

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی صبا گستر

شرکت سرمایه گذاری صبا تامین
واحد سرمایه گذاری
اردیبهشت 1400



صندوق بازارگردانی



شرکت سرمایه‌گذاری تهران
(سهام عام)

صندوق‌های بازارگردانی شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران طبق تعهدات مشخص شده به بازارگردانی اوراق بهادار شرکت می‌پردازند.



اهداف بازارگردانی



شرکت سرمایه‌گذاری ملی ایران
(سامان نظام)

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

اصطلاحات بازارگردانی



سازمان بورس و اوراق بهادار
جمهوری اسلامی ایران

دامنه مظنه



شرکت سرمایه‌گذاری معیار
(سهام عام)

حداکثر اختلاف بین قیمت سفارش خرید و سفارش فروش هر ورقه بهادار به درصد است که بازارگردان آن ورقه بهادار، در سامانه معاملات بورس (یا فرابورس) وارد می‌نماید. این درصد نسبت به قیمت سفارش خرید محاسبه می‌شود.

دامنه مظنه برای شرکت‌های موجود در بازار عادی بورس و فرابورس 3 درصد و برای شرکت‌های بازار پایه زرد فرابورس 2 درصد می‌باشد.



شرکت سپه گداری مهاباد
(سهام عام)

حداقل سفارش انباشته و حداقل معاملات روزانه

حداقل سفارش انباشته:

حداقل تعدادی از ورقه بهادار است که بازارگردان باید همواره در سفارش خرید و فروش خود در سامانه معاملات نگه دارد.

حداقل معاملات روزانه:

حداقل تعداد ورقه بهاداری است که در صورتی که بازارگردان به میزان آن تعداد از ورقه بهادار در یک روز معاملاتی، معامله کند، می‌تواند از انجام تعهدات خود طبق این دستورالعمل در آن روز معاملاتی، خودداری نماید.

اطلاعیه فرا بورس

آغاز بازارگردانی به روش مبتنی بر حراج
صنایع چوب خزرکاسپین
نماد چخز۱- بازار دوم فرابورس ایران

حداقل معاملات روزانه (سهم)

۲,۰۰۰,۰۰۰

حداقل سفارش انباشته (سهم)

۱۰۰,۰۰۰

دوره زمانی بازارگردانی

شش ماه

از تاریخ **۱۳۹۹/۱۰/۰۷**

دامنه مظنه

۳ درصد

بازارگردان

**صندوق سرمایه گذاری اختصاصی
بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین**

فرا بورس ایران

IRAN FARA BOURSE
مدیریت ارتباطات فرابورس ایران

برای مشاهده جزئیات اطلاعیه به سایت فرابورس (www.ifb.ir) مراجعه کنید

نمونه تعهدات صندوق



شرکت سرمایه گذاری ایران
(سهام عام)

عملیات بازارگردانی



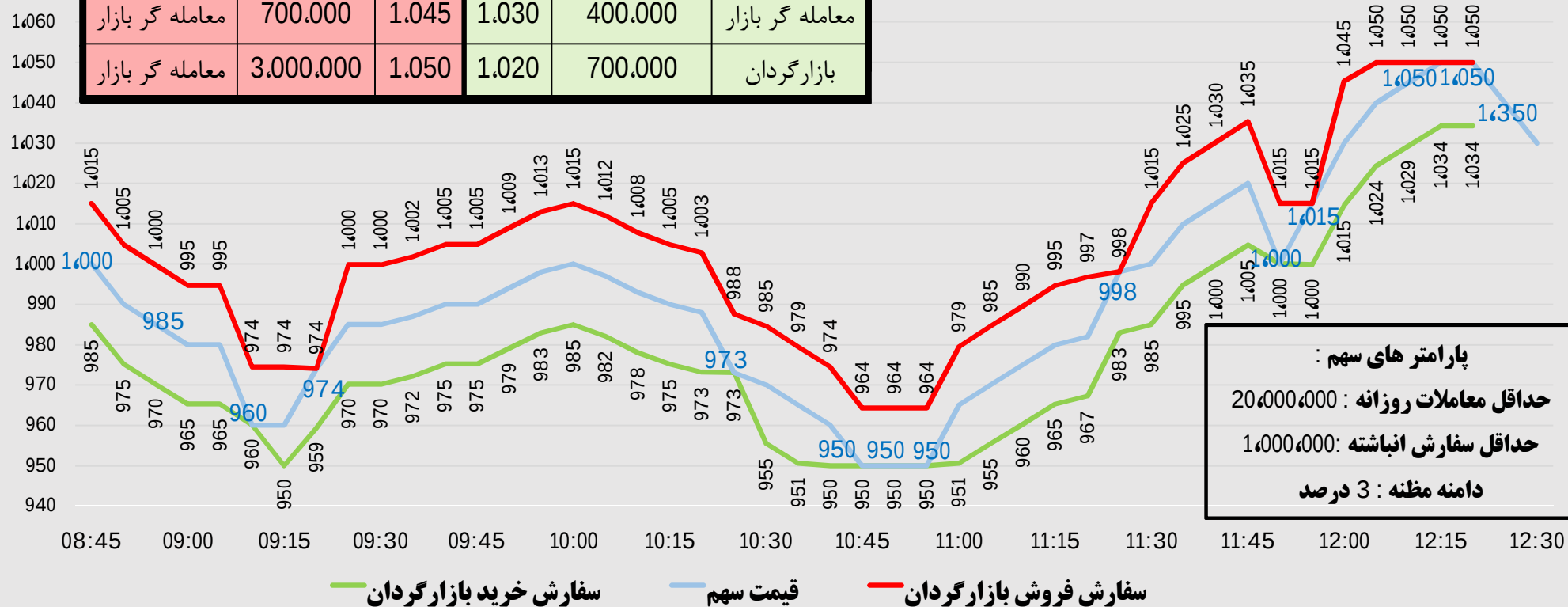
سازمان بورس و اوراق بهادار
جمهوری اسلامی ایران

ساعت: 12:25			دفتر سفارشات		
فروش			خرید		
شخص	حجم	قیمت	قیمت	حجم	شخص
معامله گر بازار	800.000	1.035	1.035	300.000	معامله گر بازار
معامله گر بازار	700.000	1.045	1.030	400.000	معامله گر بازار
معامله گر بازار	3.000.000	1.050	1.020	700.000	بازارگردان

**حجم معاملات
بازارگردان**
20.000.000 ₪

قیمت دیروز سهم : 1,000 ریال

دامنه مجاز امروز: 950 - 1,050



صندوق بازارگردانی صباگستر



شرکت مدیریت سرمایه صباگستر
(سهامی عام)

