



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱



משרד החינוך
משרד החינוך



فهرست

مقدمه و معرفی

ارکان و واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

۱

۲

۳

۴

۵

خالص ارزش دارایی‌های صندوق

ترکیب دارایی‌های صندوق

معاملات سهام صندوق

عملکرد صندوق به تفکیک نمادهای موضوع بازارگردانی

اهم اقدامات انجام شده و برنامه‌های آتی صندوق

۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول:

معرفی و مقدمه

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 نقدشوندگی ورقه بهادار

معرفی

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی صبا گستر 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 ۱۳۹۷/۰۸/۲۸ 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 ۱۳۹۷/۰۹/۰۳ تحت شماره ۱۱۶۱۵ نزد سازمان بورس به ثبت رسیده است.

در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۸۱ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازار سرمایه کشور از این حیث شناخته می‌شود.

در این تاریخ خالص ارزش دارایی‌های صندوق ۱۱۷,۱۵۳ میلیارد ریال می باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ افزایش ۵۴ درصدی داشته است.



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

ارکان صندوق

دوره منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	رکن
شرکت سرمایه‌گذاری صبا تامین	شرکت سبدگردان اندیشه صبا	مدیر
موسسه حسابرسی هوشیار ممیز	موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت رهیافت و همکاران	متولی
موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	حسابرس
شرکت کارگزاری صبا تامین	شرکت کارگزاری صبا تامین و بانک رفاه کارگران	کارگزار

در دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ ارکان مدیر، متولی و کارگزار (کارگزاری بانک رفاه کارگران اضافه گردیده است) صندوق تغییر کرده‌اند و رکن حسابرس نسبت به دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ بدون تغییر بوده است.

واحدهای سرمایه گذاری صندوق

نوع واحد	۱۴۰۱/۰۶/۳۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱۴۰۲/۰۶/۳۱	
ممتاز	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	شرکت گروه مالی صبا تأمین
ممتاز	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	شرکت سرمایه‌گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین
ممتاز	۸۹۶	۰	۰	شرکت کارگزاری صبا تامین
ممتاز	۰	۸۹۶	۸۹۶	شرکت سبدگردان اندیشه صبا
ممتاز	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	مجموع واحدهای ممتاز
عادی	۷۳,۹۶۰,۳۶۴	۶۹,۴۶۱,۷۲۴	۶۷,۵۵۷,۶۱۲	مجموع واحدهای عادی
-	۷۴,۰۴۹,۹۶۴	۶۹,۵۵۱,۳۲۴	۶۷,۶۴۷,۲۱۲	مجموع کل واحدهای سرمایه گذاری



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.

عملیات بازارگردانی

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 سفارش های خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته بوده و بالاترین قیمت سفارش فروشی که مجموع حجم سفارش های 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 سفارش های خرید تا آن قیمت برابر یا بیشتر از حداقل سفارش انباشته است، محاسبه می شود.

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 :

