



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صبا گستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

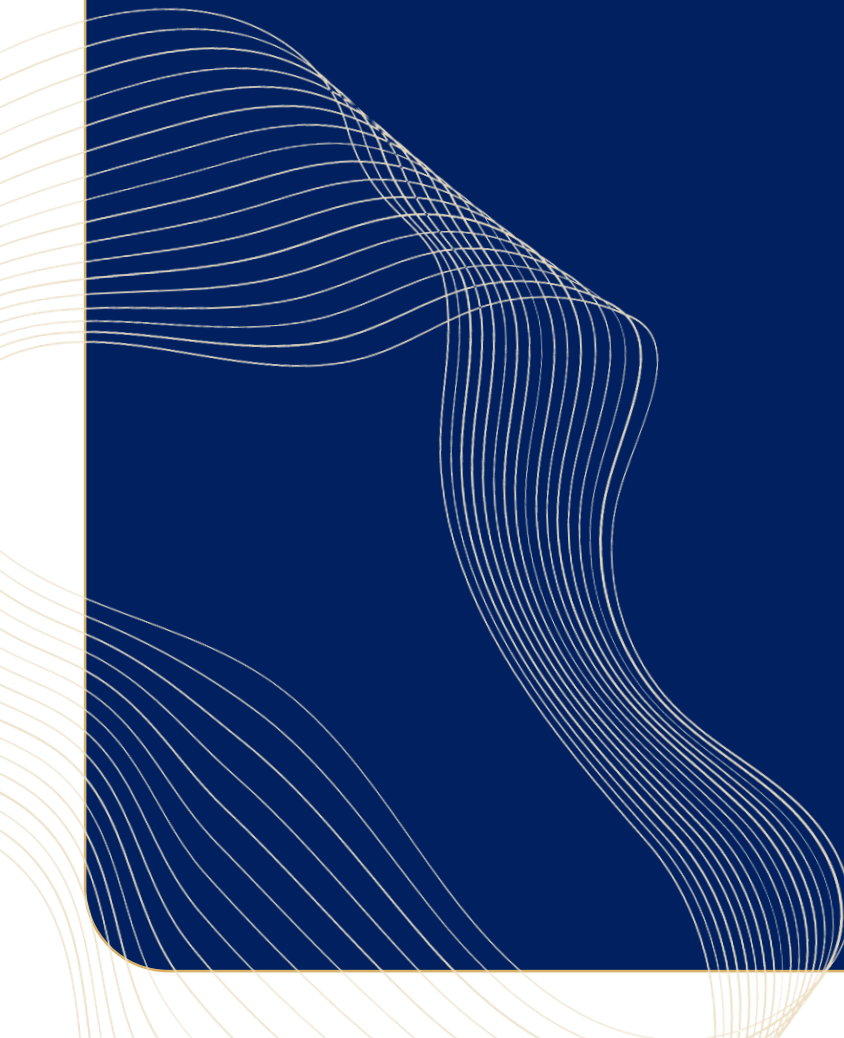
صندوق بازارگردانی صبا گستر نفت و گاز تامین

سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹



سبدگردان
اندیشه صبا

מסורת
מסורת



فهرست

مقدمه و معرفی

ارکان و واحد های سرمایه گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در سال منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

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

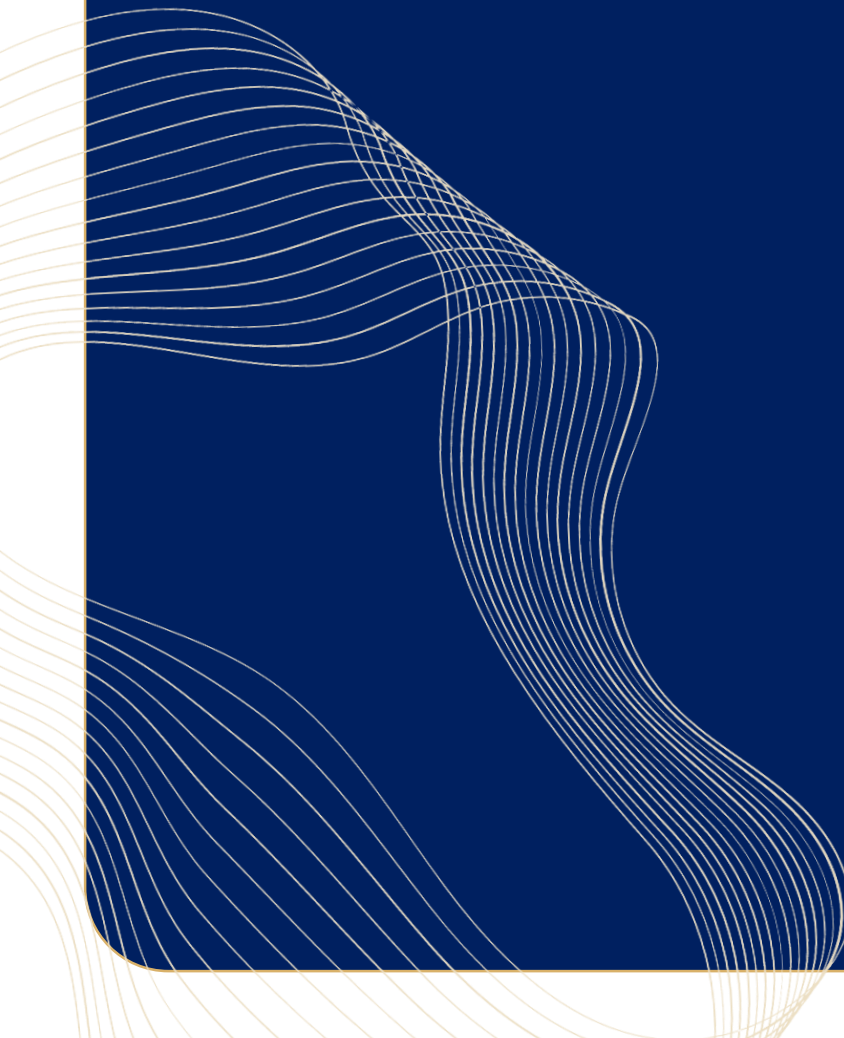
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه

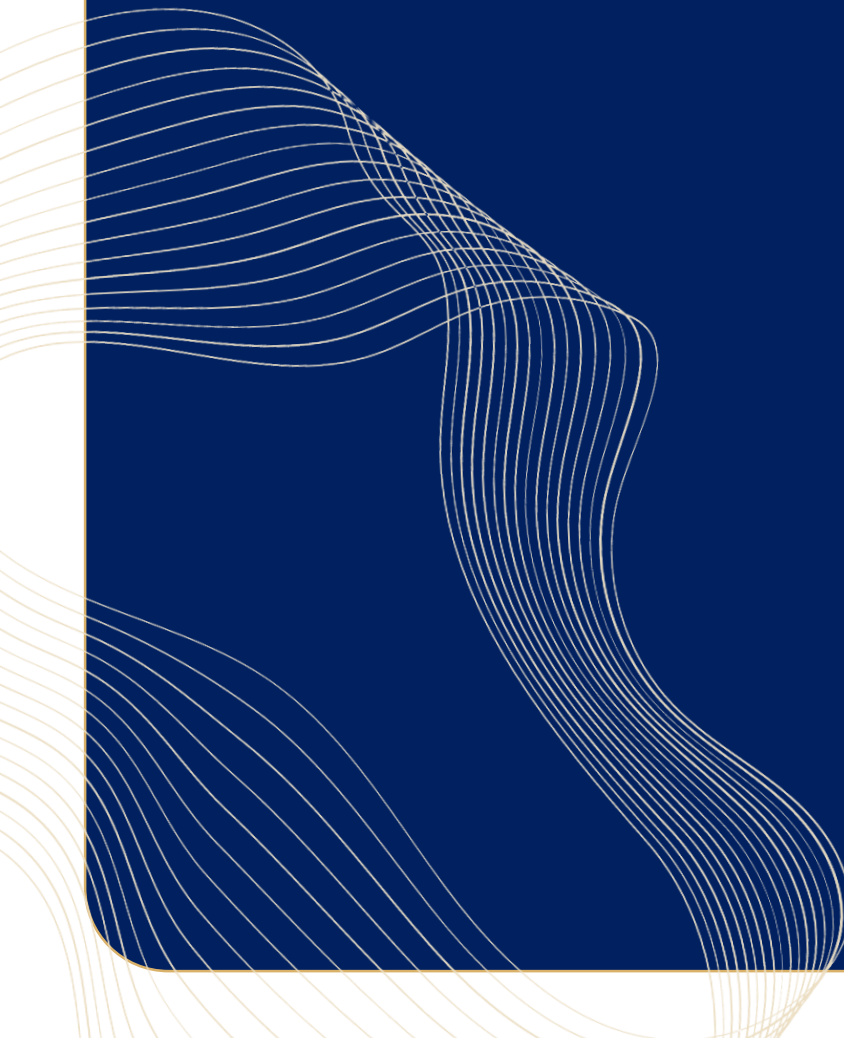
صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد. بلکه 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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۷۹ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازارسرمایه کشور از این حیث شناخته می شود.