صبا گستر در یک نگاه



شرکت سهامی عام
صبا گستر

تاسیس : آبان ماه 1397

موضوع فعالیت اصلی : سرمایه گذاری در اوراق با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی

موضوع فعالیت فرعی : مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی

تعداد شرکت های موضوع بازارگردانی : 76 نماد

خالص ارزش دارایی های صندوق در 1400/02/31 : 5,554 میلیارد تومان

ارزش بازار شرکت های موضوع بازارگردانی در 1400/02/31 : 581 هزار میلیارد تومان



سازمان اسناد و کتابخانه ملی
جمهوری اسلامی ایران

76 نماد در دست بازارگردانی

نماد 6

تاپیکو، شفن، خراسان،
شرانل، پکرمان و شپاس

نماد 8

پسهند، شدوص، شکرین،
رتکو، تیپیکو، قاصیکو،
زفکا و وپترو

نماد 14

صبا، کخاک، فباهنر،
شاملا، کفرا، کسعدی،
کلوند، کیشیر، شلعب،
لپارس، زملارد، زگلدشت،
چکاوه، شغدير

نماد 17

سیتا، سفارس، صصوفی،
ساروم، سقاین، سرود،
ساوه، سخوز، سفار، سخزر،
سفانو، سبجنو، سبهان،
سغرب، سخاش، سنیر،
سدور

نماد 12

شستا، مداران، شکیر،
شاوان، شکر، شپترو و
شفا، لخانه، چکارن، چخزر
سفاسی، کزغال

آبان 1397

1399/08/03

1399/08/18

1399/08/26

1400/02/31

نماد 19

وپخش، دپارس، دلر،
دفارا، دارو، دزهرای،
هجرت، کلر، دابور، دشیمی،
ددام، دشیری،
دتوزیع، درهاور، درازک،
دقاضی، کاسپین، دتماد و
دکپسول

