکاوه	چخزر	لطیف		
سایر مجموعه ها	مداران	شاوان	شکبیر		
هلدینگ صبا تامین	وهامون	صندوق اوصتا	صندوق نفیس		

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

صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی ۷۸ نماد، بازارگردان ۱۰ درصد کل شرکتهای بازار سرمایه کشور می باشد.





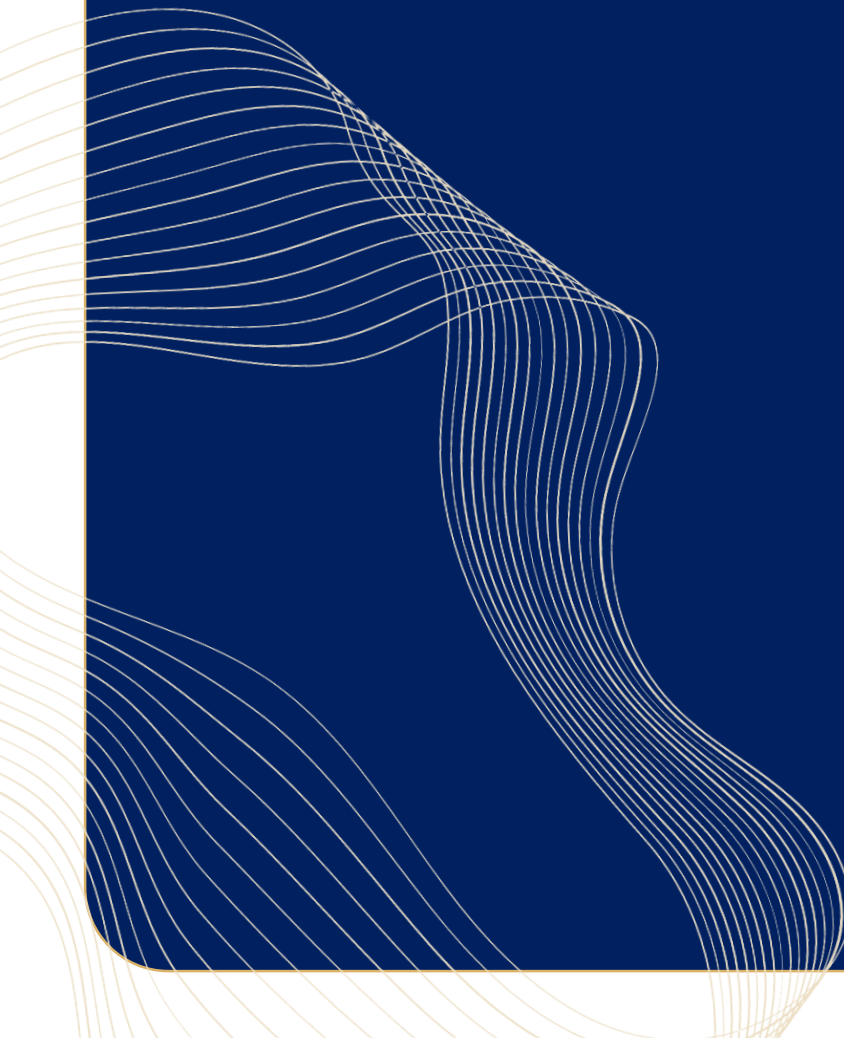
بخش چهارم:

صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰
درآمدها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۲,۱۳۴,۰۳۶	۸۸۲,۸۴۰
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۳,۲۱۸,۱۱۰	(۸,۵۰۲,۸۱۹)
سود سهام	۸,۵۴۸,۳۰۹	۶,۶۶۰,۸۳۲
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۵۰۲,۴۲۵	۴۹۵,۹۱۷
سایر درآمدها	۶۳,۰۶۰	۸,۲۹۳
جمع درآمدها	۱۴,۴۶۵,۹۴۱	(۴۵۴,۹۳۶)
هزینه‌ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۵۱۵,۵۷۹)	(۴۳۰,۶۹۰)
هزینه مالی	(۱۴۱,۴۳۶)	(۸۹,۶۴۹)
سایر هزینه‌ها	(۱۶,۸۳۵)	(۱,۹۲۵)
جمع هزینه‌ها	(۶۷۳,۸۵۰)	(۵۲۲,۲۶۴)
سود (زیان)خالص	۱۳,۷۹۲,۰۹۱	(۹۷۷,۲۰۰)



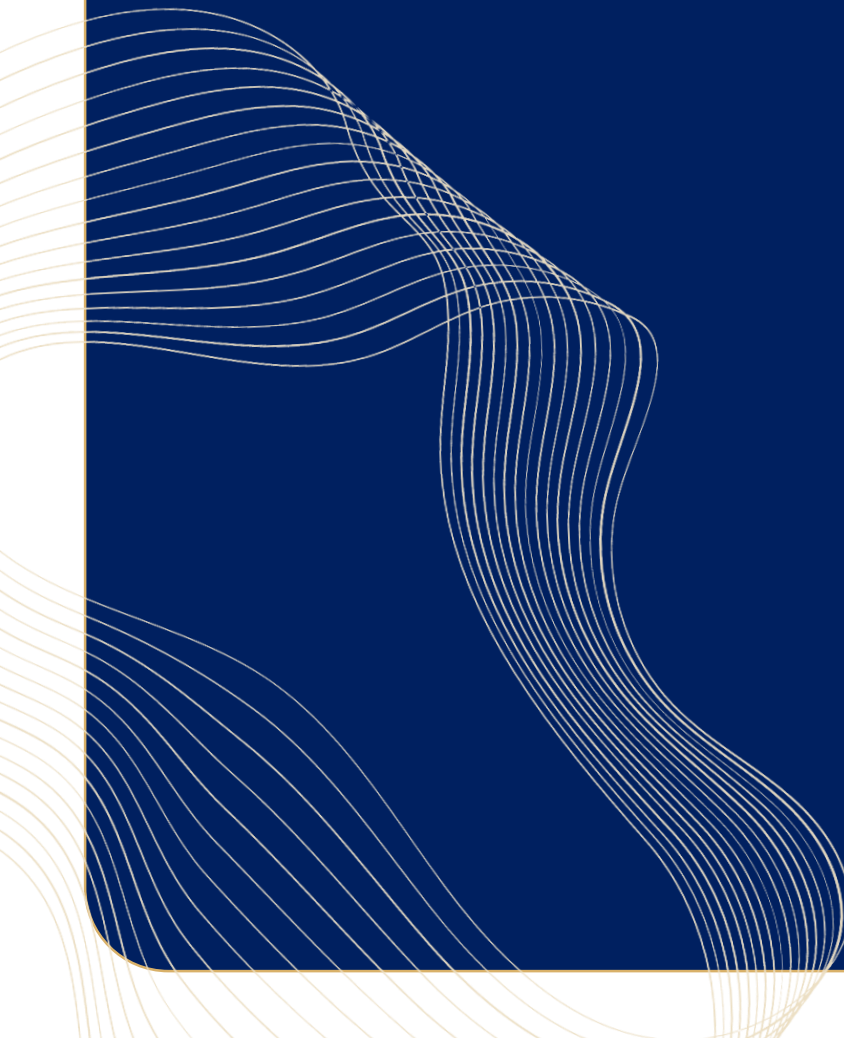
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی ها