در این تاریخ خالص ارزش دارایی های صندوق ۱۰۶,۱۴۷ میلیارد ریال می باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ افزایش ۵۶ درصدی داشته است.



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

رکن	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹
مدیر	سبدگردان اندیشه صبا	گروه مالی صبا تامین
متولی	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	موسسه حسابرسی دش و همکاران
کارگزار	کارگزاری صبا تامین	کارگزاری صبا تامین

واحدهای سرمایه گذاری صندوق

نوع واحد	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	سرمایه گذار
ممتاز	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	گروه مالی صبا تامین
ممتاز	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	سرمایه گذاری نفت، گاز و پتروشیمی تامین
ممتاز	۰	۸۹۶	سبدگردان اندیشه صبا
ممتاز	۸۹۶	۰	کارگزاری صبا تامین
ممتاز	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	مجموع واحدهای ممتاز
عادی	۷۰,۳۹۶,۶۹۶	۶۹,۴۶۱,۷۲۴	مجموع واحدهای عادی
عادی و ممتاز	۷۰,۴۸۶,۲۹۶	۶۹,۵۵۱,۳۲۴	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 :



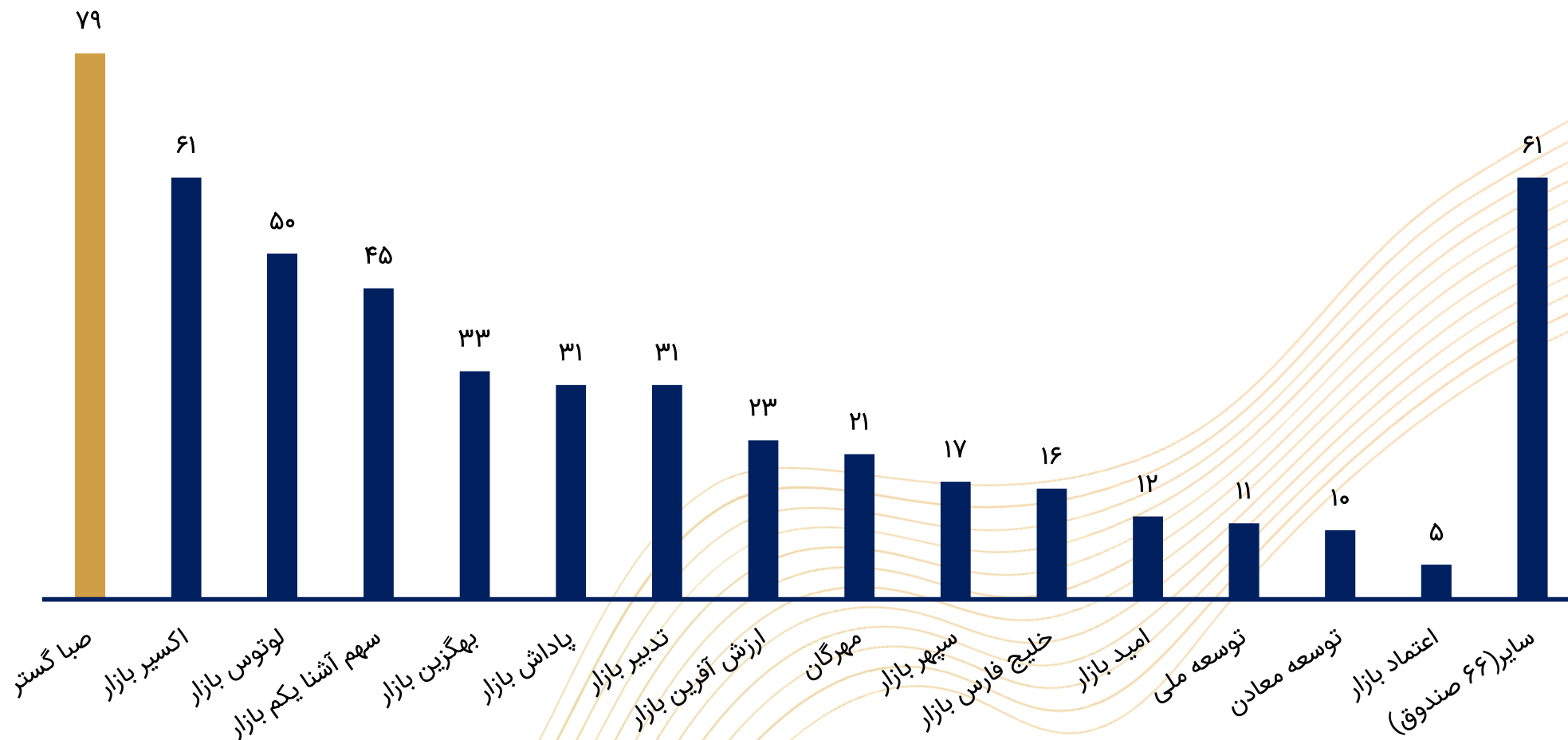


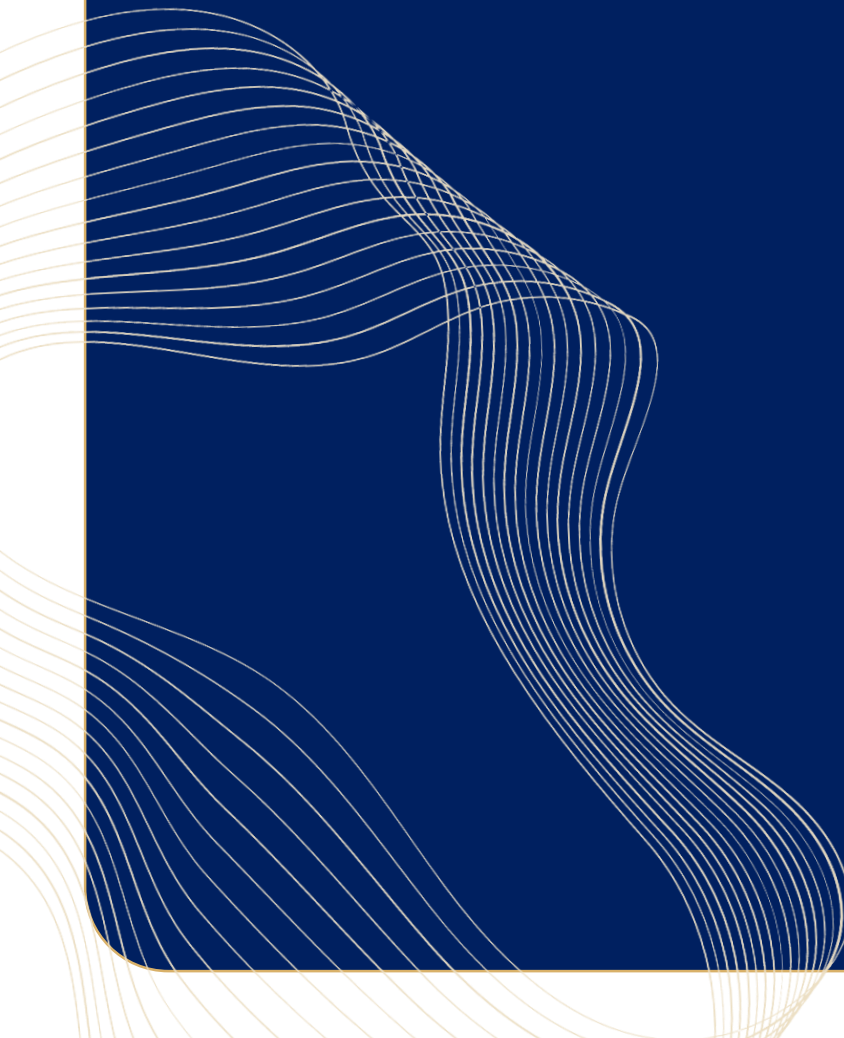
نمادهای موضوع بازارگردانی به تفکیک هلدینگ

هلدینگ	نماد				
هلدینگ شستا	شستا	تاپیکو	صبا	تاصیکو	سیتا
هلدینگ تاپیکو	شفن	خراسان	شپاس	شغدیر	شرانل
	وپترو	شفارا	شپترو		
هلدینگ تیپیکو	وپخش	دپارس	دلر	دفارا	دقاضی
	دزهرای	دتوزیع	درازک	هجرت	دتماد
	دابور	کاسپین	دشیمی	ددام	دشیری
	درهاور				
هلدینگ تاصیکو	کخاک	فباهنر	شاملا	کفرا	کسعدي
	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		
بانک رفاه	مداران	شاوان	شکبیر		
هلدینگ هگتا	آباد				
هلدینگ صبا تامین	وهامون	صندوق اوصتا	صندوق نفیس	صندوق دیبا	

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.