جایگاه صندوق بازارگردانی صباگستر در بازار سرمایه



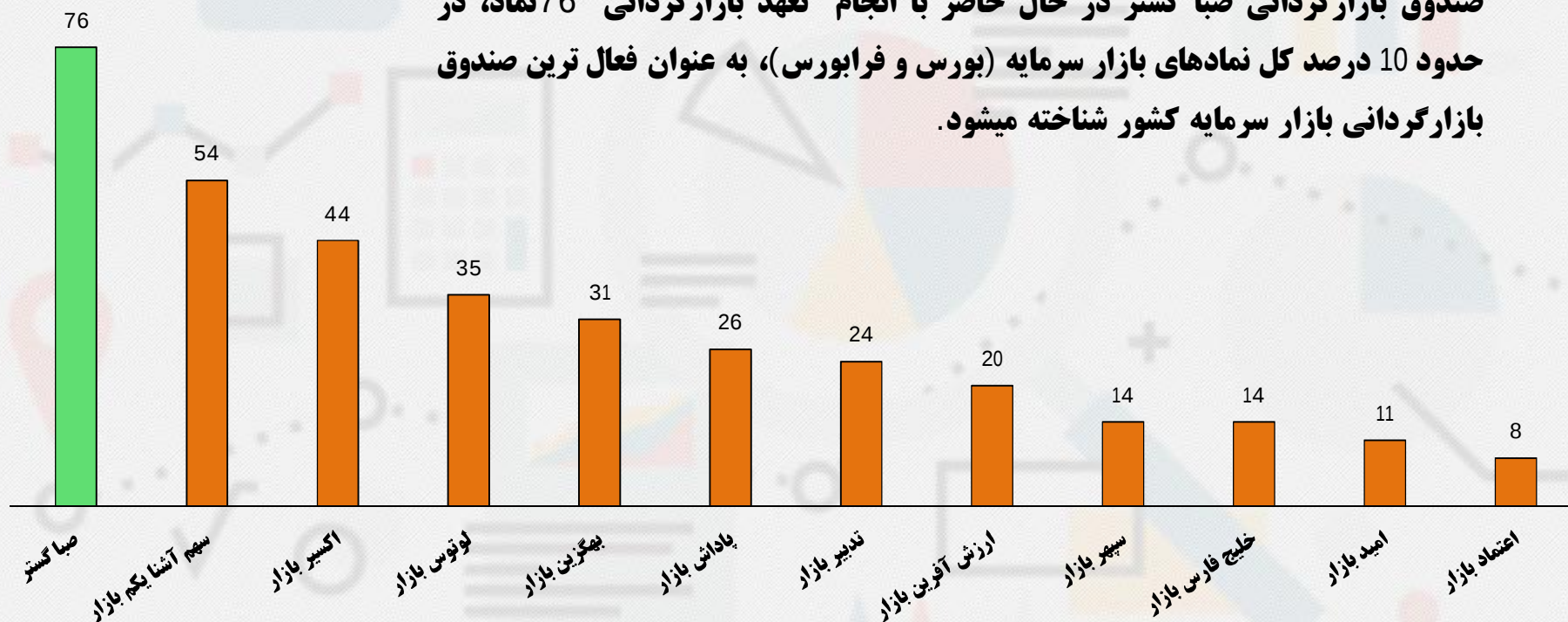
شرکت صباگستر بازارگردانی
تهران ۱۳۹۴

تعداد شرکت‌های موضوع بازارگردانی



سازمان بورس و اوراق بهادار
جمهوری اسلامی ایران

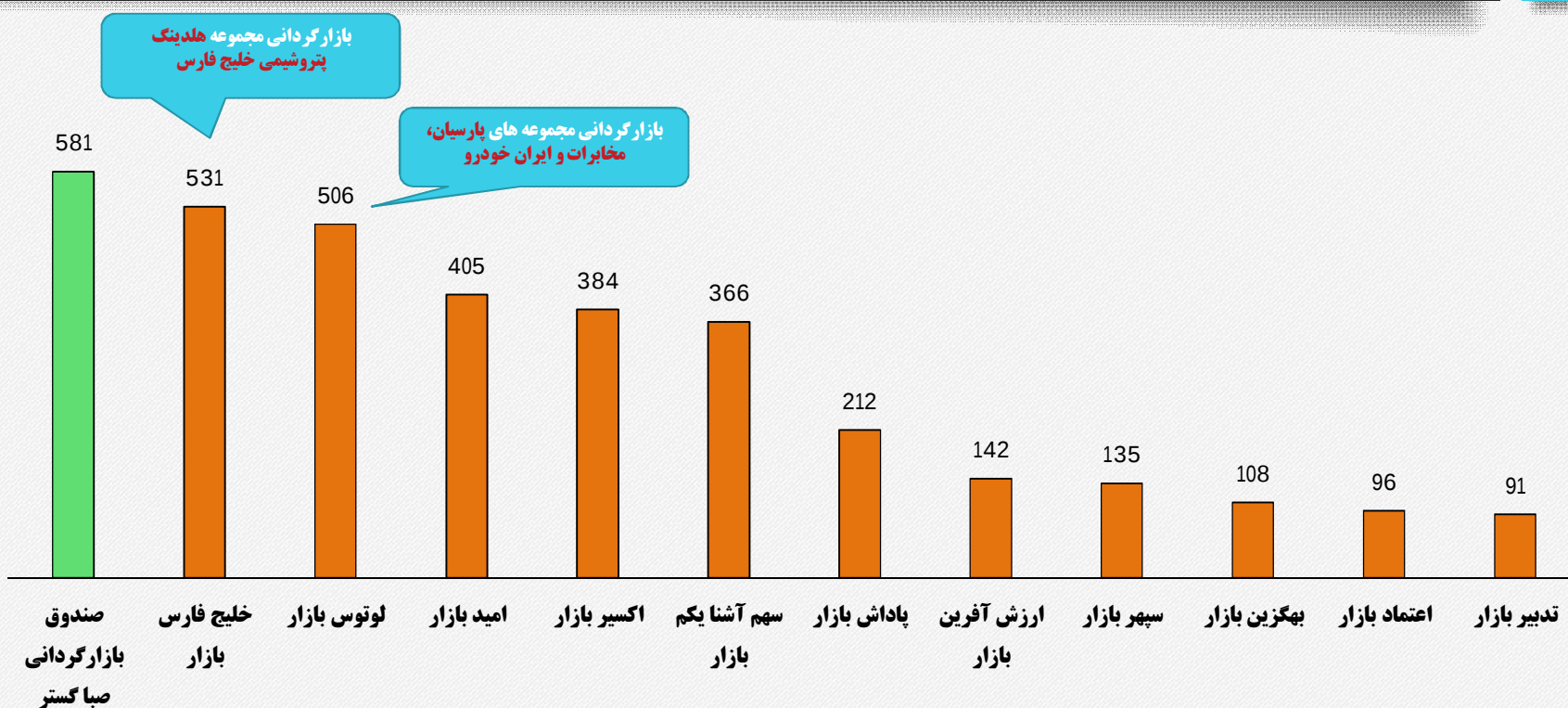
صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی 76 نماد، در حدود 10 درصد کل نمادهای بازار سرمایه (بورس و فرابورس)، به عنوان فعال ترین صندوق بازارگردانی بازار سرمایه کشور شناخته میشود.



ارزش بازار شرکت‌های موضوع بازارگردانی در تاریخ 1400/02/31 (هزار میلیارد تومان)



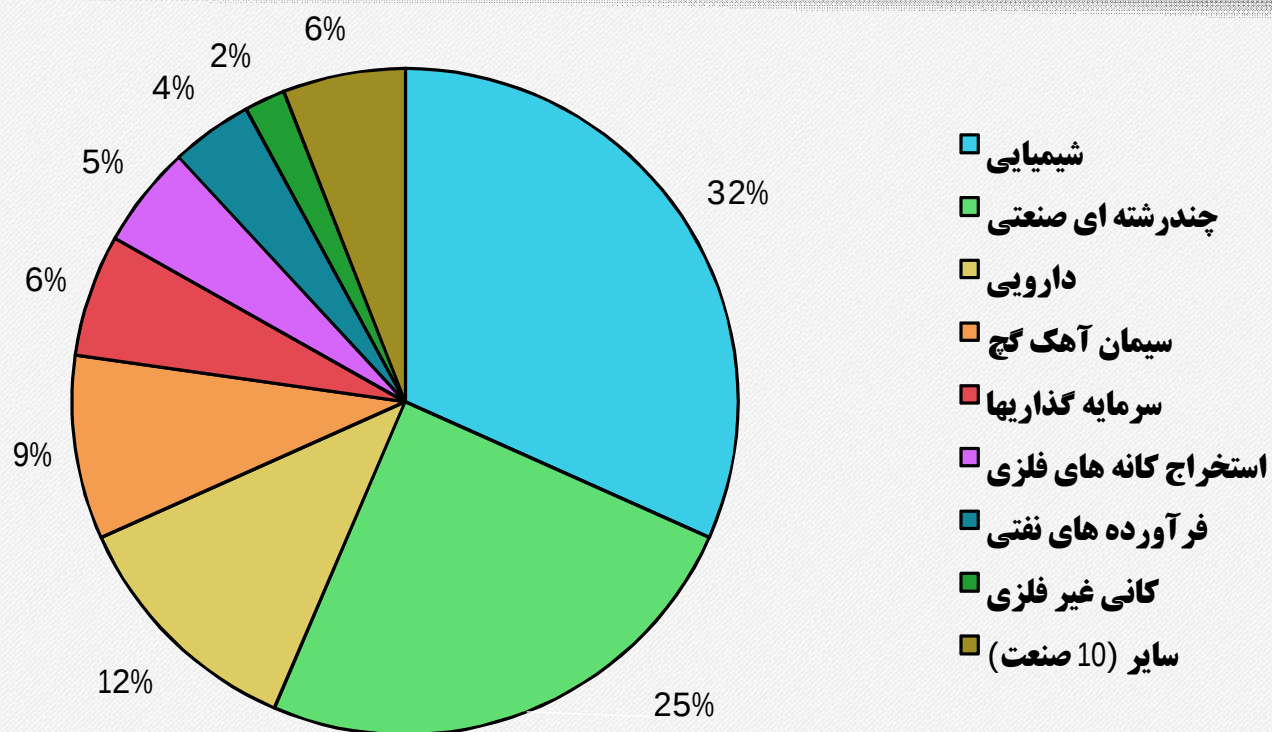
شرکت سرمایه‌گذاری سپهر
(سهام عام)



سهم صنایع از ارزش بازار شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق بازارگردانی صبا گستر



شرکت مدیریت سرمایه
صبا گستر



جمعا

18 صنعت



شرکت سرمایه‌گذاری ملی ایران
(سهام عام)

خالص ارزش دارایی صندوقهای بازارگردانی در تاریخ 1400/02/31 (میلیارد تومان)