صورت خالص دارایی ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۹
دارایی ها :		
دارایی ها :		
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۶۴,۷۱۲,۳۷۵	۵۹,۷۷۸,۲۵۳
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۴۴۵,۳۲۶	۵۶۱,۳۸۷
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۷۸۰,۸۴۳	۴,۶۷۷,۸۹۳
سرمایه گذاری در واحد صندوق های سرمایه گذاری	۱۲,۹۰۲,۳۲۱	۷۷۴,۶۷۹
حساب های دریافتی	۶,۵۱۰,۴۸۶	۲,۵۱۸,۴۱۱
سایر دارایی ها	۱۱,۵۱۱	۰
موجودی نقد	۱۲۳	۵۵
جاری کارگزاران و صندوق ها	۷۵۲,۴۳۸	۱۷,۱۱۹
جمع دارایی ها	۸۶,۱۱۵,۴۲۵	۶۸,۳۲۷,۷۹۶
بدهی ها :		
پرداختی به ارکان صندوق	۳۹۸,۰۲۷	۲۴۱,۶۹۰
سایر حساب های پرداختی و ذخایر	۲۴,۸۰۷	۱,۷۱۰
بدهی به سرمایه گذاران	۱۶۱	۶,۲۲۴
جمع بدهی ها	۴۲۲,۹۹۶	۲۴۹,۶۲۴
خالص دارایی ها	۸۵,۶۹۲,۴۲۹	۶۸,۰۷۸,۱۷۲
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۱,۱۴۹,۰۲۷	۹۶۵,۸۳۵



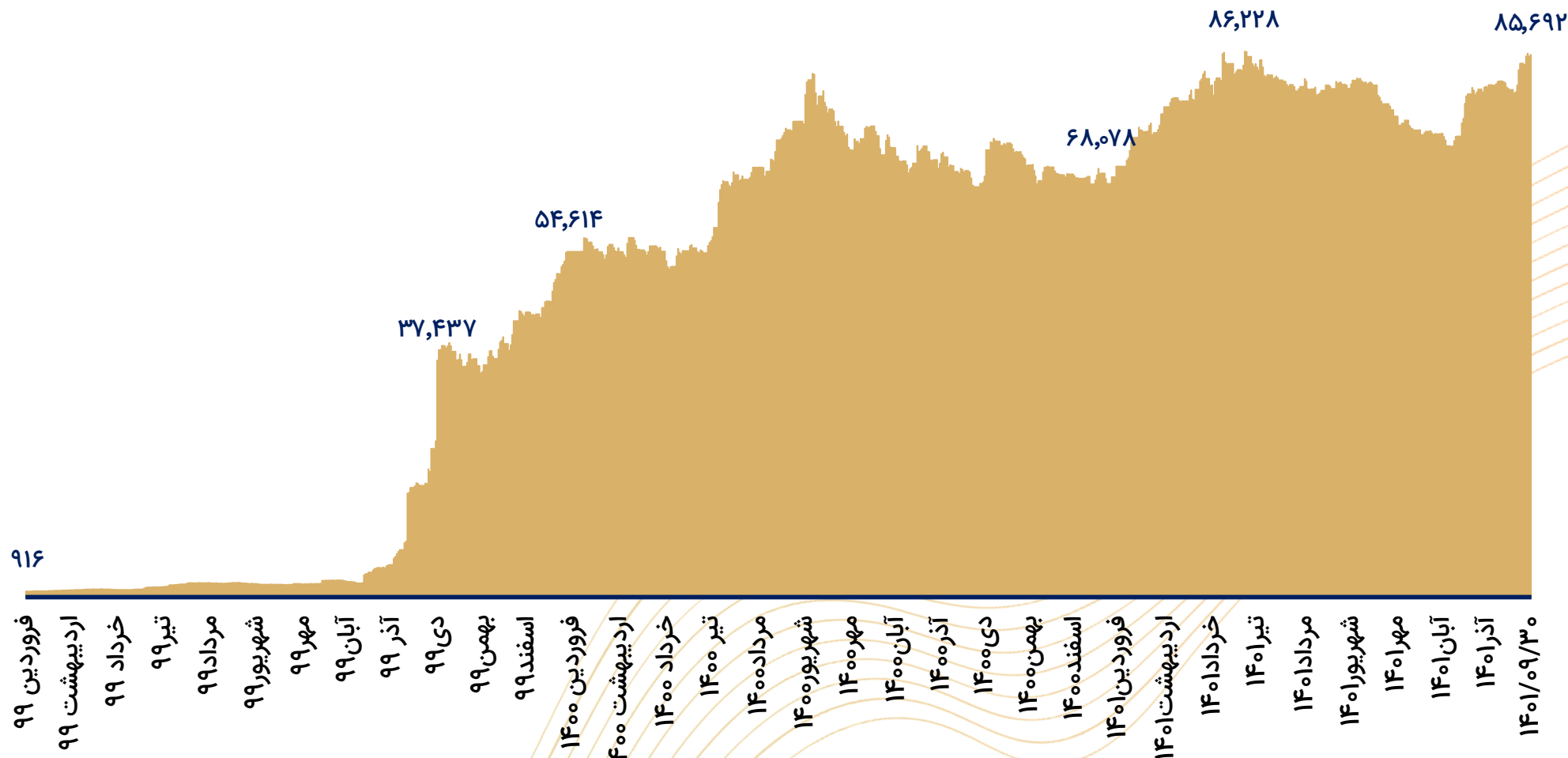
بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق



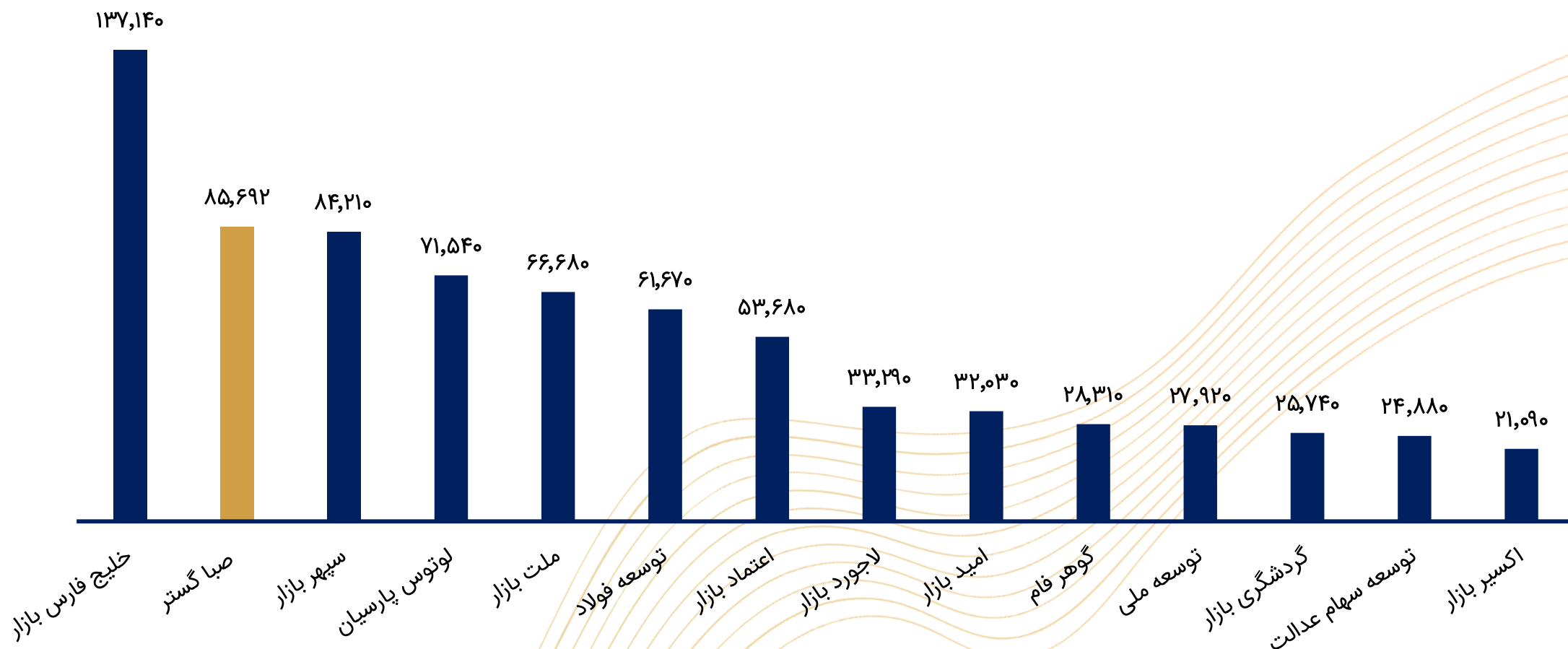
رند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