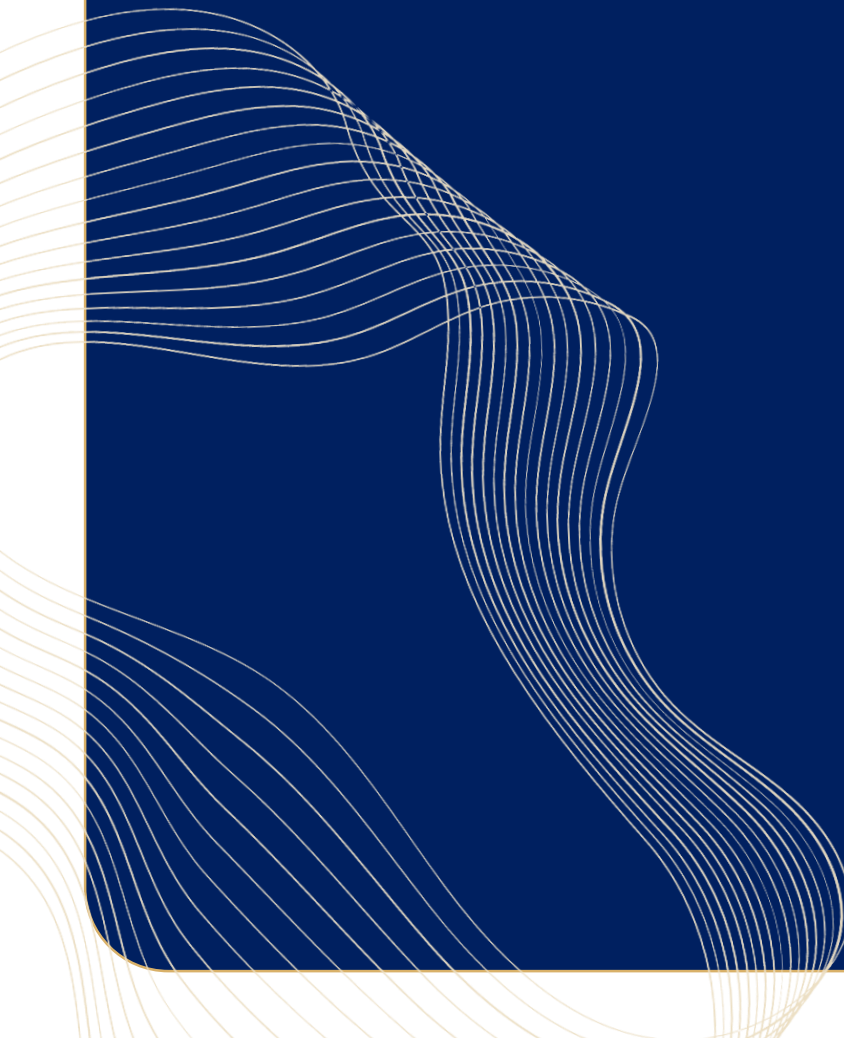
بخش چهارم:

صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹
درآمد ها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۵,۱۹۶,۵۷۹	۲۵۸,۶۶۹
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۲۵,۹۱۲,۳۵۹	(۸,۸۶۱,۶۱۸)
سود سهام	۸,۵۹۷,۳۸۳	۶,۸۳۴,۵۸۲
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۶۱۰,۹۶۶	۶۷۴,۶۳۶
سایر درآمدها	۷۴,۴۱۰	۱۲,۳۰۷
جمع درآمدها	۴۰,۳۹۱,۶۹۸	(۱,۰۸۱,۴۲۴)
هزینه ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۶۹۶,۷۰۲)	(۵۷۸,۵۰۰)
هزینه مالی	(۱۴۹,۹۶۷)	(۱۵۸,۱۲۶)
سایر هزینه ها	(۳۲,۵۷۰)	(۲,۵۵۲)
جمع هزینه ها	(۸۷۹,۲۳۹)	(۷۳۹,۱۷۸)
سود (زیان) خالص	۳۹,۵۱۲,۴۵۸	(۱,۸۲۰,۶۰۲)



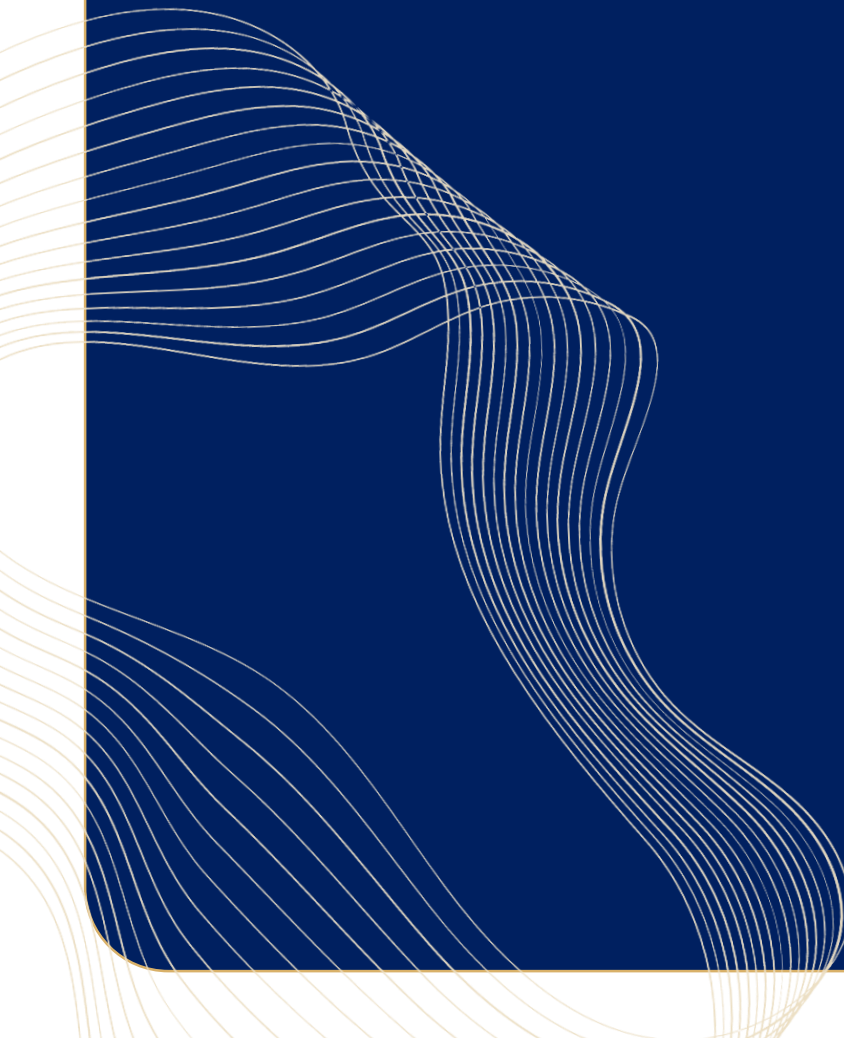
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی ها

صورت خالص دارایی ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱۴۰۰/۱۲/۲۹
دارایی ها :		
دارایی ها :		
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۷۹,۹۲۵,۵۳۳	۵۹,۷۷۸,۲۵۳
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۳۴۷,۶۱۸	۵۶۱,۳۸۷
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۳,۶۹۰,۲۷۱	۴,۶۷۷,۸۹۳
سرمایه گذاری در واحد صندوق های سرمایه گذاری	۱۶,۹۵۳,۲۹۶	۷۷۴,۶۷۹
حساب های دریافتی	۶,۱۰۸,۷۴۹	۲,۵۱۸,۴۱۱
سایر دارایی ها	۰	۰
موجودی نقد	۰	۵۵
جاری کارگزاران و صندوق ها	۸۳۹,۰۱۷	۱۷,۱۱۹
جمع دارایی ها	۱۰۷,۸۶۴,۴۸۵	۶۸,۳۲۷,۷۹۶
بدهی ها :		
پرداختی به ارکان صندوق	۱۹۹,۶۸۷	۲۴۱,۶۹۰
سایر حساب های پرداختی و ذخایر	۱۷,۶۰۳	۱,۷۱۰
بدهی به سرمایه گذاران	۱,۵۰۰,۱۶۱	۶,۲۲۴
جمع بدهی ها	۱,۷۱۷,۴۵۲	۲۴۹,۶۲۴
خالص دارایی ها	۱۰۶,۱۴۷,۰۳۴	۶۸,۰۷۸,۱۷۲
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۱,۵۲۶,۱۶۸	۹۶۵,۸۳۵