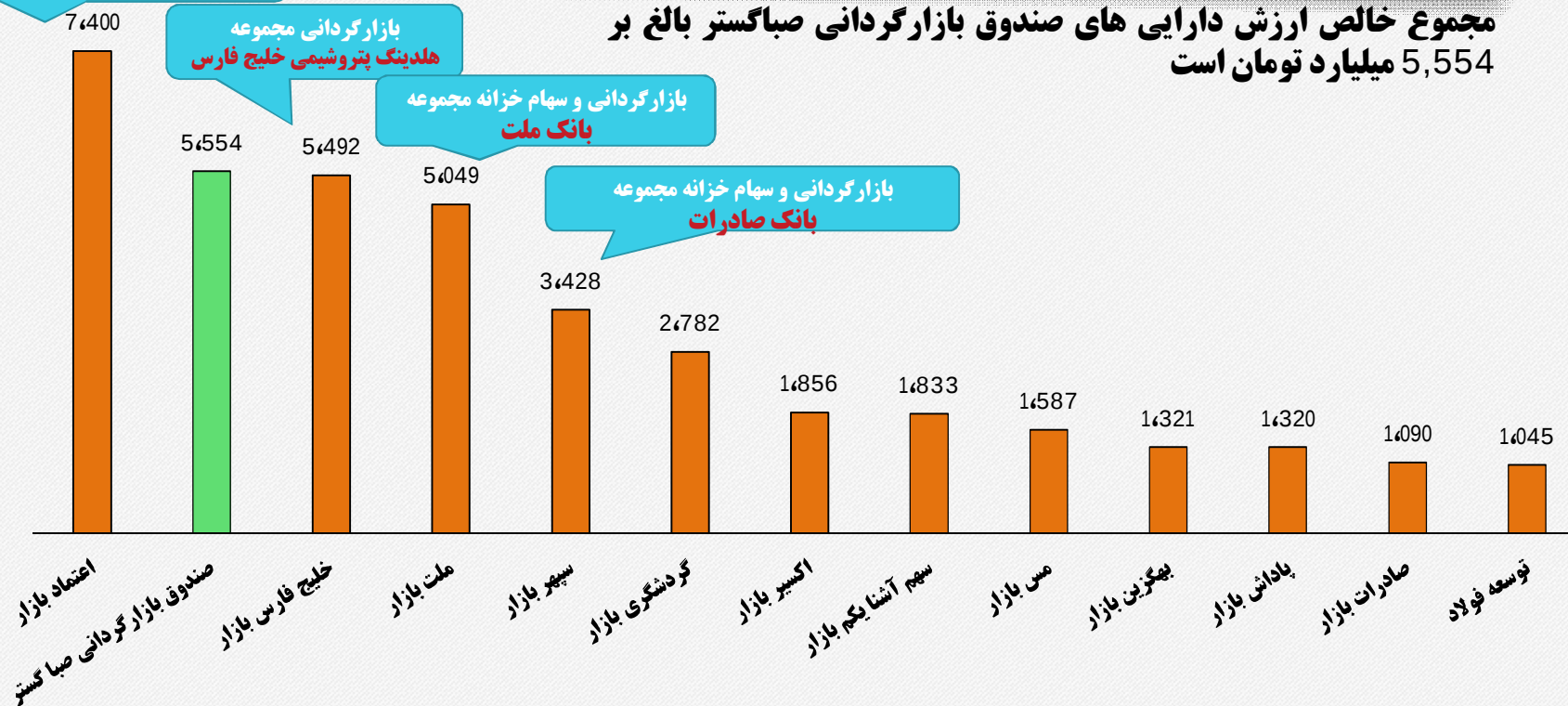
مجموع خالص ارزش دارایی های صندوق بازارگردانی صباگستر بالغ بر 5,554 میلیارد تومان است

بازارگردانی و سهام خزانه مجموعه
بانک تجارت

بازارگردانی مجموعه
هلدینگ پتروشیمی خلیج فارس

بازارگردانی و سهام خزانه مجموعه
بانک ملت

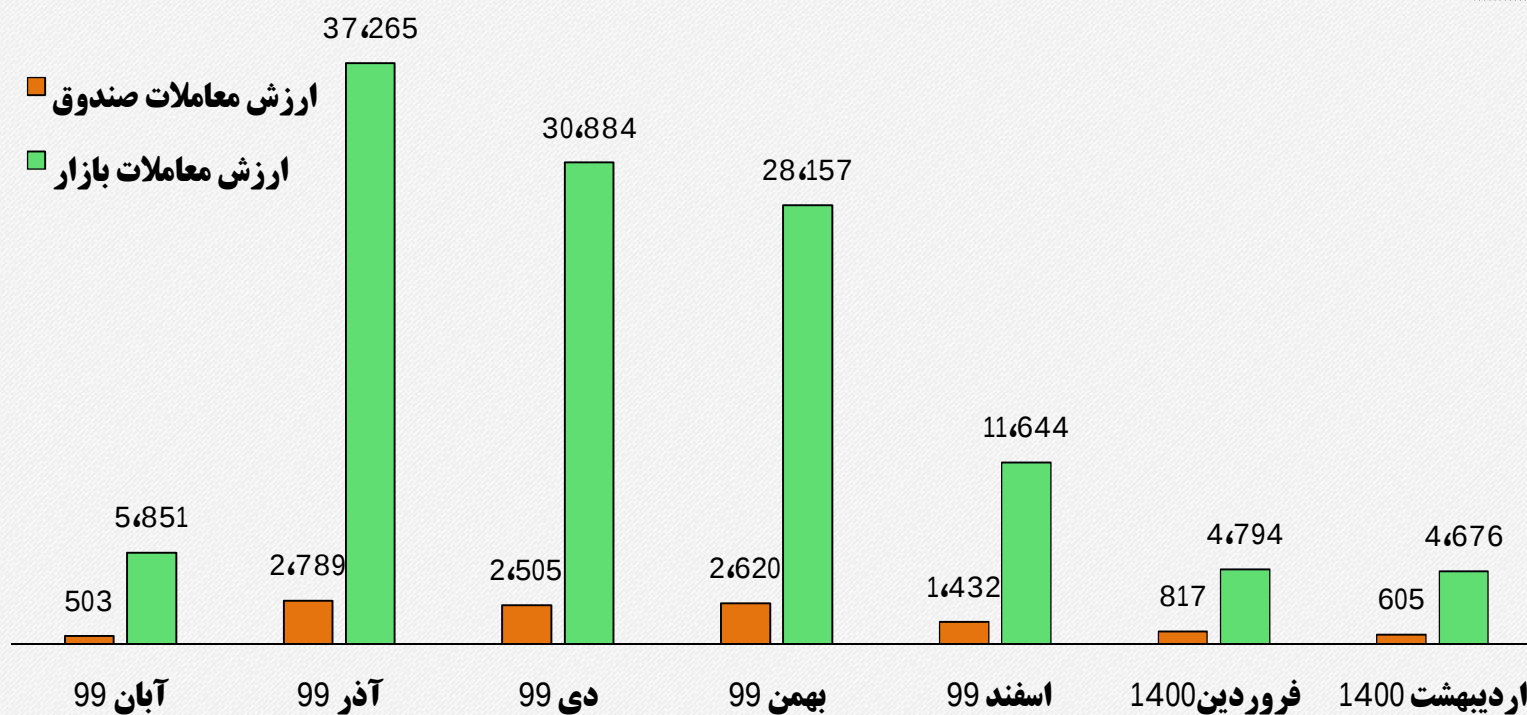
بازارگردانی و سهام خزانه مجموعه
بانک صادرات