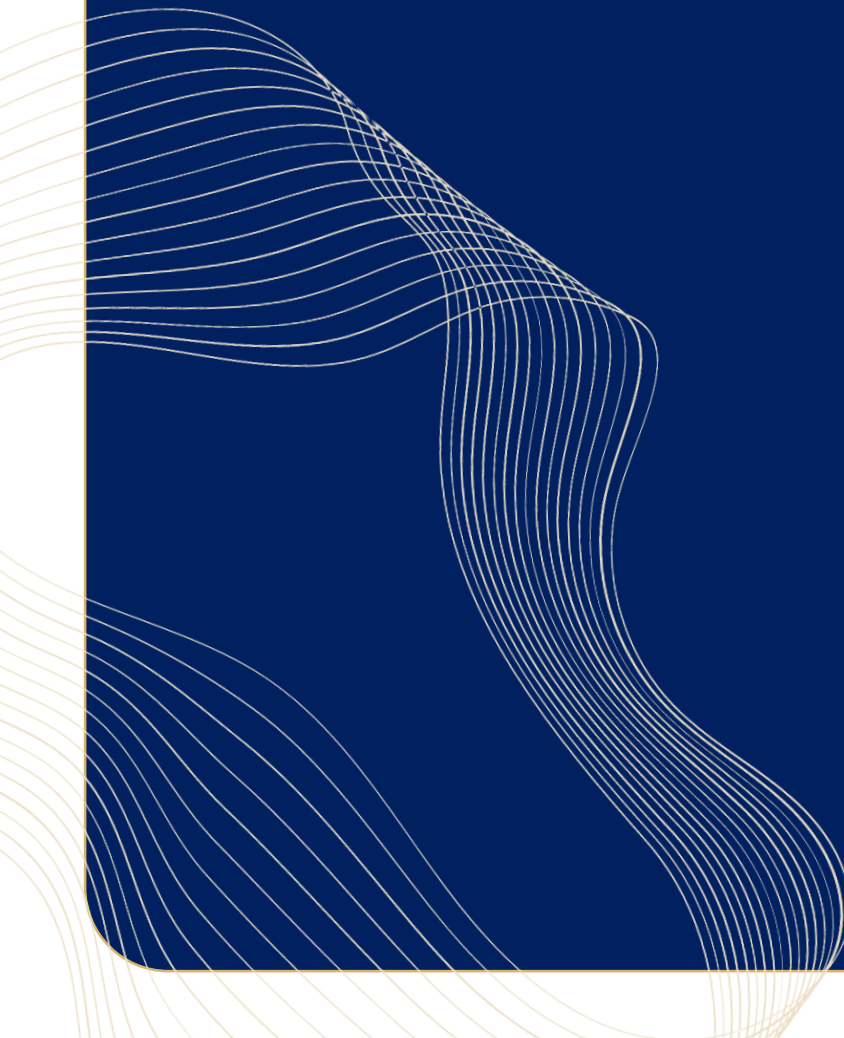
در تاریخ ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۸۵,۶۹۲ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰ **افزایش ۲۹ درصدی** را تجربه کرده است.



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

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (میلیارد ریال)





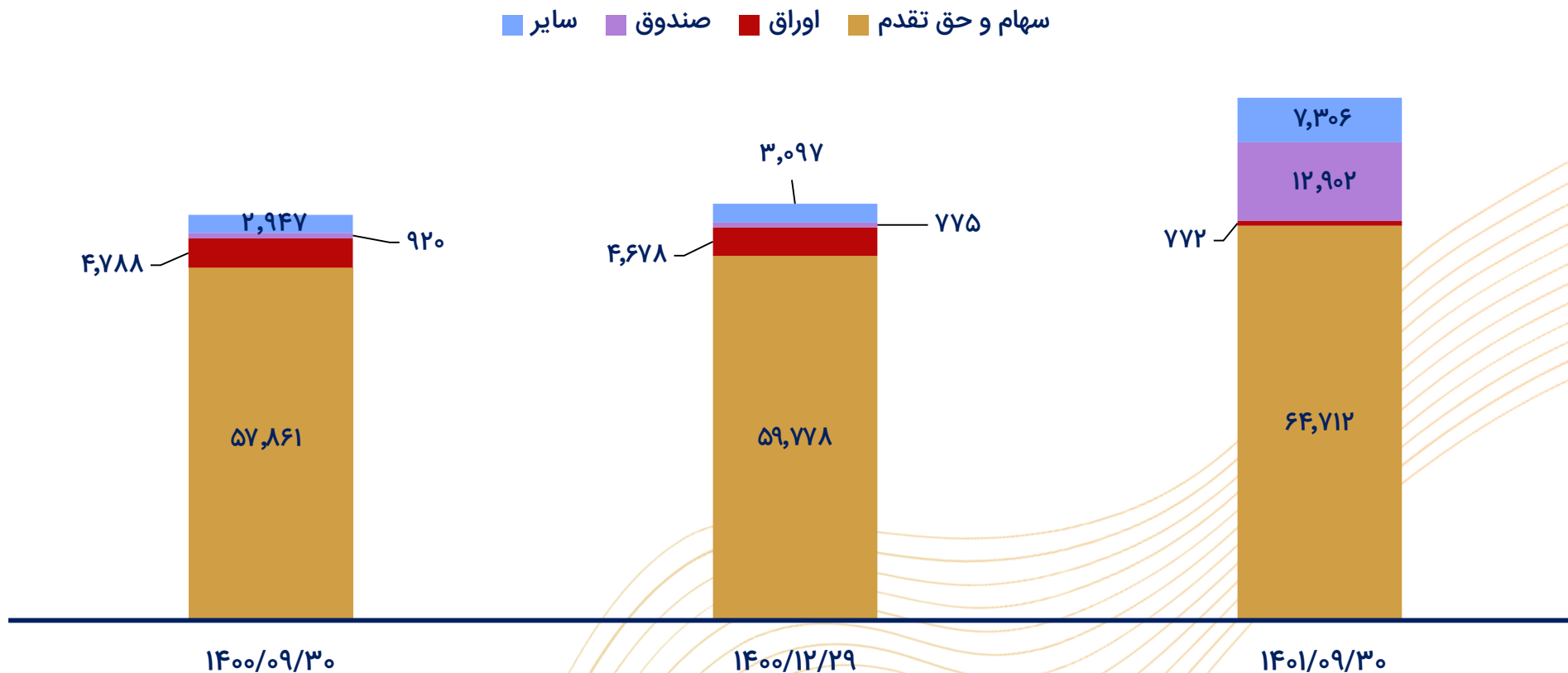
بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