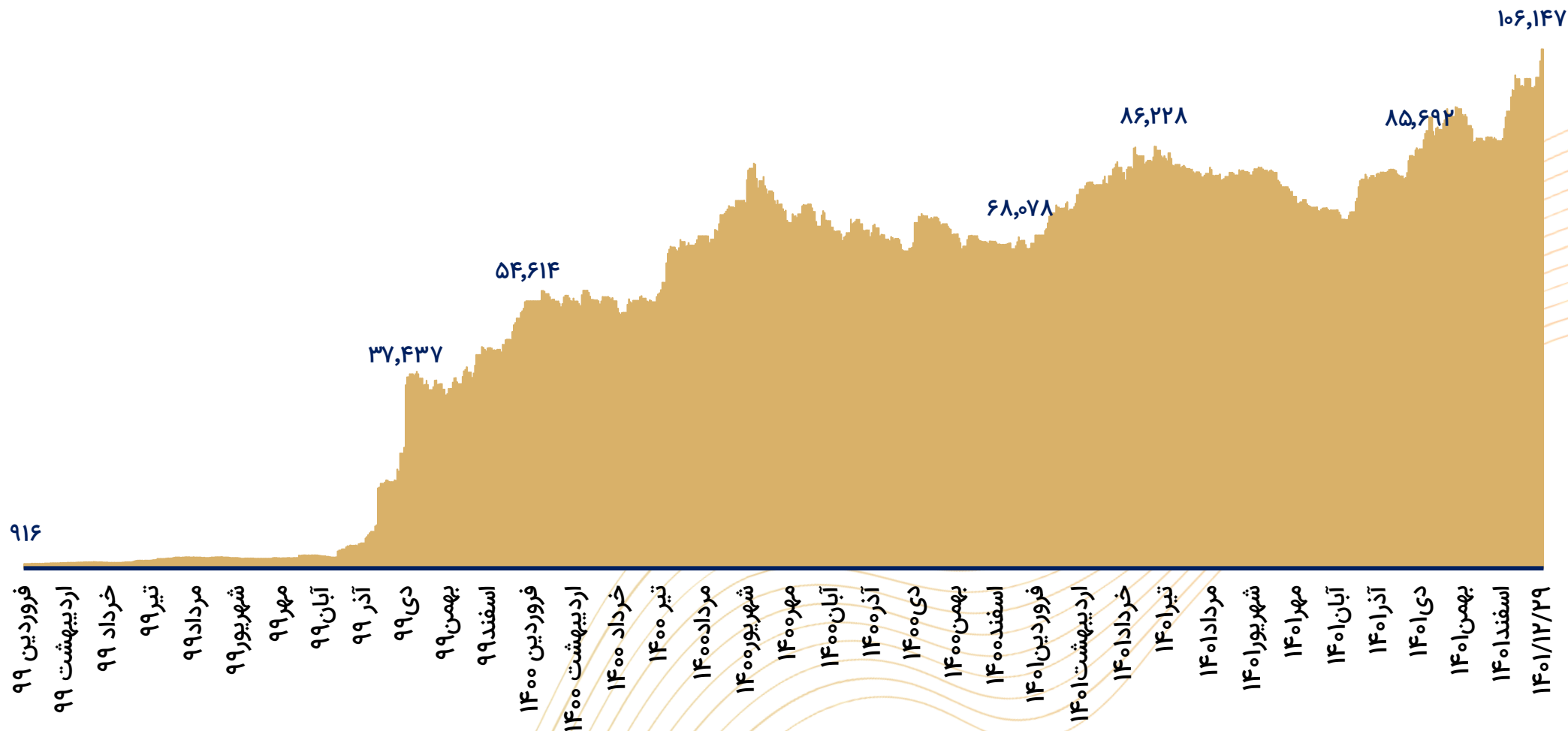
بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق



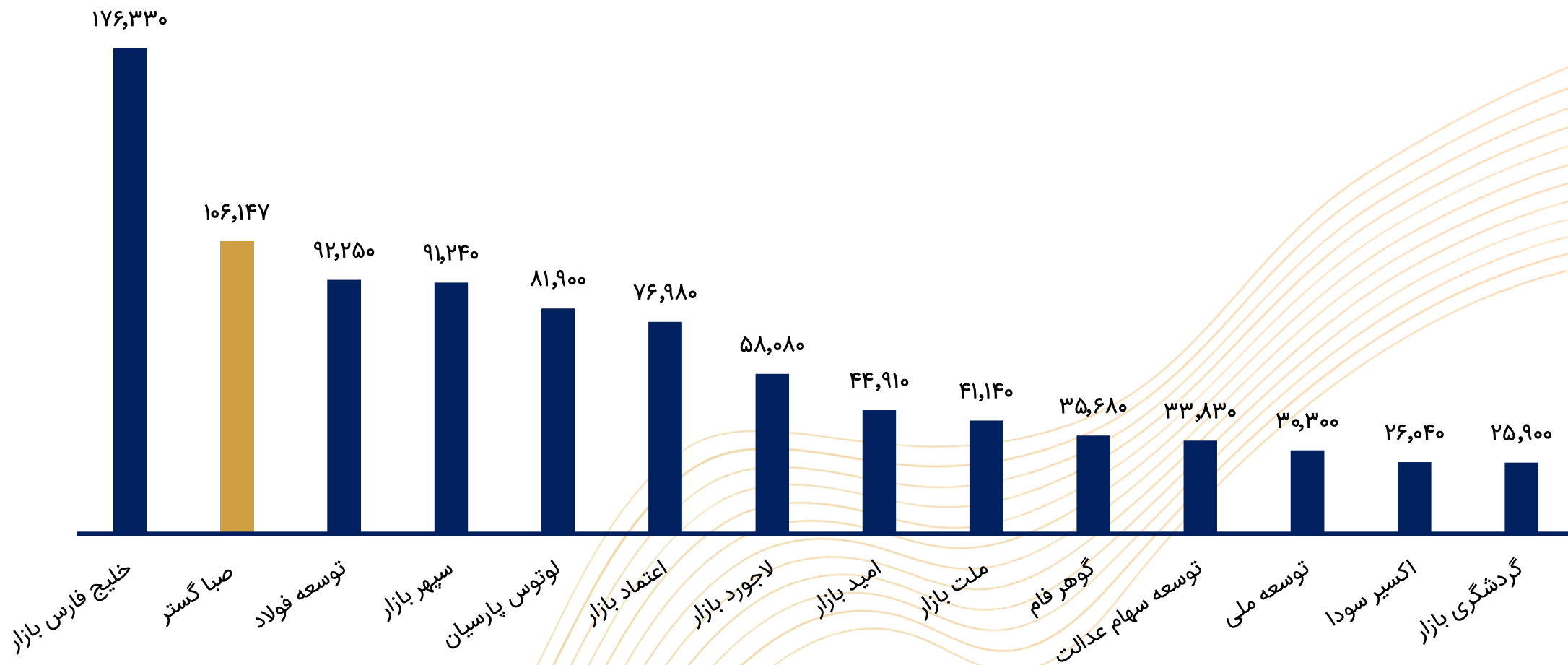
روند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

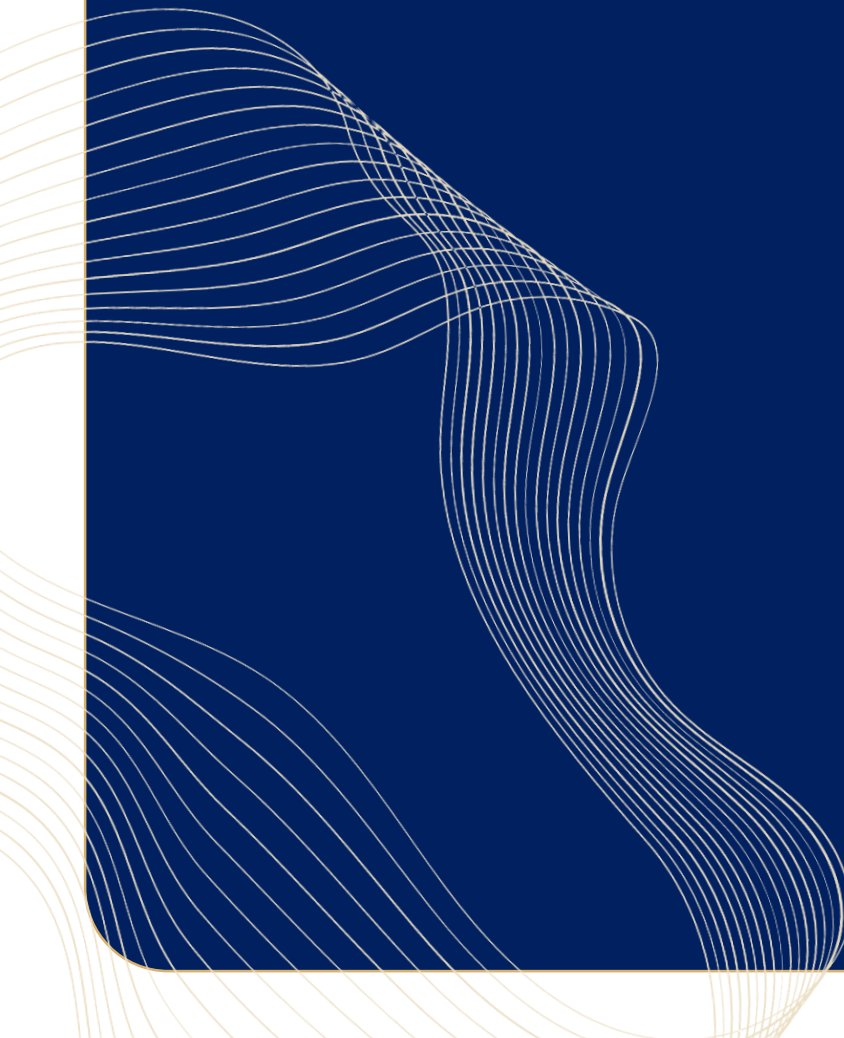
در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۱۰۶,۱۴۷ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹ **افزایش ۵۶ درصدی** را تجربه کرده است.