شرکت سرمایه‌گذاری مهاباد
(سهام عام)

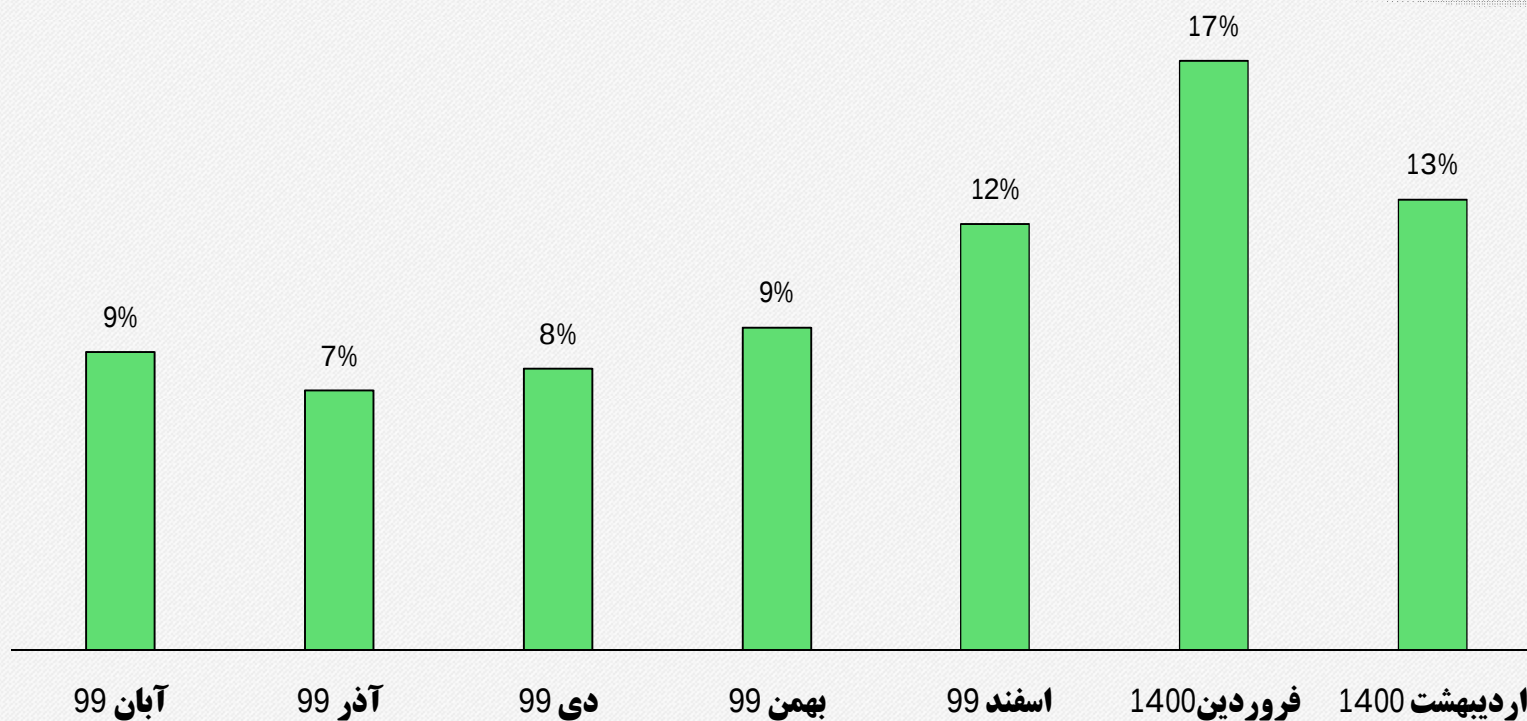
مقایسه ارزش معاملات صندوق و بازار در نمادهای موضوع بازارگردانی (میلیارد تومان)



سهم صندوق از ارزش معاملات بازار در نمادهای موضوع بازارگردانی



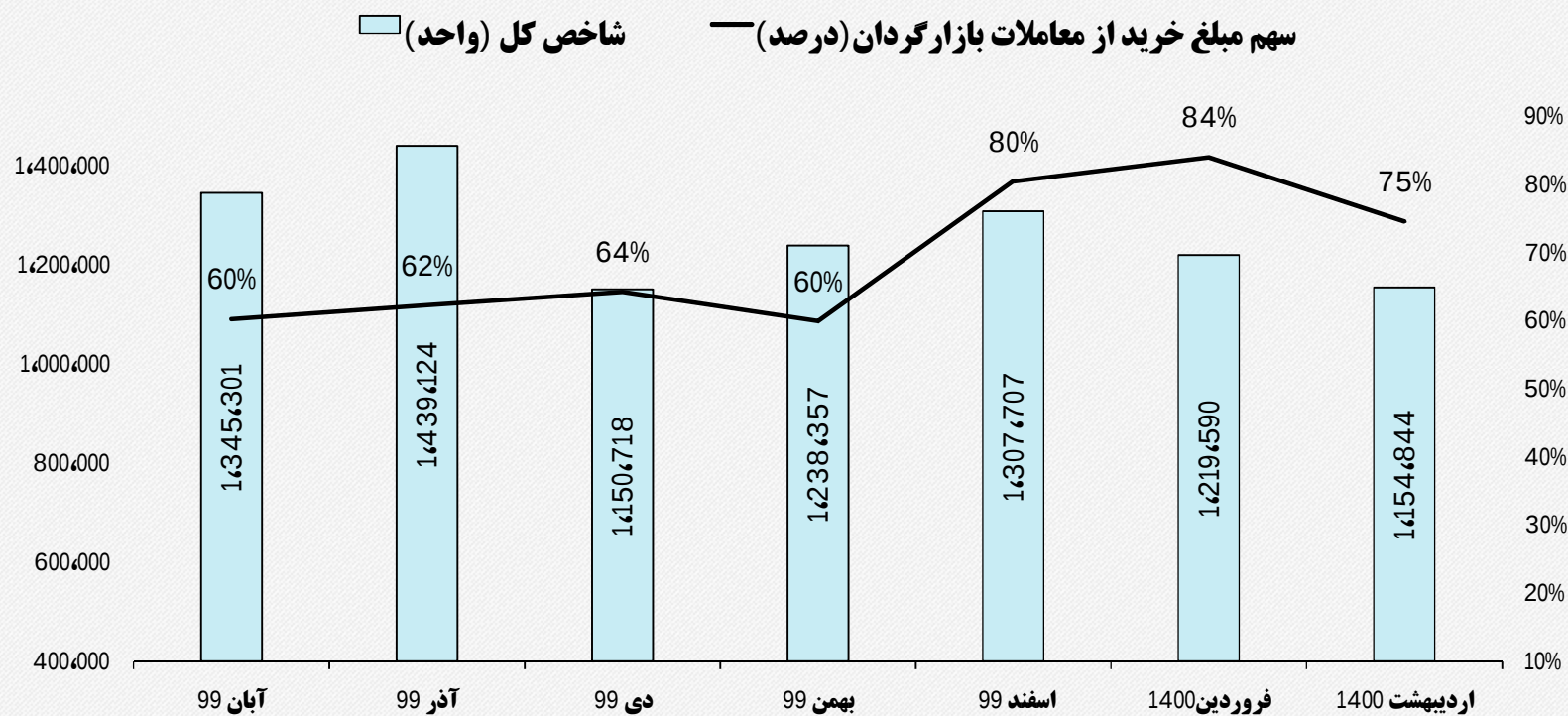
شرکت سرمایه‌گذاری سپهر
(سهام عام)