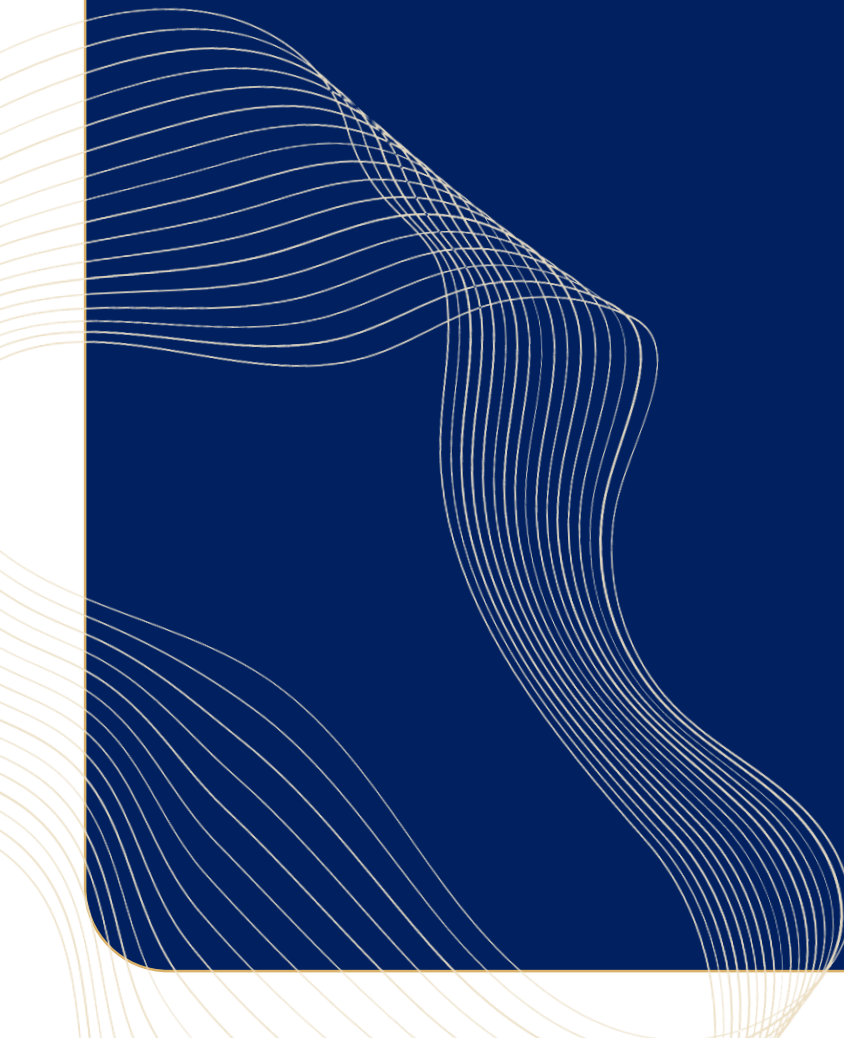


ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)



عمده (۸۹ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتی (سررسید نشده) می باشد که به تدریج از شرکتها وصول می گردد.



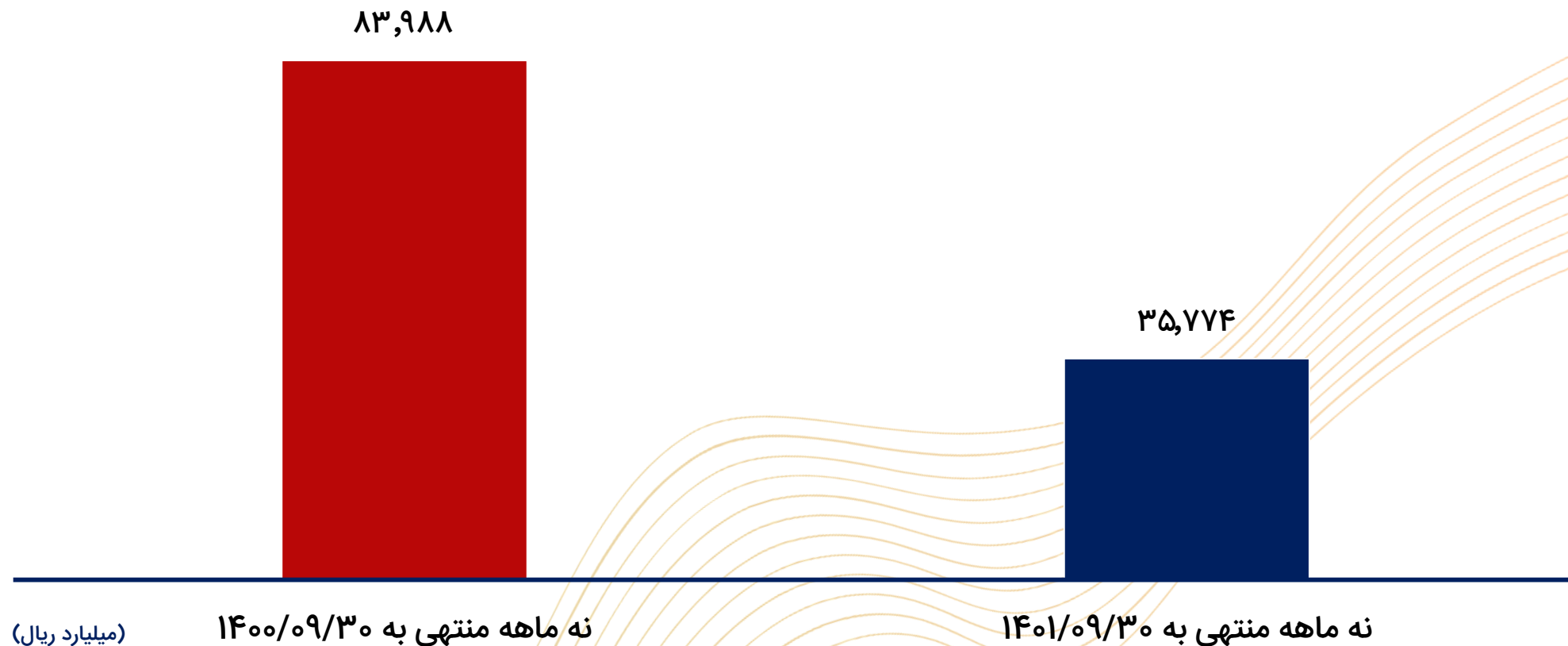
بخش هشتم:

معاملات سهام صندوق



ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر

با توجه به کاهش ارزش معاملات در بازار سرمایه، در نه ماهه سال ۱۴۰۱ نسبت به مدت مشابه سال گذشته ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر کاهش ۵۷ درصدی را تجربه کرده است

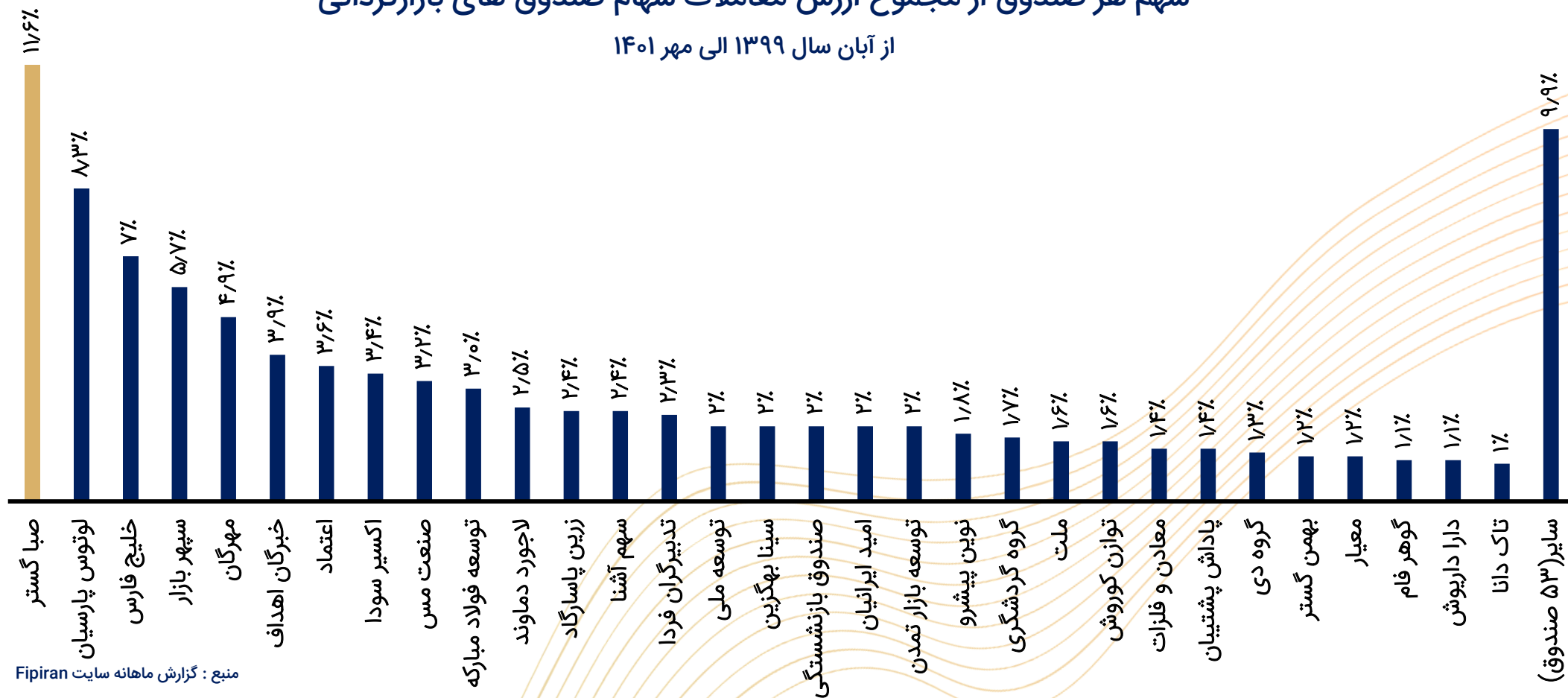


فعال ترین صندوق بازارگردانی سرمایه کشور

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

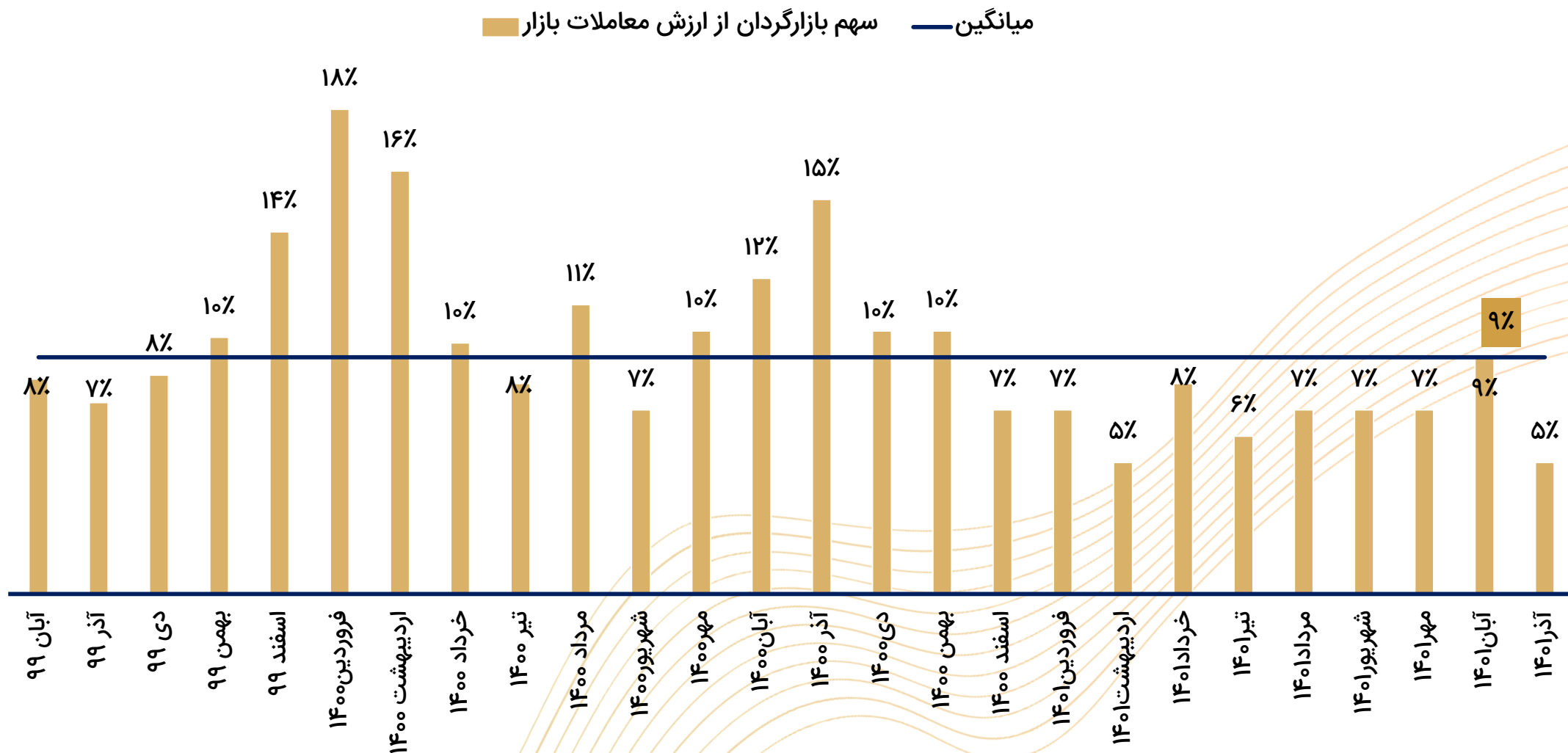
سهم هر صندوق از مجموع ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