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

خالص ارزش دارایی هر صندوق بازارگردانی در ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (میلیارد ریال)





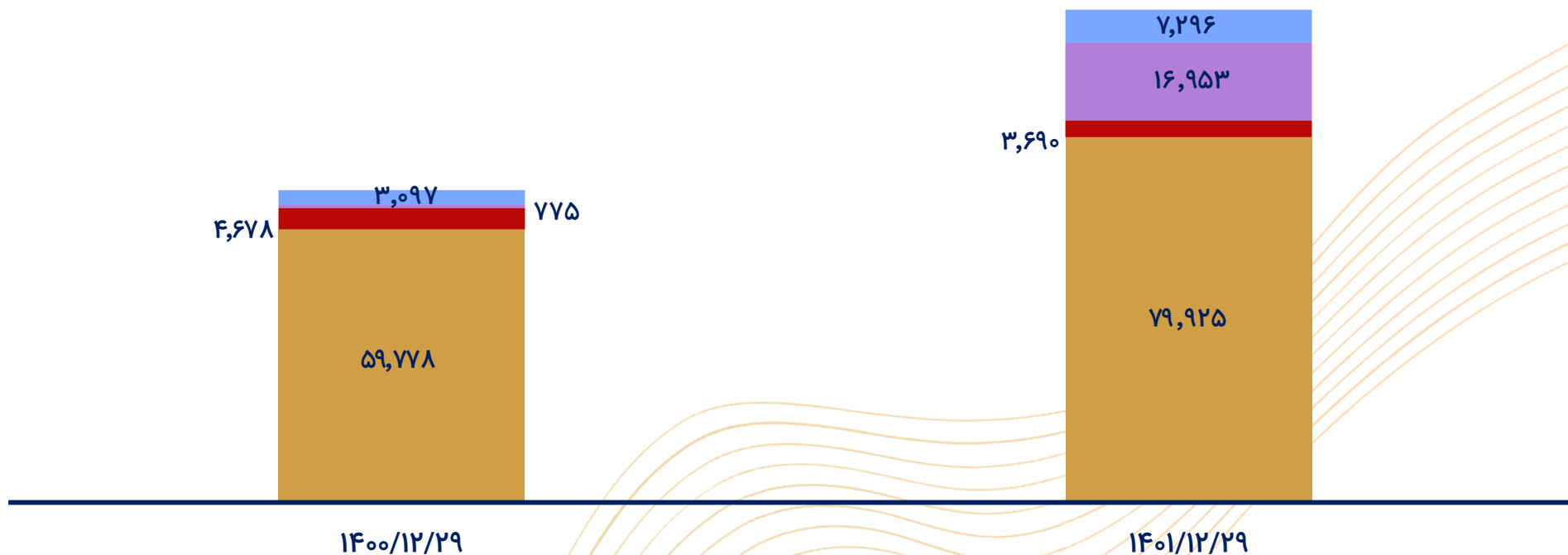
بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)

سهم و حق تقدم اوراق صندوق سایر



عمده (۸۴ 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

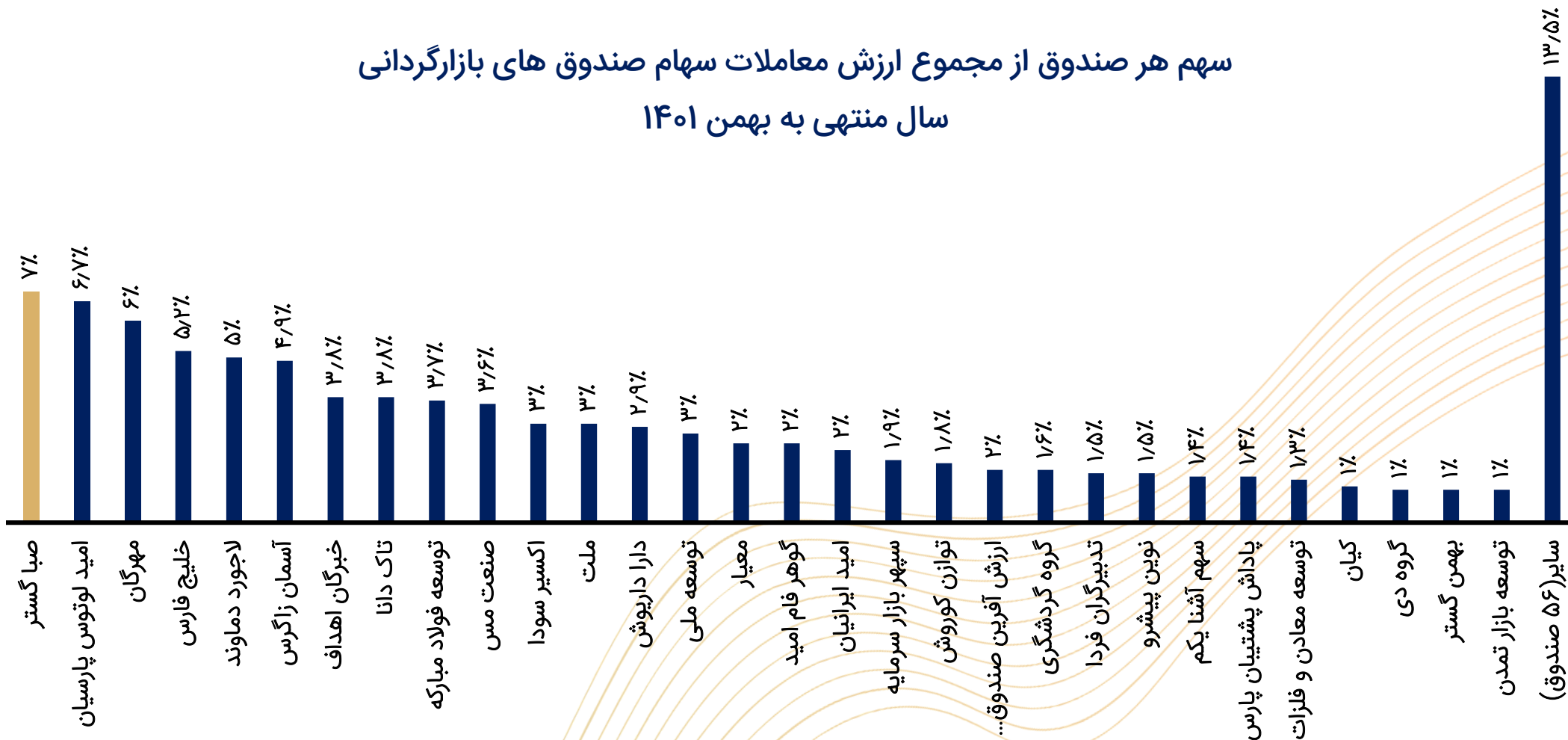
فعال ترین صندوق بازارگردانی بازار سرمایه کشور در سال ۱۴۰۱