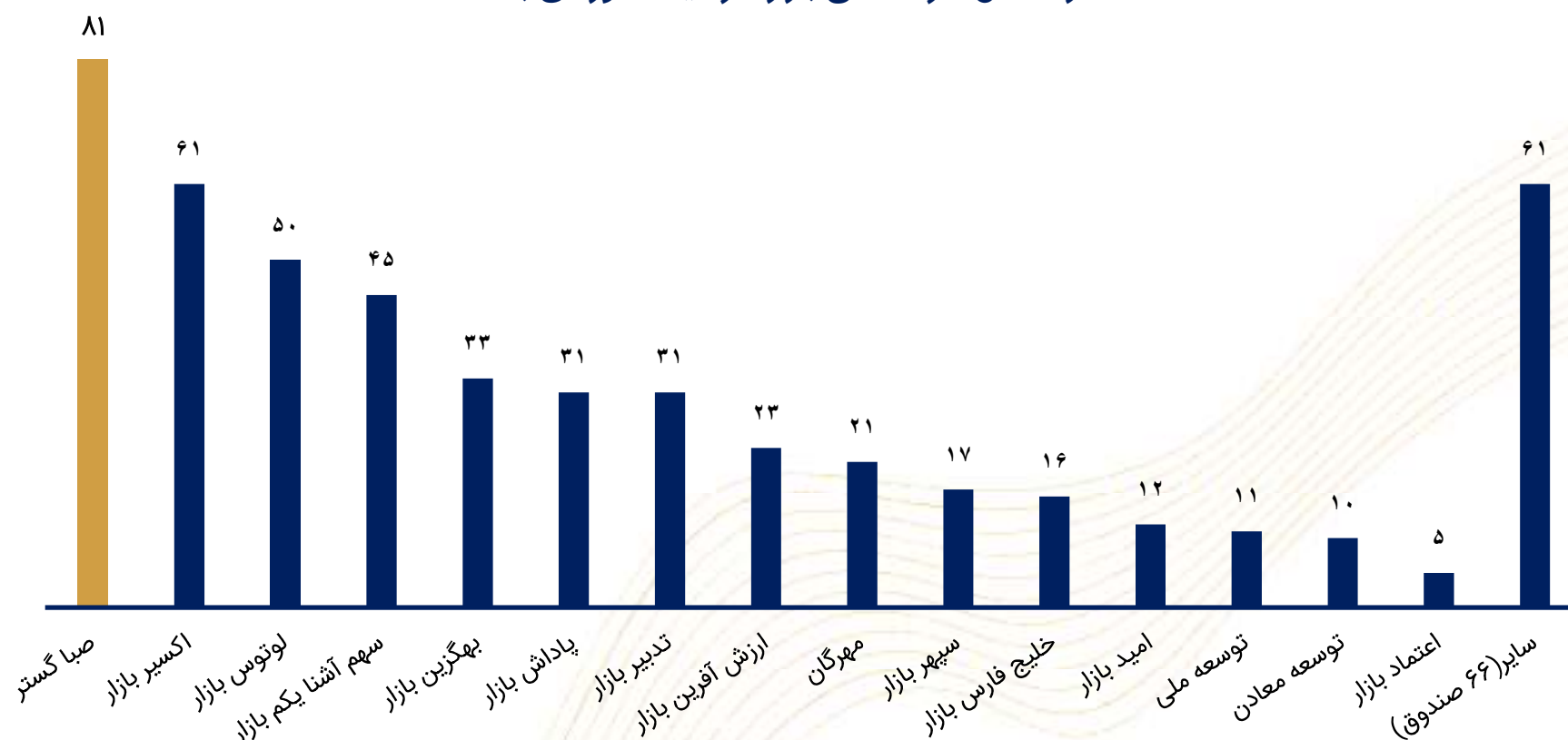


نمادهای موضوع بازارگردانی به تفکیک هلدینگ

هلدینگ	نماد	هلدینگ
هلدینگ شستا	شستا	تاپیکو
هلدینگ تاپیکو	شغن وپترو	خراسان شفارا
هلدینگ تیپیکو	وپخش دزهرای دابور دره‌آور	دپارس دتوزیع کاسپین
هلدینگ تاصیکو	کخاک کپشیر	شاملا شلعاب
هلدینگ سیتا	سفارس سخوز سغرب	ساروم سخزر سنیر
هلدینگ صنایع عمومی	لپارس	زفکا
هلدینگ وپترو	پسهند	شکربن
هلدینگ سلولزی	چکاوه	چخزر
بانک رفاه	مداران	شاوان
هلدینگ هگتا	آباد	شکبیر
هلدینگ صبا تامین	وهامون	شپنا
	صندوق اوصتا	صندوق نفیس
		صندوق دیبا
		اوراق گام توسعه تعاون

بزرگترین صندوق بازارگردانی سرمایه کشور به لحاظ تعداد نماد موضوع بازارگردانی

صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی ۸۱ نماد، بازارگردان ۱۰ درصد کل شرکت‌های بازار سرمایه کشور می‌باشد.





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 ۱۴۰۲/۰۶/۳۱	شش ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱
درآمد ها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۳,۰۸۵,۳۶۸	۲,۱۸۳,۹۱۸
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۴,۴۱۶,۶۸۴	(۴,۲۳۵,۹۶۵)
سود سهام	۸,۴۰۵,۲۱۰	۶,۱۸۷,۹۸۴
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۳۹۴,۸۶۲	۴۷۰,۴۷۶
سایر درآمدها	۳۰,۶۵۰	۵۴,۷۱۶
جمع درآمدها	۱۶,۳۳۲,۷۷۶	۴,۶۶۱,۱۲۹
هزینه ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۴۷۷,۱۳۵)	(۳۶۰,۶۹۷)
هزینه مالی	(۱,۹۲۸)	(۸۷,۸۰۱)
سایر هزینه ها	(۱۷,۳۷۹)	(۵,۲۱۶)
جمع هزینه ها	(۴۹۶,۴۴۲)	(۴۵۳,۷۱۴)
سود (زیان)خالص	۱۵,۸۳۶,۳۳۳	۴,۲۰۷,۴۱۵



بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی ها

صورت خالص دارایی ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۲/۰۶/۳۱	۱۴۰۱/۱۲/۲۹
دارایی ها :		
سرمایه گذاری در سهام و حق تقدم	۸۶,۳۳۷,۳۵۴	۷۹,۹۲۵,۵۳۳
سرمایه گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۱۵۲,۰۵۹	۳۴۷,۶۱۸
سرمایه گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۵,۱۰۵,۸۹۶	۳,۶۹۰,۲۷۱
سرمایه گذاری در واحد صندوق های سرمایه گذاری	۱۵,۸۲۱,۱۸۱	۱۶,۹۵۳,۲۹۶
حساب های دریافتی	۹,۷۱۹,۴۹۵	۶,۱۰۸,۷۴۹
سایر دارایی ها	۱۷,۱۶۵	۰
موجودی نقد	۵۳	۰
جاری کارگزاران و صندوق ها	۰	۸۳۹,۰۱۷
جمع دارایی ها	۱۱۷,۱۵۳,۲۰۱	۱۰۷,۸۶۴,۴۸۵
بدهی ها :		
جاری کارگزاران و صندوق ها	۳۹,۴۶۵	۰
پرداختی به ارکان صندوق	۲۶۸,۳۴۸	۱۹۹,۶۸۷
سایر حساب های پرداختی و ذخایر	۲۷,۳۹۷	۱۷,۶۰۳
بدهی به سرمایه گذاران	۱۶۱	۱,۵۰۰,۱۶۲
جمع بدهی ها	۳۳۵,۳۷۱	۱,۷۱۷,۴۵۲
خالص دارایی ها	۱۱۶,۸۱۷,۸۳۰	۱۰۶,۱۴۷,۰۳۴
خالص دارایی های هر واحد سرمایه گذاری	۱,۷۲۶,۸۶۸	۱,۵۲۶,۱۶۸