از آبان سال ۱۳۹۹ الی مهر ۱۴۰۱



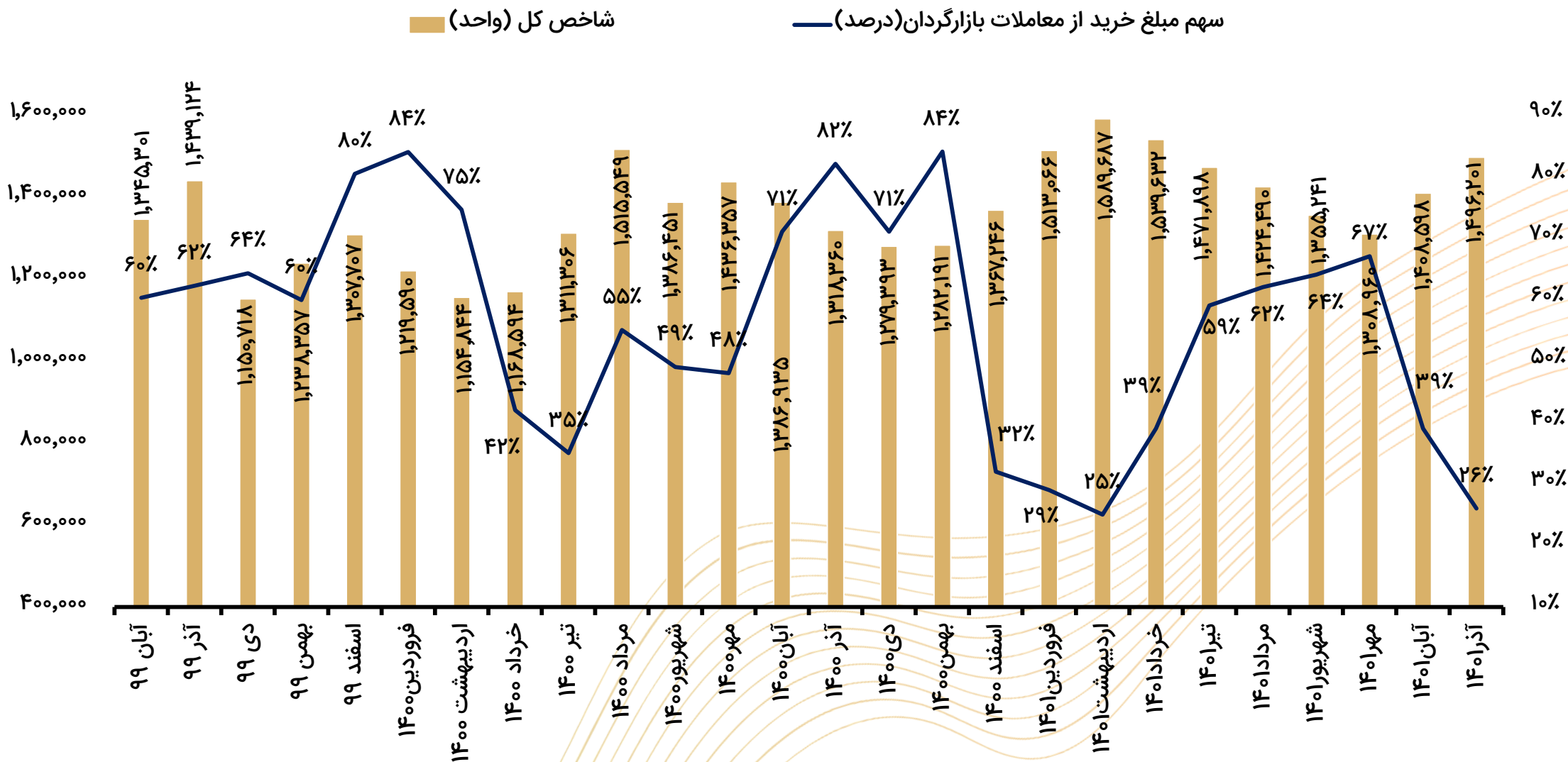
منبع : گزارش ماهانه سایت Fipiran

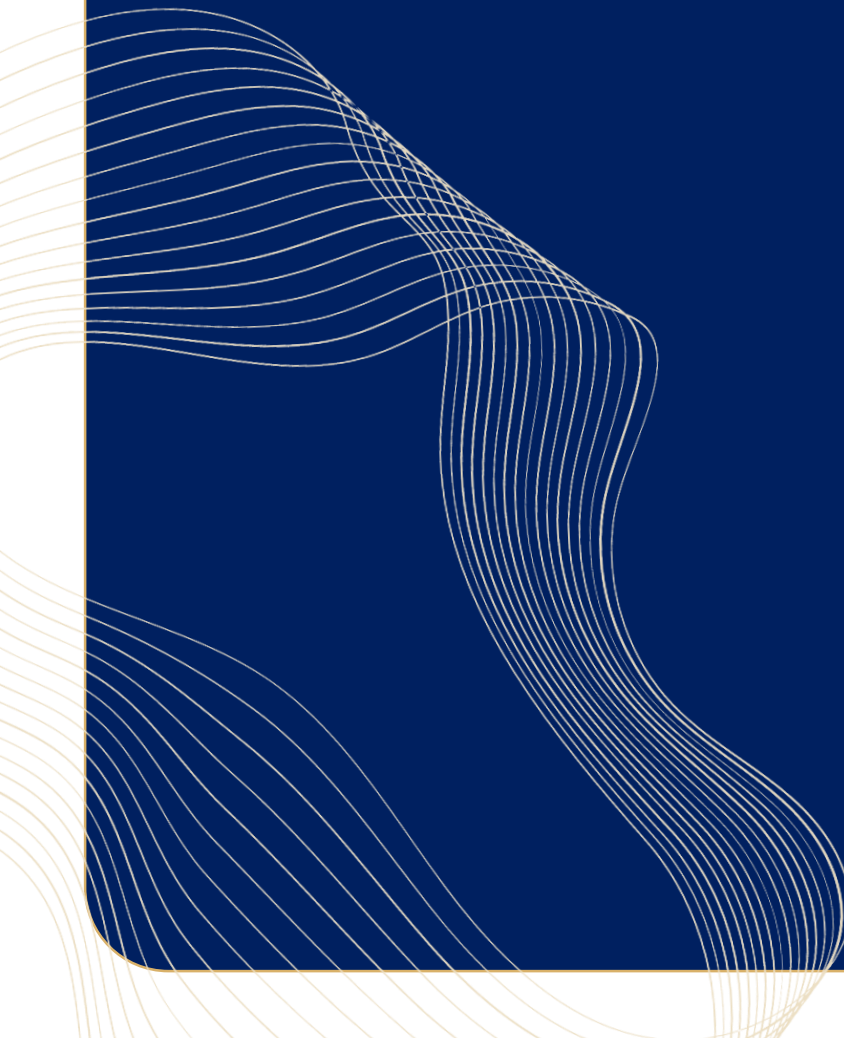
روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملاتی بازارگردانی