با در اختیار داشتن سهم ۷ درصدی از کل ارزش معاملات سهام

صندوق های بازارگردانی کشور در سال ۱۴۰۱

سهم هر صندوق از مجموع ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

سال منتهی به بهمن ۱۴۰۱

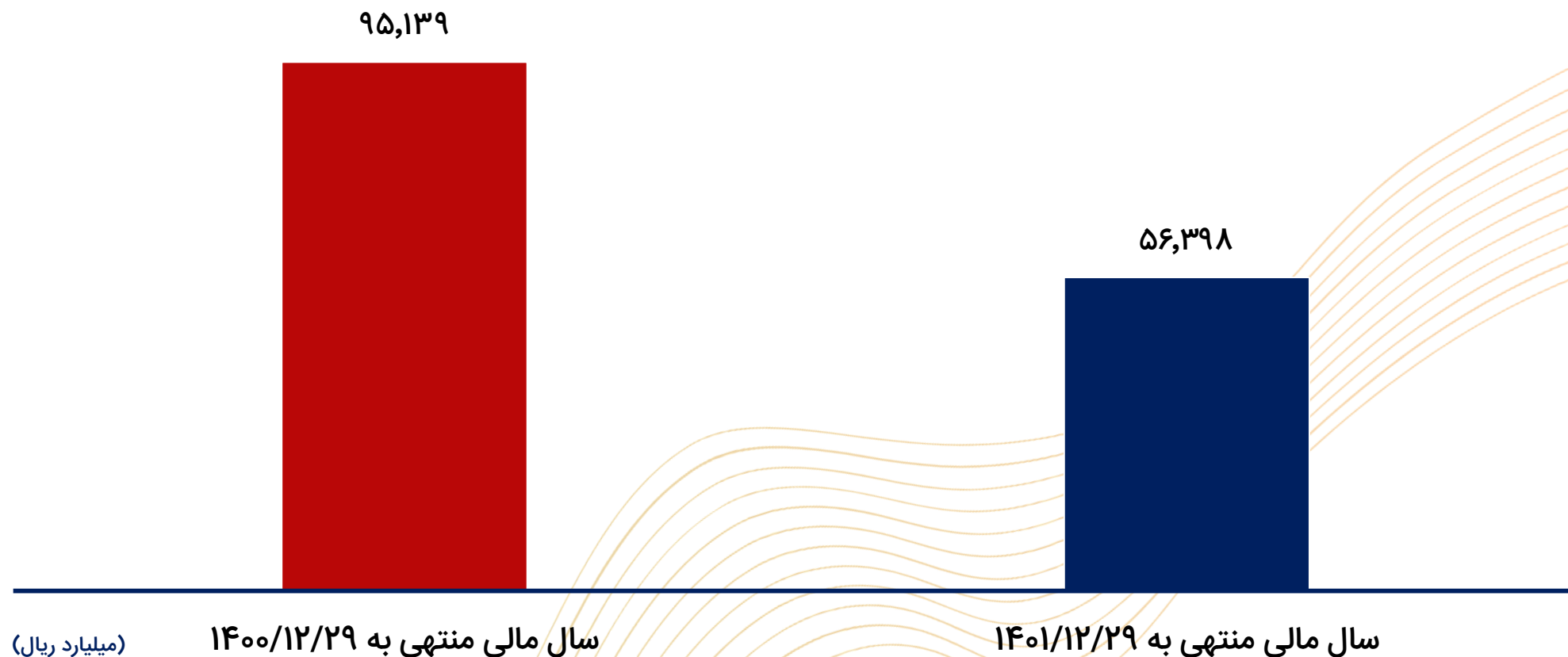


منبع : آخرین گزارش ماهانه عملکرد صندوق های سرمایه گذاری در سایت SEO.ir



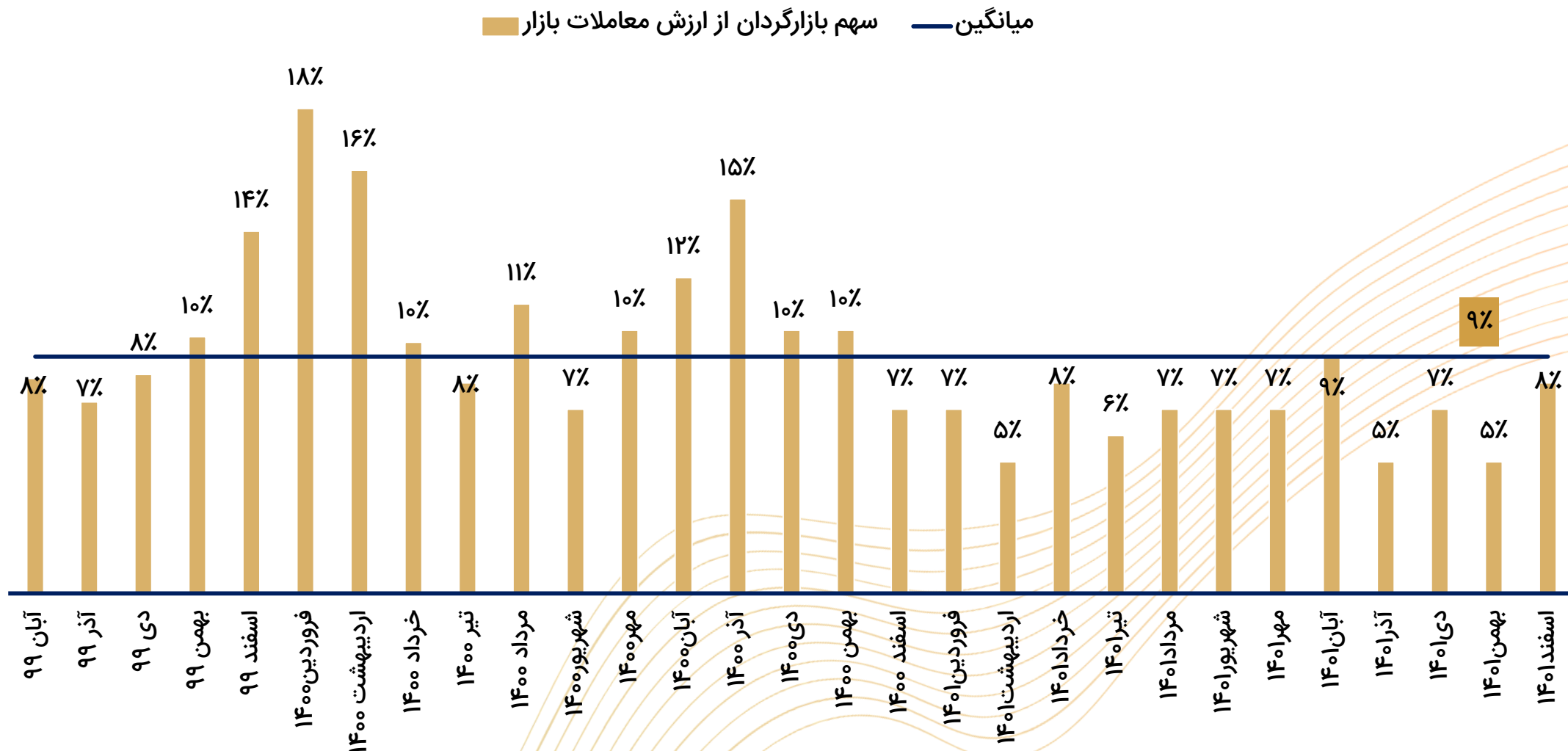
ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر

کاهش ارزش معاملات بازار سرمایه در سال ۱۴۰۱ نسبت به سال ۱۴۰۰ در کنار کاهش تعهدات بازارگردان از سوی بورس اوراق بهادار تهران در این سال، سبب شده در این دوره ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر کاهش ۴۱ درصدی را تجربه کرده است