ارزش معاملات بازارگردان به تفکیک خرید و فروش (میلیارد تومان)



شرکت سرمایه‌گذاری و بورس
(سهام عام)





شرکت سهامی گسترش بیمه
(سهام عام)

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - شستا و هلدینگ ها

میلیارد تومان		تعداد فروش	تعداد خرید	هلدینگ	نماد	نام شرکت
ارزش فروش	ارزش خرید					
75	170	66.631.020	155.418.708	سازمان تامین اجتماعی	شستا	سر. تامین اجتماعی
11	47	10.345.042	45.285.805	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	تاپیکو	سر. نفت و گاز تامین
2	17	2.157.867	22.253.340	سرمایه گذاری تامین اجتماعی	صبا	سر. صبا تامین
4	24	4.147.674	23.830.721	سرمایه گذاری صدر تامین	تاصیکو	سر. صدر تامین
0	0	0	0	سرمایه گذاری سیمان تامین	سیتا	سر. سیمان تامین
1	8	333.930	2.309.975	سرمایه گذاری دارویی تامین	تیبیکو	سر. دارویی تامین
93	266	مجموع هلدینگ شستا				



شرکت ملی گاز ایران
(سهام عام)

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ تاپیکو

نام شرکت	نماد	هلدینگ	تعداد خرید	تعداد فروش	میلیارد تومان	
					ارزش خرید	ارزش فروش
پتروشیمی فن آوران	شفن	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	126.091	72.530	4	2
پتروشیمی خراسان	خراسان	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	175.578	58.786	1	0
نفت پاسارگاد	شپاس	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	1.648.673	0	3	0
پتروشیمی غدیر	شغدیر	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	1.817.052	3.734.548	11	24
نفت ایرانول	شرانل	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	645.994	848.530	2	3
صنعتی بارز	پکرمان	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	180.000	3.000	0	0
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	وپترو	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	3.618.347	9.653	5	0
پتروشیمی فارابی	شفارا	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	16.500.000	8.000.000	6	3
پتروشیمی آبادان	شپترو	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	15.316.429	5.224.621	7	2
نیروکلر	شکلر	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین	0	0	0	0
مجموع هلدینگ تاپیکو					41	36



شرکت سرمایه‌گذاری مهاباد
(سهام عام)

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ تاسیکو

نام شرکت	نماد	هلدینگ	تعداد خرید	تعداد فروش	میلیارد تومان	
					ارزش خرید	ارزش فروش
خاک چینی ایران	کخاک	سرمایه گذاری صدرتامین	234.000	300	1	0
مس باهنر	فباهنر	سرمایه گذاری صدرتامین	182.447	740.801	0	2
معدنی املاح ایران	شاملا	سرمایه گذاری صدرتامین	763.000	0	3	0
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	سرمایه گذاری صدرتامین	369.170	1.172	1	0
کاشی سعدی	کسعدي	سرمایه گذاری صدرتامین	0	0	0	0
کاشی الوند	کلوند	سرمایه گذاری صدرتامین	466.000	762.017	1	2
پشم شیشه ایران	کپشیر	سرمایه گذاری صدرتامین	0	0	0	0
زغال پرورده طبس	کزغال	سرمایه گذاری صدرتامین	3.392.689	2.318.203	11	8
لعبیران	شلعاب	سرمایه گذاری صدرتامین	580.431	35.000	1	0
مجموع هلدینگ تاسیکو (میلیون ریال)					18	11



شرکت سهامی تخصصی طبابت
(سهام عام)

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ تپیکو

نام شرکت	نماد	هلدینگ	تعداد خرید	تعداد فروش	میلیارد تومان	
					ارزش خرید	ارزش فروش
داروپخش	وپخش	سرمایه گذاری دارویی تامین	373.123	316.199	4	3
پارس دارو	دپارس	سرمایه گذاری دارویی تامین	160.000	0	1	0
دارو اکسیر	دلر	سرمایه گذاری دارویی تامین	379.609	59.328	1	0
دارو فارابی	دفارا	سرمایه گذاری دارویی تامین	450.000	0	3	0
داروسازی قاضی	دقاضی	سرمایه گذاری دارویی تامین	118.000	0	0	0
کارخانجات داروپخش	دارو	سرمایه گذاری دارویی تامین	823.539	977	3	0
دارو زهراوی	دزهراوی	سرمایه گذاری دارویی تامین	3.350.000	0	2	0
توزیع داروپخش	دتوزیع	سرمایه گذاری دارویی تامین	628.597	0	3	0
دارو رازک	درازک	سرمایه گذاری دارویی تامین	654.183	92.654	2	0
پخش هجرت	هجرت	سرمایه گذاری دارویی تامین	255.470	0	1	0
مواد داروپخش	دتماد	سرمایه گذاری دارویی تامین	630.000	0	3	0
کلر پارس	کلر	سرمایه گذاری دارویی تامین	435.185	0	6	0
دارو ابوریحان	دابور	سرمایه گذاری دارویی تامین	604.205	0	2	0
کاسپین تامین	کاسپین	سرمایه گذاری دارویی تامین	648.940	0	2	0
شیمی داروپخش	دشیمی	سرمایه گذاری دارویی تامین	500.000	0	1	0
زاگرس فارمد پارس	ددام	سرمایه گذاری دارویی تامین	915.000	0	2	0
شیرین دارو	دشیری	سرمایه گذاری دارویی تامین	10.000	0	0	0
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	سرمایه گذاری دارویی تامین	374.365	294.143	1	1
دارویی ره آورد تامین	دره‌آور	سرمایه گذاری دارویی تامین	897.165	179.433	3	1
مجموع هلدینگ تپیکو					39	5