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 ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۲,۰۴۹	۲,۳۴۰	۴,۳۸۹	۴۷%	۴%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۴۲۲	۱,۳۵۳	۱,۷۷۵	۲۴%	۸%
سر. صبا تامین	صبا	۸۳۰	۹۳۳	۱,۷۶۳	۴۷%	۱۳%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۱۶۴	۳۹۶	۵۶۰	۲۹%	۴%
سر. سیمان تامین	سیتا	۱۹۷	۴۹۸	۶۹۵	۲۸%	۱۰%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۵۷	۹۳	۱۵۰	۳۸%	۲%
مجموع		۳,۷۱۹	۵,۶۱۴	۹,۳۳۳		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۲۲۵	۱۶۳	۳۸۸	۵۸%	۳%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۱۱۰	۹۴	۲۰۴	۵۴%	۳%
نفت پاسارگاد	شپاس	۵۰	۹۱	۱۴۱	۳۵%	۹%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۳۹۵	۵۵۳	۹۴۸	۴۲%	۷%
نفت ایرانول	شرانل	۱۱۷	۲۶۵	۳۸۲	۳۱%	۷%
صنعتی بارز	پکرمان	۲۱۸	۲۸۵	۵۰۳	۴۳%	۱۳%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۲۷	۲۲۳	۳۵۱	۳۶%	۷%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۱۵۸	۱۳۷	۲۹۵	۵۴%	۱۹%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۲۸۲	۳۰۶	۵۸۸	۴۸%	۱۳%
مجموع		۱,۶۸۲	۲,۱۱۸	۳,۷۹۹		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۹۷	۸۷	۱۸۴	۵۳%	۹%
مس باهنر	فباهنر	۴۲	۷۶	۱۱۸	۳۶%	۱%
معدنی املاح ایران	شاملا	۸۰	۸۱	۱۶۲	۵۰%	۵%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۲۳	۱۶۷	۲۹۰	۴۲%	۸%
کاشی سعدی	کسعدی	۴۹	۶۸	۱۱۷	۴۲%	۳%
کاشی الوند	کلوند	۱۵۳	۲۵۴	۴۰۷	۳۸%	۸%
زغال پرورده طبس	کزغال	۱۱۷	۳۸۰	۴۹۷	۲۴%	۵%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۲۹	۱۴۶	۲۷۵	۴۷%	۷%
لعبیران	شلعاب	۱۷۹	۱۹۴	۳۷۳	۴۸%	۸%
مجموع		۹۶۹	۱,۴۵۳	۲,۴۲۲		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	وېخش	۹۲	۶۳	۱۵۵	۶۰%	۷%
پارس دارو	دپارس	۵۷	۹۳	۱۵۰	۳۸%	۱۰%
دارو اکسیر	دلر	۶۳	۵۴	۱۱۷	۵۴%	۳%
دارو فارابی	دفارا	۴۲	۶۷	۱۱۰	۳۹%	۳%
داروسازی قاضی	دقاضی	۸۳	۱۰۰	۱۸۴	۴۵%	۹%
کارخانجات داروپخش	دارو	۵۴	۱۳۰	۱۸۴	۲۹%	۱۰%
دارو زهراوی	دزهراوی	۸۳	۹۸	۱۸۱	۴۶%	۵%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۷۹	۱۰۹	۱۸۷	۴۲%	۴%
دارو رازک	درازک	۱۱۹	۱۱۵	۲۳۴	۵۱%	۱۰%
پخش هجرت	هجرت	۵۳	۱۰۴	۱۵۷	۳۴%	۶%
مواد داروپخش	دتماد	۸۱	۱۰۰	۱۸۱	۴۵%	۵%
کلر پارس	کلر	۲۲۸	۲۰۲	۴۳۰	۵۳%	۴%
دارو ابوریحان	دابور	۷۷	۱۳۱	۲۰۹	۳۷%	۸%
کاسپین تامین	کاسپین	۱۱۷	۱۴۹	۲۶۶	۴۴%	۱۱%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۱۴	۲۷۳	۳۸۷	۳۰%	۱۰%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۲۹۱	۳۳۶	۶۲۶	۴۶%	۲۰%
شیرین دارو	دشیری	۱۱۸	۱۴۷	۲۶۶	۴۵%	۲۴%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۵۱	۸۶	۱۳۶	۳۷%	۲%
دارویی ره آورد تامین	درهآور	۹۱	۱۵۳	۲۴۴	۳۷%	۳%
مجموع		۱,۸۹۳	۲,۵۱۰	۴,۴۰۳		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۱۳۲	۱۷۴	۳۰۶	۴۳%	۳%
سیمان صوفیان	سصوفی	۱۰۲	۱۸۵	۲۸۷	۳۵%	۶%
سیمان ارومیه	ساروم	۱۴۲	۱۹۷	۳۳۸	۴۲%	۸%
سیمان قائن	سقاین	۲۷۰	۲۸۸	۵۵۸	۴۸%	۲۶%
سیمان شاهرود	سرود	۹۱	۱۲۸	۲۲۰	۴۲%	۸%
سیمان ساوه	ساوه	۲۹	۱۰۸	۱۳۷	۲۱%	۵%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۳۴	۲۱۵	۳۴۹	۳۸%	۷%
سیمان فارس	سفار	۲۷۷	۴۳۵	۷۱۲	۳۹%	۱۸%
سیمان خزر	سخزر	۱۷۶	۱۰۹	۲۸۵	۶۲%	۱۰%
سیمان فارس نو	سفانو	۱۲۸	۱۶۶	۲۹۴	۴۴%	۹%
سیمان بجنورد	سبجنو	۷۹	۱۰۱	۱۸۰	۴۴%	۱۰%
سیمان بهبهان	سبهان	۱۳۳	۱۳۷	۲۷۰	۴۹%	۹%
سیمان غرب	سغرب	۲۸۲	۲۲۵	۵۰۷	۵۶%	۱۳%
سیمان خاش	سخاش	۱۳۶	۱۱۱	۲۴۸	۵۵%	۱۰%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۲۲۴	۲۳۳	۴۵۷	۴۹%	۵%
سیمان دورود	سدور	۲۶۹	۳۱۱	۵۸۰	۴۶%	۱۶%
فارسیت اهواز	سفاسی	۹۲	۸۸	۱۸۰	۵۱%	۵%
سیمان آبیک	سآبیک	۴۷۰	۱,۹۸۰	۲,۴۴۹	۱۹%	۱۱%
مجموع		۳,۱۶۶	۵,۱۹۱	۸,۳۵۷		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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 الکتریک	لپارس	۹۷	۲۲۸	۳۲۵	۳۰%	۲%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۵۳	۸۷	۱۴۰	۳۸%	۲%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۲۲۵	۲۹۱	۵۱۷	۴۴%	۱۲%
کشت و دام گلدشت نمونه اصفهان	زگلدشت	۵۶	۱۱۳	۱۶۹	۳۳%	۳%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۱۱۹	۱۱۶	۲۳۴	۵۱%	۲۲%
مجموع		۵۵۰	۸۳۵	۱,۳۸۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۱۸۹	۱۷۲	۳۶۱	۵۲%	۱۱%
کربن ایران	شکرین	۳۲۲	۴۰۴	۷۲۵	۴۴%	۱۱%
لوله و گاز	پلوله	۲۲۲	۲۳۴	۴۵۶	۴۹%	۱۶%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۱۲۹	۱۷۸	۳۰۷	۴۲%	۸%
تکین کو	رتکو	۲۶	۵۷	۸۳	۳۱%	۱۴%
مجموع		۸۸۸	۱,۰۴۴	۱,۹۳۲		