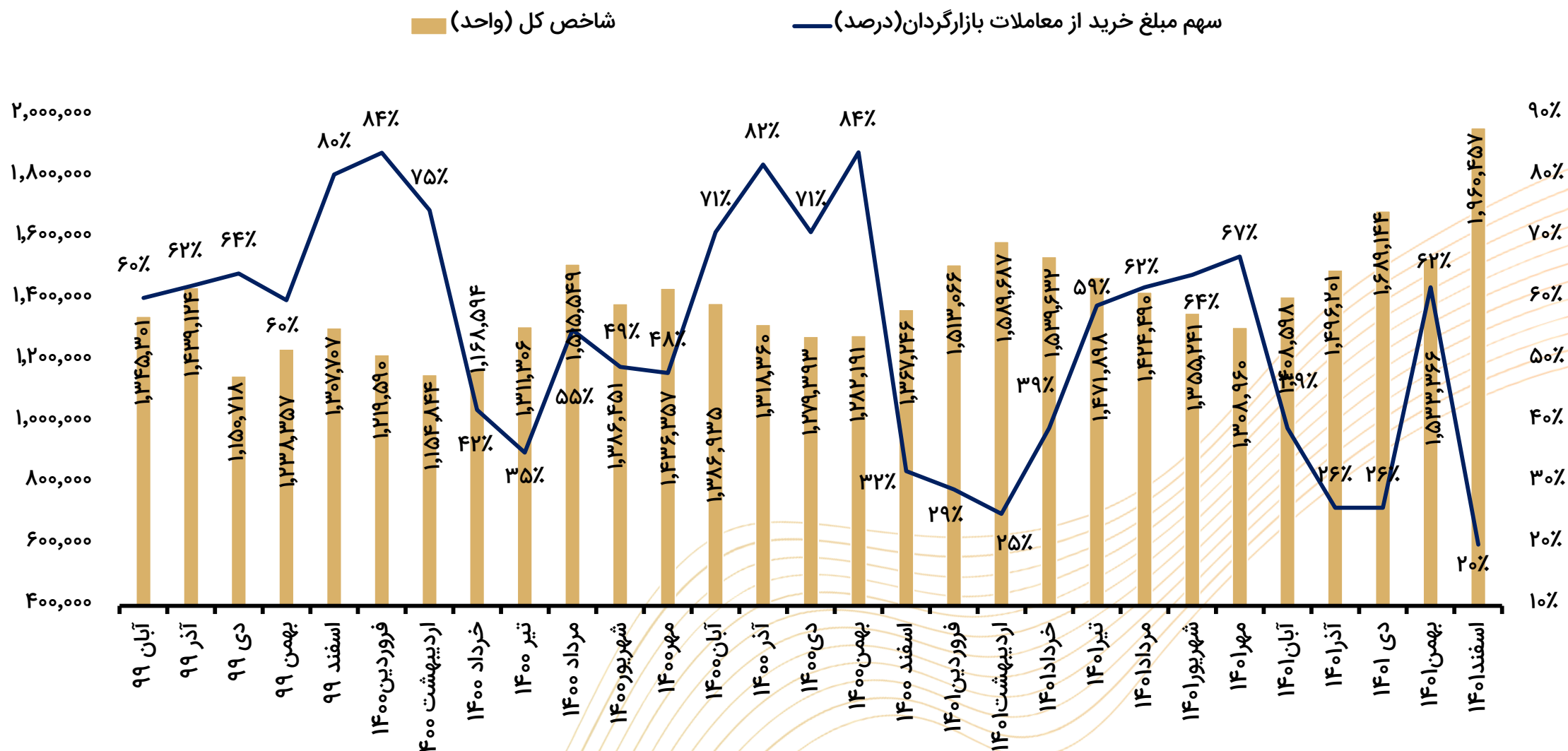


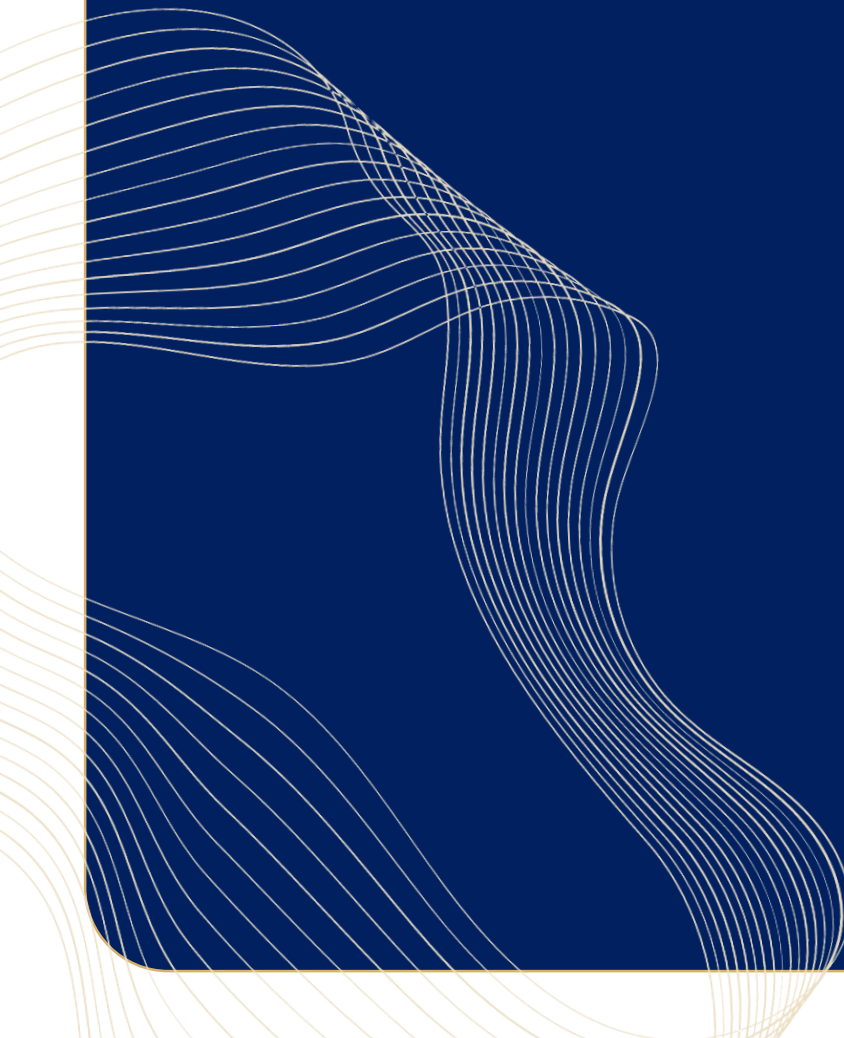


روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملاتی بازارگردانی



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 ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۲,۶۴۷	۷,۲۲۷	۹,۸۷۴	۲۷%	۵%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۵۷۰	۱,۷۲۴	۲,۲۹۵	۲۵%	۶%
سر. صبا تامین	صبا	۹۰۳	۲,۴۱۰	۳,۳۱۳	۲۷%	۱۷%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۲۲۷	۶۳۴	۸۶۱	۲۶%	۴%
سر. سیمان تامین	سیتا	۲۳۵	۶۴۰	۸۷۵	۲۷%	۹%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۸۹	۱۹۱	۲۸۰	۳۲%	۳%
مجموع		۴,۶۷۱	۱۲,۸۲۶	۱۷,۴۹۷		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۲۹۹	۲۷۵	۵۷۴	۵۲%	۳%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۱۴۵	۱۵۴	۲۹۹	۴۹%	۲%
نفت پاسارگاد	شپاس	۱۰۱	۱۸۰	۲۸۱	۳۶%	۱۱%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۴۹۷	۹۱۵	۱,۴۱۲	۳۵%	۷%
نفت ایرانول	شرانل	۱۵۹	۵۰۴	۶۶۳	۲۴%	۸%
صنعتی بارز	پکرمان	۲۵۱	۳۷۰	۶۲۱	۴۰%	۱۱%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۶۵	۳۰۴	۴۶۹	۳۵%	۵%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۳۳۹	۳۴۲	۶۸۱	۵۰%	۱۹%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۴۲۲	۴۴۷	۸۶۹	۴۹%	۱۱%
مجموع		۲,۳۷۸	۳,۴۹۱	۵,۸۶۹		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۱۴۱	۱۵۹	۳۰۱	۴۷%	۸%
مس باهنر	فباهنر	۷۸	۱۱۸	۱۹۶	۴۰%	۱%
معدنی املاح ایران	شاملا	۱۲۱	۱۹۵	۳۱۶	۳۸%	۵%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۶۵	۲۷۵	۴۴۰	۳۸%	۸%
کاشی سعدی	کسعدی	۹۳	۱۳۱	۲۲۴	۴۱%	۴%
کاشی الوند	کلوند	۲۱۸	۳۵۰	۵۶۸	۳۸%	۶%
زغال پرورده طبس	کزغال	۱۹۷	۶۳۹	۸۳۵	۲۴%	۵%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۸۲	۲۰۲	۳۸۴	۴۷%	۶%
لعبیران	شلعاب	۲۳۴	۲۴۸	۴۸۲	۴۹%	۵%
مجموع		۱,۴۲۹	۲,۳۱۶	۳,۷۴۵		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۱۱۷	۹۷	۲۱۴	۵۵%	۷%
پارس دارو	دپارس	۸۲	۱۹۲	۲۷۵	۳۰%	۹%
دارو اکسیر	دلر	۸۸	۱۷۴	۲۶۳	۳۴%	۴%
دارو فارابی	دفارا	۶۳	۱۴۳	۲۰۵	۳۰%	۲%
داروسازی قاضی	دقاضی	۱۳۷	۱۷۳	۳۱۱	۴۴%	۱۳%
کارخانجات داروپخش	دارو	۸۷	۲۵۸	۳۴۵	۲۵%	۹%
دارو زهراوی	دزهراوی	۱۰۶	۱۴۳	۲۴۹	۴۳%	۴%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۱۱۲	۱۶۳	۲۷۵	۴۱%	۴%
دارو رازک	درازک	۱۴۸	۲۳۷	۳۸۵	۳۸%	۵%
پخش هجرت	هجرت	۸۶	۱۹۷	۲۸۳	۳۱%	۷%
مواد داروپخش	دتماد	۱۰۳	۱۴۲	۲۴۵	۴۲%	۴%
کلر پارس	کلر	۳۲۰	۳۱۱	۶۳۱	۵۱%	۴%
دارو ابوریحان	دابور	۱۰۱	۱۸۳	۲۸۴	۳۶%	۸%
کاسپین تامین	کاسپین	۱۴۷	۲۰۰	۳۴۷	۴۲%	۱۰%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۶۴	۳۲۳	۴۸۶	۳۴%	۸%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۳۰۹	۳۶۹	۶۷۹	۴۶%	۱۴%
شیرین دارو	دشیری	۲۱۴	۲۲۳	۴۳۷	۴۹%	۲۴%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۱۰۸	۱۵۲	۲۶۰	۴۱%	۳%
دارویی ره آورد تامین	دره‌آور	۲۸۴	۳۳۵	۶۲۰	۴۶%	۵%
مجموع		۲,۷۷۶	۴,۰۱۵	۶,۷۹۲		



خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۱۶۵	۳۱۹	۴۸۴	۳۴%	۲%
سیمان صوفیان	سصوفی	۱۸۱	۲۸۱	۴۶۱	۳۹%	۵%
سیمان ارومیه	ساروم	۱۸۴	۲۸۶	۴۷۰	۳۹%	۸%
سیمان قائن	سقاین	۲۹۳	۳۵۸	۶۵۱	۴۵%	۲۲%
سیمان شاهرود	سرود	۱۲۹	۲۲۷	۳۵۵	۳۶%	۷%
سیمان ساوه	ساوه	۱۰۷	۱۹۲	۲۹۹	۳۶%	۵%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۸۵	۲۹۸	۴۸۲	۳۸%	۶%
سیمان فارس	سفار	۳۵۵	۵۵۳	۹۰۸	۳۹%	۱۶%
سیمان خزر	سخزر	۲۵۱	۲۰۱	۴۵۱	۵۶%	۹%
سیمان فارس نو	سفانو	۱۶۰	۲۷۲	۴۳۳	۳۷%	۸%
سیمان بجنورد	سبجنو	۹۹	۱۵۸	۲۵۷	۳۹%	۹%
سیمان بهبهان	سبهان	۱۸۲	۲۲۲	۴۰۴	۴۵%	۷%
سیمان غرب	سغرب	۳۰۰	۲۸۲	۵۸۲	۵۲%	۱۱%
سیمان خاش	سخاش	۱۷۸	۱۴۷	۳۲۵	۵۵%	۹%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۳۰۰	۳۳۰	۶۳۰	۴۸%	۵%
سیمان دورود	سدور	۳۴۱	۴۱۳	۷۵۴	۴۵%	۱۲%
فارسیت اهواز	سفاسی	۱۴۲	۱۳۷	۲۷۹	۵۱%	۵%
سیمان آبیک	سآبیک	۵۱۷	۲,۳۷۳	۲,۸۹۰	۱۸%	۱۱%
مجموع		۴,۰۶۸	۷,۰۴۹	۱۱,۱۱۷		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۱۶۳	۳۳۸	۵۰۱	۳۳%	۲%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۱۴۰	۲۱۹	۳۵۹	۳۹%	۳%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۳۰۰	۳۶۰	۶۶۰	۴۵%	۱۱%
کشت و دام گلدهت نمونه اصفهان	زگلدهت	۱۵۴	۲۶۸	۴۲۲	۳۷%	۴%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۲۲۲	۲۶۱	۴۸۳	۴۶%	۱۷%
مجموع		۹۷۹	۱,۴۴۶	۲,۴۲۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۲۱۵	۲۲۷	۴۴۱	۴۹%	۱۰%
کربن ایران	شکرین	۳۸۷	۵۰۶	۸۹۴	۴۳%	۹%
لوله و گاز	پلوله	۳۰۸	۳۳۵	۶۴۳	۴۸%	۱۷%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۱۹۱	۲۴۷	۴۳۸	۴۴%	۷%
تکین کو	رتکو	۲۶	۵۷	۸۳	۳۱%	۱۴%
مجموع		۱,۱۲۷	۱,۳۷۲	۲,۴۹۹		

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۱۴۵	۱۹۶	۳۴۱	۴۳%	۵%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۲۶۶	۳۰۵	۵۷۰	۴۷%	۸%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۳۸۶	۶۶۶	۱,۰۵۲	۳۷%	۱۹%
مجموع		۷۹۷	۱,۱۶۶	۱,۹۶۴		

خرید و فروش بازارگردان در سایر مجموعه ها

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۱/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ (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	۳۷۸	۴۲۰	۷۹۸	۴۷%	۸%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۶۷۴	۸۱۳	۱,۴۸۷	۴۵%	۵%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۶۲۶	۹۲۴	۱,۵۵۰	۴۰%	۲۹%
سرمایه گذاری هامون صبا	وهامون	۱۳۷	۳۶۷	۵۰۴	۲۷%	۷%
توریستی و رفاهی آبادگران	آباد	۴	۳	۶	۵۶%	۰.۱%*
مجموع		۱,۸۱۸	۲,۵۲۷	۴,۳۴۵		

* آغاز بازارگردانی نماد آباد در صندوق صباگستر از تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۱ بوده است.

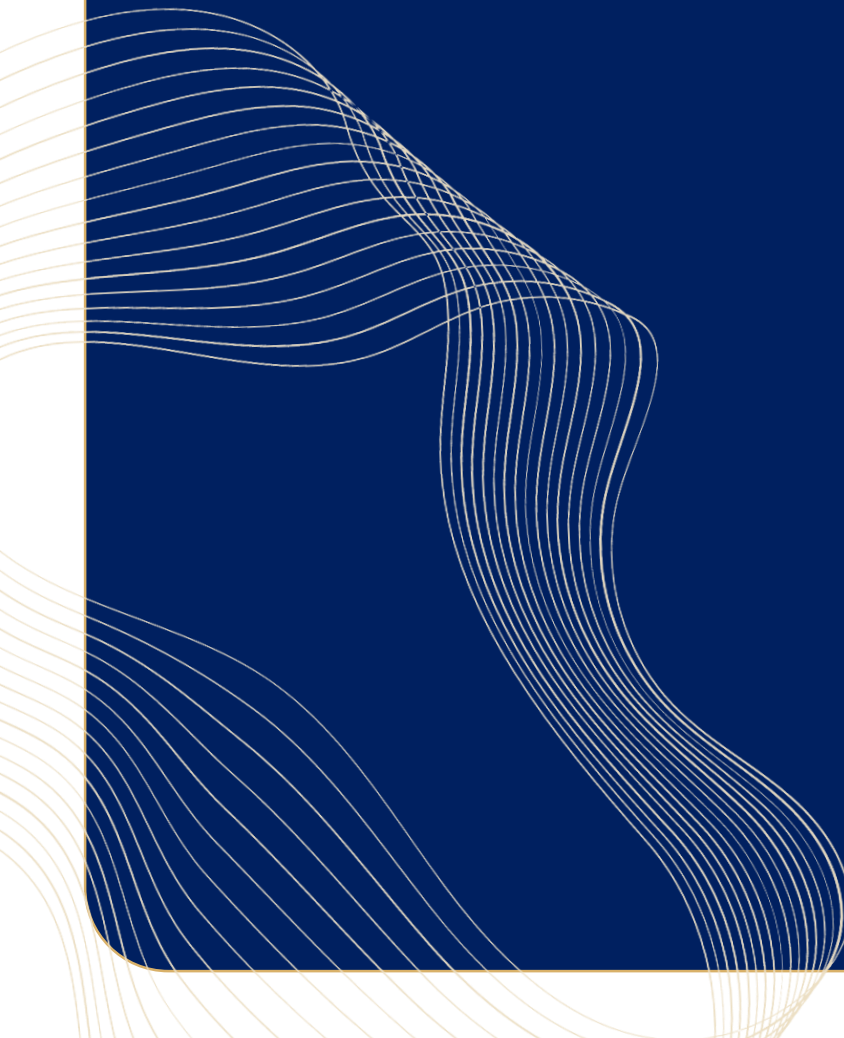
۷۲.۳ درصد میانگین بازدهی شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر

در سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

درحالیکه در سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ بازده شاخص کل ۴۳٪+ بوده است، **۵۶ نماد (۷۲ درصد)** از شرکتهای موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر بازدهی بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
دره‌آور	۲۶۲٪	شرانل	۱۱۶٪	سرود	۸۱٪	پلوه	۶۸٪	سنیر	۴۹٪	خراسان	۳۲٪
سفانو	۲۵۷٪	سصوفی	۱۱۱٪	زملارد	۸۰٪	ساروم	۶۷٪	کاسپین	۴۹٪	درازک	۳۱٪
وپترو	۱۵۰٪	تاصیکو	۱۱۱٪	تیپیکو	۷۷٪	دقاضی	۶۴٪	ددام	۴۷٪	شاون	۲۹٪
زگلدشت	۱۴۸٪	سفارس	۱۰۱٪	سیتا	۷۵٪	دابور	۶۲٪	دزهرای	۴۵٪	شغدیر	۲۸٪
ساوه	۱۴۵٪	دتوزیع	۹۹٪	زفکا	۷۵٪	مداران	۶۱٪	شپاس	۴۲٪	سفاسی	۲۱٪
دفارا	۱۴۱٪	هجرت	۹۷٪	دارو	۷۴٪	وپخش	۶۰٪	صبا	۴۱٪	سقاین	۱۶٪
لطیف	۱۳۷٪	شلعاب	۹۶٪	تاپیکو	۷۳٪	سآبیک	۵۹٪	کلر	۴۰٪	شکبیر	۱۴٪
دشیمی	۱۳۰٪	کزغال	۹۶٪	پکرمان	۷۲٪	شدوص	۵۹٪	شاملا	۴۰٪	دشیری	۸٪
سخوز	۱۲۸٪	کلوند	۹۶٪	سبهان	۷۲٪	وهامون	۵۷٪	چخزر	۳۸٪	شپترو	۲٪
سفار	۱۲۸٪	سخزر	۸۹٪	سدور	۷۱٪	شکرین	۵۷٪	پسهند	۳۷٪	شفارا	۱٪
دکپسول	۱۲۸٪	سخاش	۸۴٪	کسعدی	۷۰٪	سغرب	۵۷٪	دلر	۳۴٪	لپارس	-۹٪
چکاو	۱۲۵٪	کفرا	۸۳٪	فباهنر	۶۹٪	کخاک	۵۱٪	سبجنو	۳۴٪	آباد	-۲۱٪
دپارس	۱۱۷٪	کپشیر	۸۳٪	لخانه	۶۹٪	شستا	۵۰٪	دتماد	۳۳٪	شفن	-۲۷٪



بخش دهم:

اهم اقدامات انجام شده و برنامه

های آتی صندوق



اهم اقدامات انجام شده در 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 ۲۵ درصد) :**

این رخداد موجب شد در سال ۱۴۰۱ سرمایه گذاران صندوق صباگستر از محل سود اوراق با درآمد ثابت درآمد ۲,۰۷۰ میلیارد ریالی کسب کنند درحالیکه این مبلغ برای سال ۱۴۰۰ تنها ۶۰۰ میلیارد ریال بود.

✓ **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

✓ افزایش تعداد نمادهای موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق های کالایی و ...