شرکت سرمایه‌گذاری مهاباد
(سهام عام)

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ سیتا

نام شرکت	نماد	هلدینگ	تعداد خرید	تعداد فروش	میلیارد تومان	
					ارزش خرید	ارزش فروش
سیمان فارس و خوزستان	سفارس	سرمایه گذاری سیمان تامین	2,988.971	3,477.200	4	5
سیمان صوفیان	سصوفی	سرمایه گذاری سیمان تامین	3,900.000	0	5	0
سیمان ارومیه	ساروم	سرمایه گذاری سیمان تامین	40.000	0	0	0
سیمان قائن	سقاین	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,070.000	0	6	0
سیمان شاهرود	سرود	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,070.308	650.091	2	1
سیمان ساوه	ساوه	سرمایه گذاری سیمان تامین	254.914	0	1	0
سیمان خوزستان	سخوز	سرمایه گذاری سیمان تامین	873.737	794.979	2	2
سیمان فارس	سفار	سرمایه گذاری سیمان تامین	153.500	0	2	0
سیمان خزر	سخزر	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,149.897	40.261	2	0
سیمان فارس نو	سفانو	سرمایه گذاری سیمان تامین	0	0	0	0
سیمان بجنورد	سبجنو	سرمایه گذاری سیمان تامین	500.000	0	2	0
سیمان بهبهان	سبهان	سرمایه گذاری سیمان تامین	0	0	0	0
سیمان غرب	سغرب	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,915.000	0	6	0
سیمان خاش	سخاش	سرمایه گذاری سیمان تامین	195.000	0	3	0
سیمان سفید نی ریز	سنیر	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,000	0	0	0
سیمان دورود	سدور	سرمایه گذاری سیمان تامین	1,900.000	0	2	0
فارسیت اهواز	سفاسی	سرمایه گذاری سیمان تامین	0	0	0	0
مجموع هلدینگ سیتا					39	8

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ صنایع عمومی



شرکت سبک‌سازی منابع
(سهام عام)

نام شرکت	نماد	هلدینگ	تعداد خرید	تعداد فروش	میلیارد تومان	
					ارزش خرید	ارزش فروش
پارس الکتریک	لپارس	سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	444.000	0	4	0
کشت و دامداری فکا	زفکا	سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	1.320.543	0	2	0
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	835.721	0	3	0
کشت و دام گلدشت نمونه اصفهان	زگلدشت	سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	328.908	0	0	0
لوازم خانگی پارس	لخانه	سرمایه گذاری صنایع عمومی تامین	360.000	0	1	0
مجموع هلدینگ صنایع عمومی					10	0

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ وپترو



شرکت ملی پتروشیمی
(سهام عام)

میلیارد تومان		تعداد فروش	تعداد خرید	هلدینگ	نماد	نام شرکت
ارزش فروش	ارزش خرید					
0	0	0	0	سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	پسهند	لاستیک سهند
0	6	0	715.000	سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	شکرین	کربن ایران
0	7	0	2.750.000	سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	شدوص	دوده صنعتی پارس
0	5	0	2.600.000	سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	رتکو	تکین کو
0	17	مجموع هلدینگ وپترو				

خرید و فروش بازارگردان در اردیبهشت ماه 1400 - هلدینگ سلولوزی



شرکت سرمایه‌گذاری مهاباد
(سهام عام)

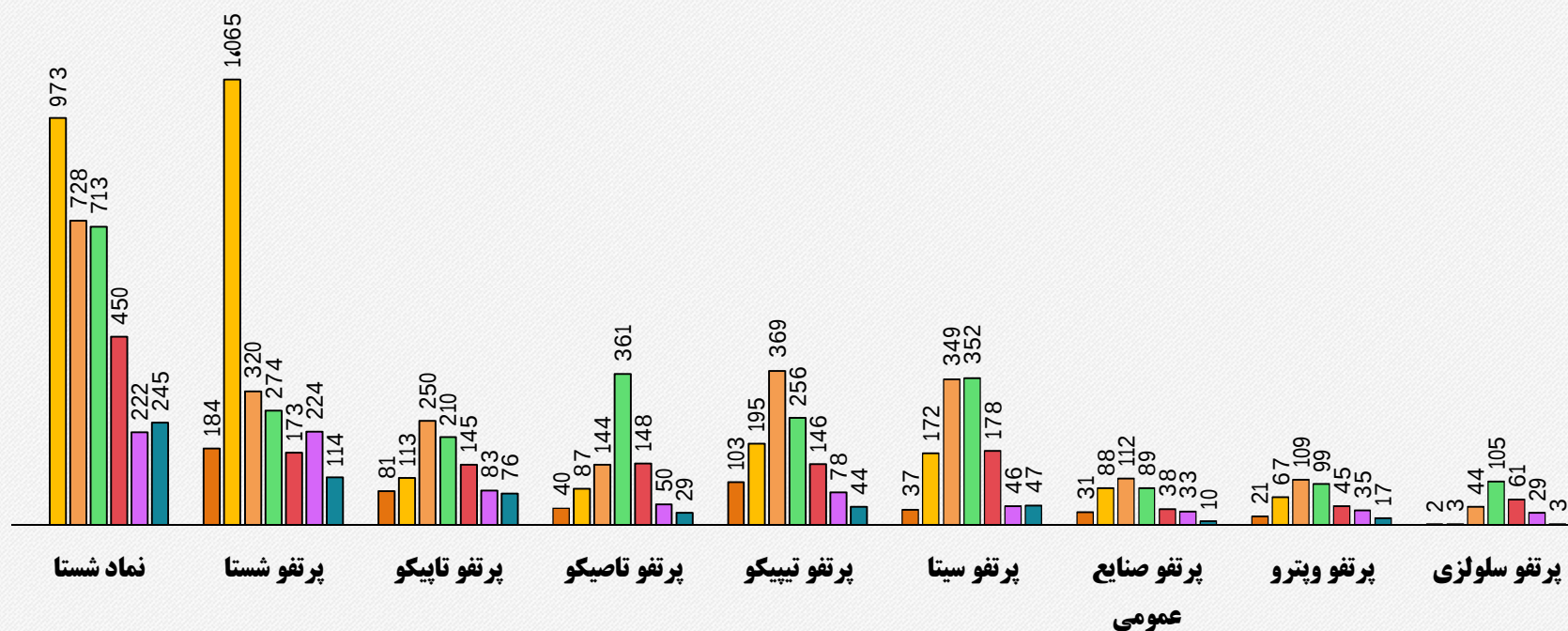
میلیارد تومان		تعداد فروش	تعداد خرید	هلدینگ	نماد	نام شرکت
ارزش فروش	ارزش خرید					
0	0,04	0	24.000	هلدینگ سلولوزی	چکاو	کاغذ سازی کاوه
0	0	0	0	هلدینگ سلولوزی	چکارن	کارتن ایران
0	3,28	0	786.000	هلدینگ سلولوزی	چخزر	صنایع چوب خزر کاسپین
0	3,32	مجموع هلدینگ سلولوزی				