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۹۴	۱۳۵	۲۲۹	۴۱%	۶%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۱۹۰	۲۲۰	۴۰۹	۴۶%	۹%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۲۲۴	۲۹۱	۵۱۵	۴۳%	۱۸%
مجموع		۵۰۷	۶۴۶	۱,۱۵۴		

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ (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	۳۰۶	۳۵۷	۶۶۲	۴۶%	۸%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۴۴۳	۵۰۵	۹۴۸	۴۷%	۴%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۴۱۳	۵۲۸	۹۴۲	۴۴%	۳۲%
سرمایه گذاری هامون صبا	وهامون	۱۰۰	۲۱۱	۳۱۱	۳۲%	۸%
مجموع		۱,۲۶۲	۱,۶۰۱	۲,۸۶۳		

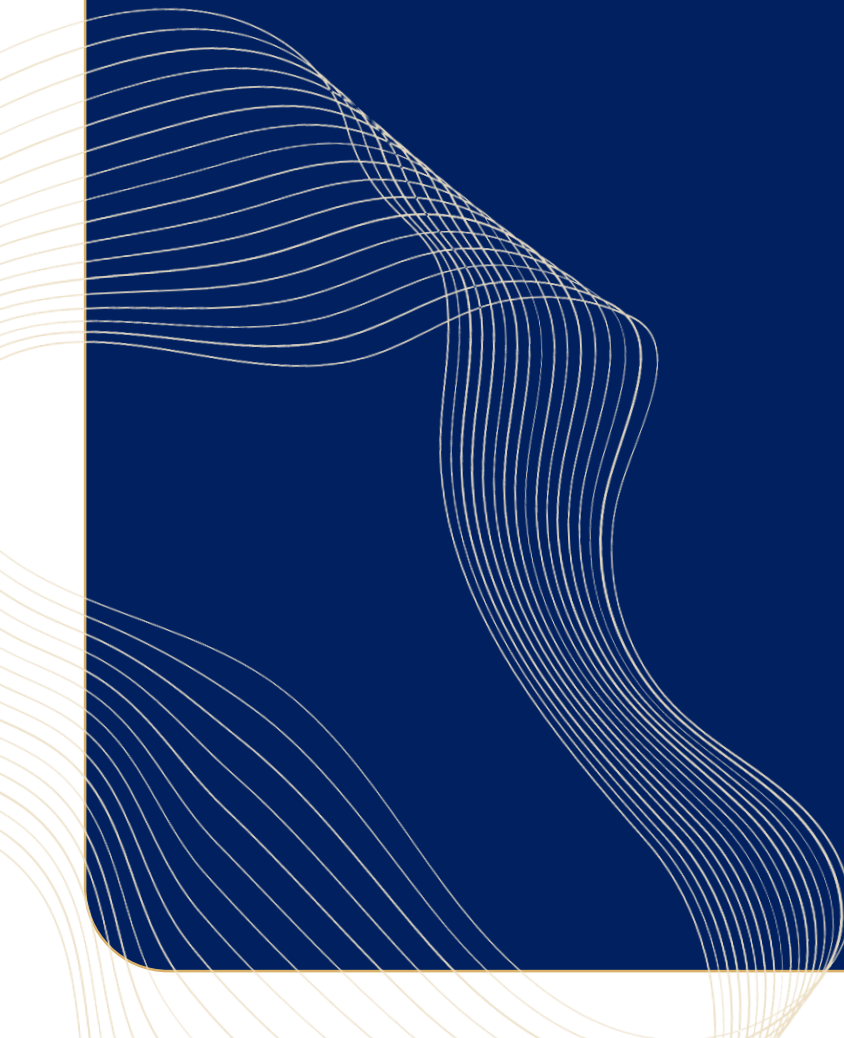
۳۱.۲ درصد میانگین بازدهی شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر

در نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

درحالیکه در نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ بازده شاخص کل ۹٪+ بوده است، **۶۴ نماد (۸۱ درصد)** از شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
دره‌آور	۱۳۴٪	لطیف	۵۷٪	شلعاب	۳۸٪	سیتا	۲۵٪	سغرب	۱۹٪	شاملا	۷٪
سفانو	۸۹٪	کلوند	۵۵٪	تاصیکو	۳۷٪	ساروم	۲۴٪	سرود	۱۷٪	شکبیر	۶٪
کپشیر	۸۶٪	دابور	۵۳٪	دپارس	۳۷٪	سفارس	۲۴٪	درازک	۱۷٪	صبا	۴٪
زملارد	۷۹٪	سفار	۵۰٪	مداران	۳۶٪	ددام	۲۴٪	دارو	۱۶٪	لخانه	۴٪
دکپسول	۷۷٪	وپخش	۴۶٪	فباهنر	۳۶٪	دقاضی	۲۳٪	ددر	۱۵٪	شپترو	۴٪
وپترو	۷۵٪	ساوه	۴۵٪	کفرا	۳۶٪	کخاک	۲۳٪	دتماد	۱۵٪	کدر	۳٪
زگلدشت	۶۹٪	سدور	۴۳٪	تیپیکو	۳۵٪	کاسپین	۲۲٪	دزهرای	۱۵٪	سقاین	۳٪
زفکا	۶۴٪	چکاو	۴۲٪	چخزر	۳۴٪	کسعدی	۲۲٪	شپاس	۱۳٪	شغدیر	-۴٪
دشیمی	۶۱٪	سقاش	۴۱٪	کزغال	۳۴٪	خراسان	۲۱٪	شستا	۱۰٪	دشیری	-۷٪
دتوزیع	۶۰٪	سخوز	۴۰٪	وهامون	۲۹٪	سفاسی	۲۱٪	سبجنو	۱۰٪	شفارا	-۱۹٪
هجرت	۶۰٪	سصوفی	۴۰٪	شدوص	۲۸٪	سآبیک	۲۱٪	پسهند	۱۰٪	لپارس	-۲۲٪
دفارا	۵۸٪	سخزر	۳۹٪	تاپیکو	۲۷٪	سنیر	۲۱٪	سبهان	۹٪	شفن	-۴۳٪
شرانل	۵۷٪	پلوله	۳۹٪	شکربن	۲۷٪	پکرمان	۱۹٪	شاوان	۸٪		



بخش دهم:

اهم اقدامات انجام شده و برنامه

های آتی صندوق

✓ **جایگزینی سرمایه گذاری در اوراق درآمد ثابت (با میانگین سود سالیانه ۱۸ درصد) با صندوق های ETF درآمد ثابت (با میانگین سود سالیانه ۲۳ درصد) :**

این رخداد موجب شد میانگین مجموع مانده روزانه سپرده بانکی صندوق از ۶۵۰ میلیارد ریال در نه ماهه سال ۱۴۰۰ به ۲۵۰ میلیارد ریال در نه ماهه سال ۱۴۰۱ کاهش یابد.

✓ **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 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

✓ افزایش تعداد نمادهای موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق های کالایی و ...