شرکت ملی پالایش نفت ایران
(سهام عام)

ارزش معاملات صندوق به تفکیک هلدینگ (میلیارد تومان)

اردیبهشت 1400 فروردین 1400 اسفند 99 بهمن 99 دی 99 آذر 99 آبان 99

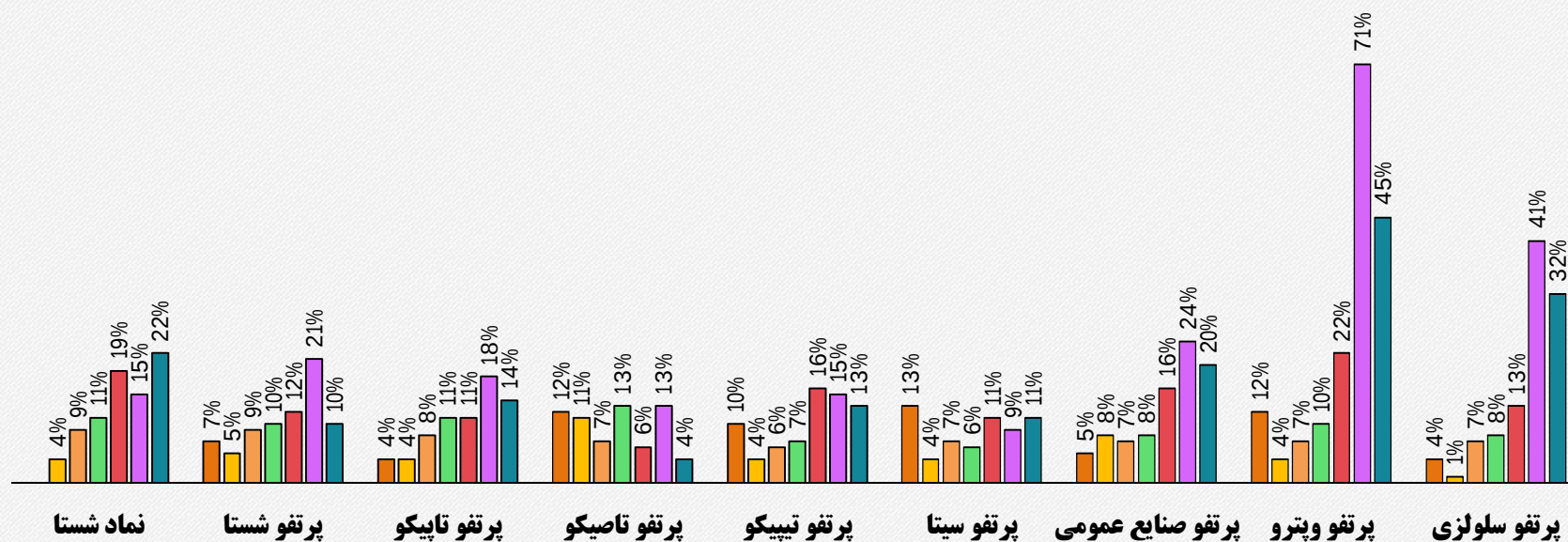


سهم صندوق از معاملات بازار به تفکیک هلدینگ



شرکت سرمایه‌گذاری مشاورین
(سهامی عام)

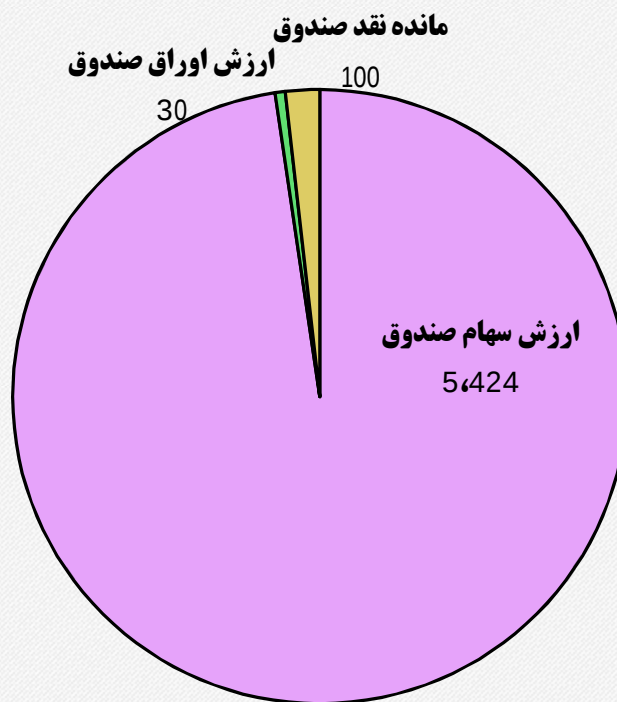
اردیبهشت 1400 فروردین 1400 اسفند 99 بهمن 99 دی 99 آذر 99 آبان 99



(ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ 1400/02/31) (میلیارد تومان)



شرکت سبک‌کشتی ماهان
(سهام عام)



بازده شرکت‌های موضوع بازارگردانی، شاخص کل و شاخص کل هم وزن طی دوره بازارگردانی از 1399/08/30 الی 1400/02/31



شرکت سرمایه‌گذاری سپهر
(سهام عام)