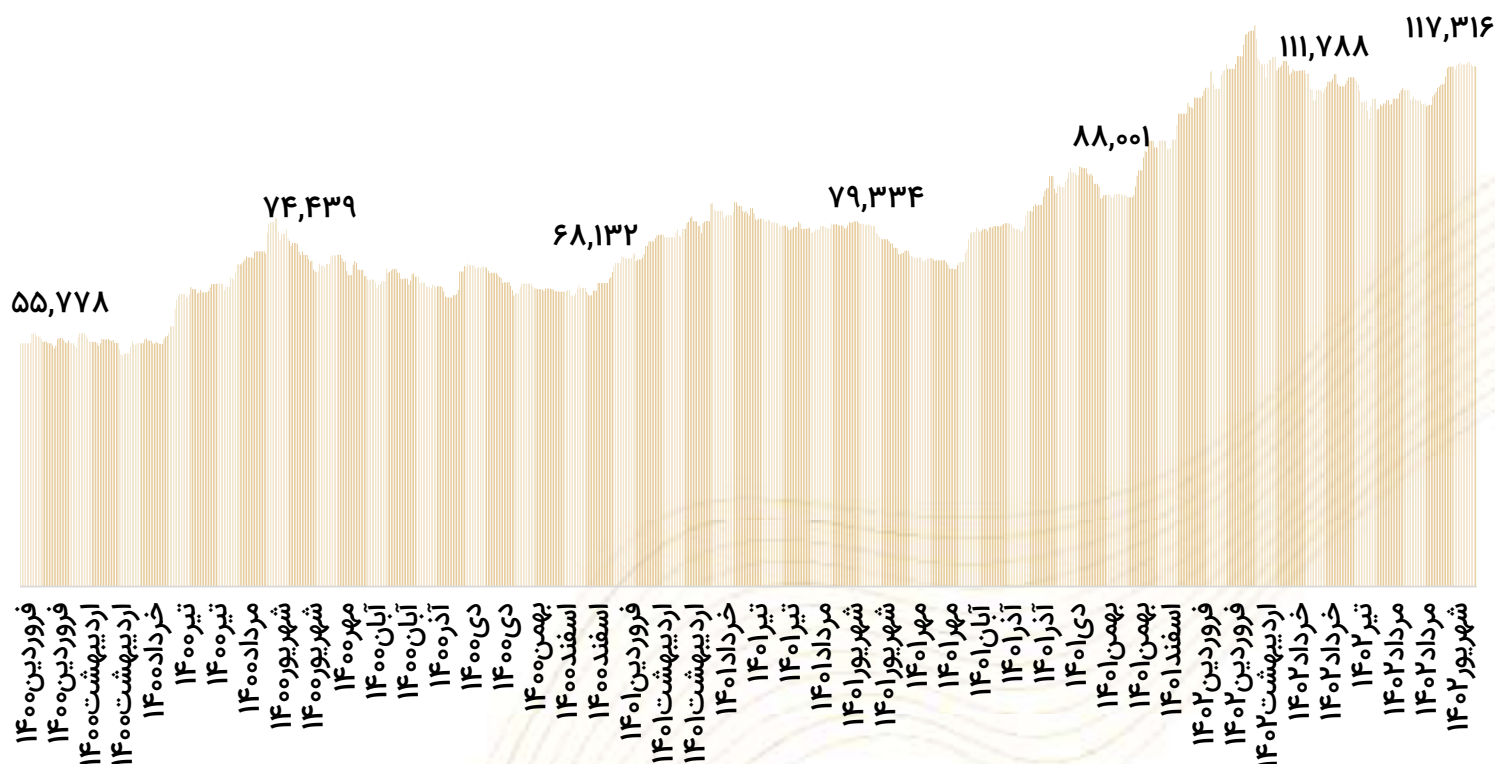


بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق

رشد خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

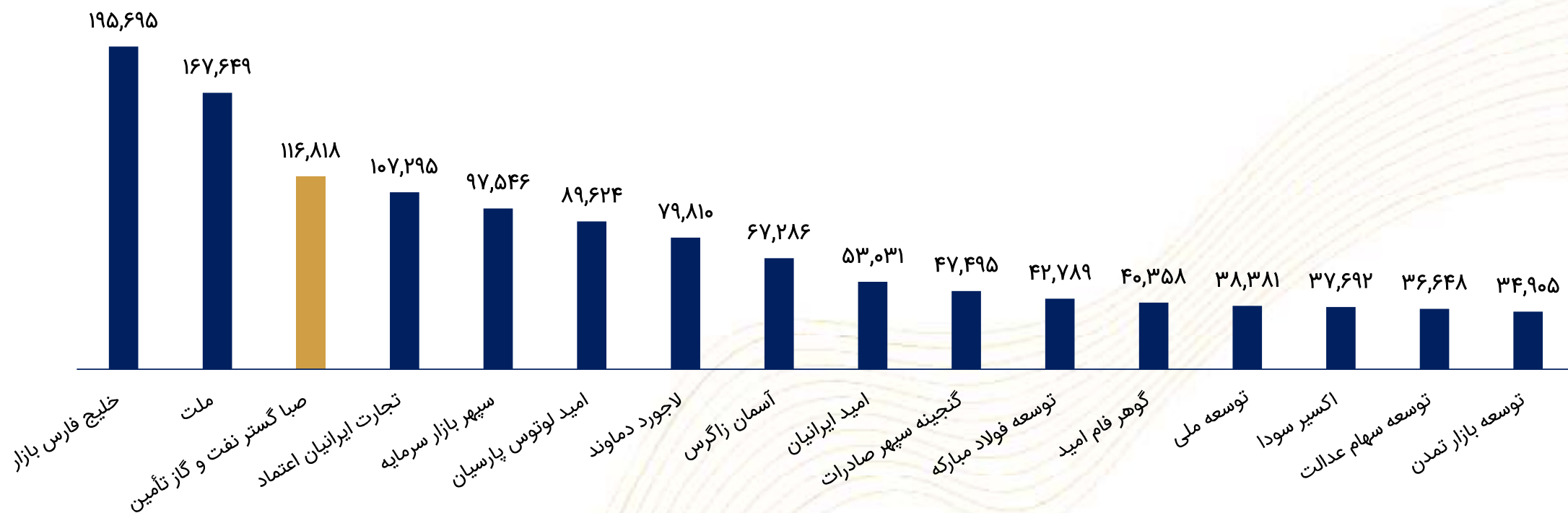
در تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۱۱۶,۶۱۸ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ **افزایش ۵۴ درصدی** را تجربه کرده است.



گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

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

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (میلیارد ریال)



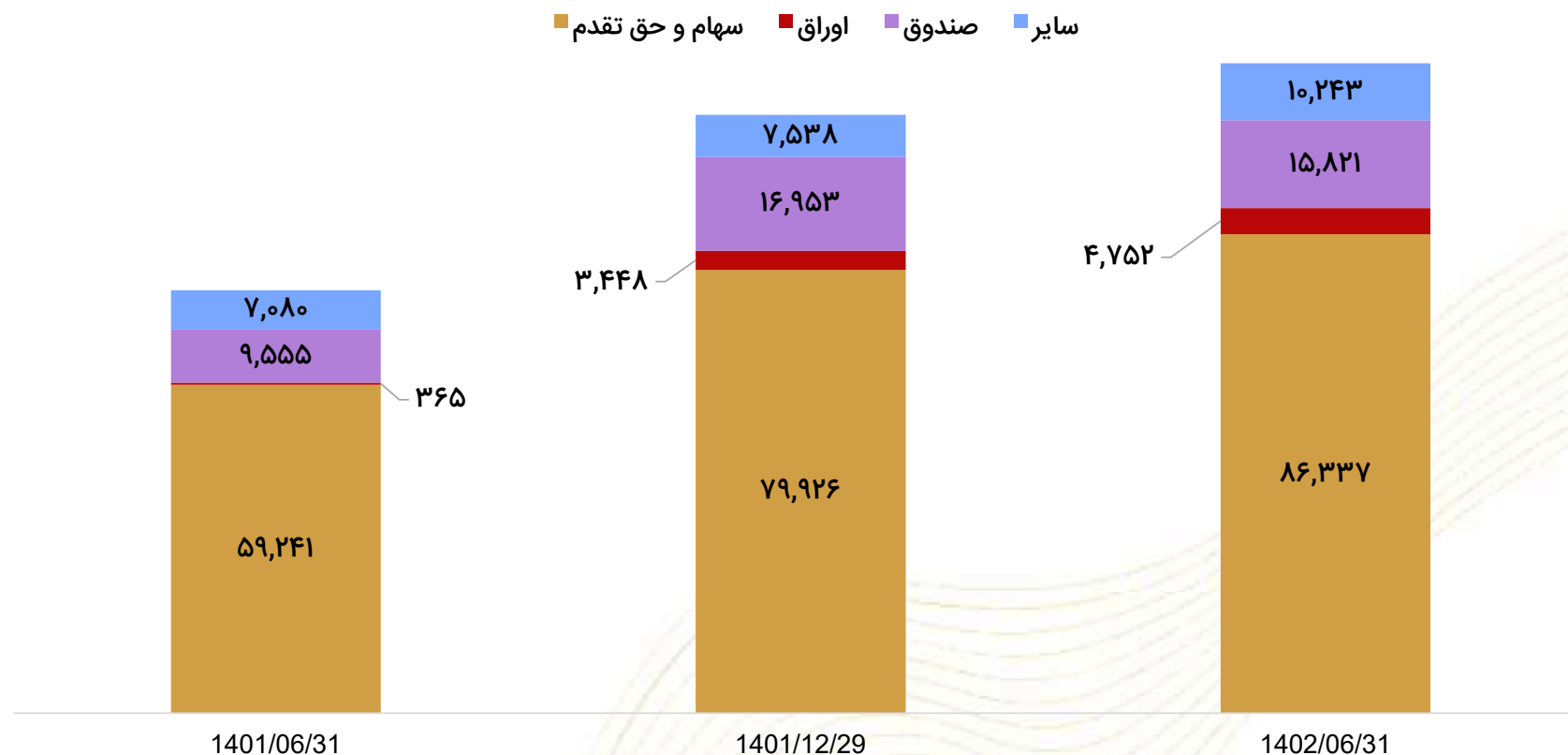


بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)



عمده (۹۸ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتی (سررسید نشده) می باشد که به تدریج از شرکتها وصول می گردد.

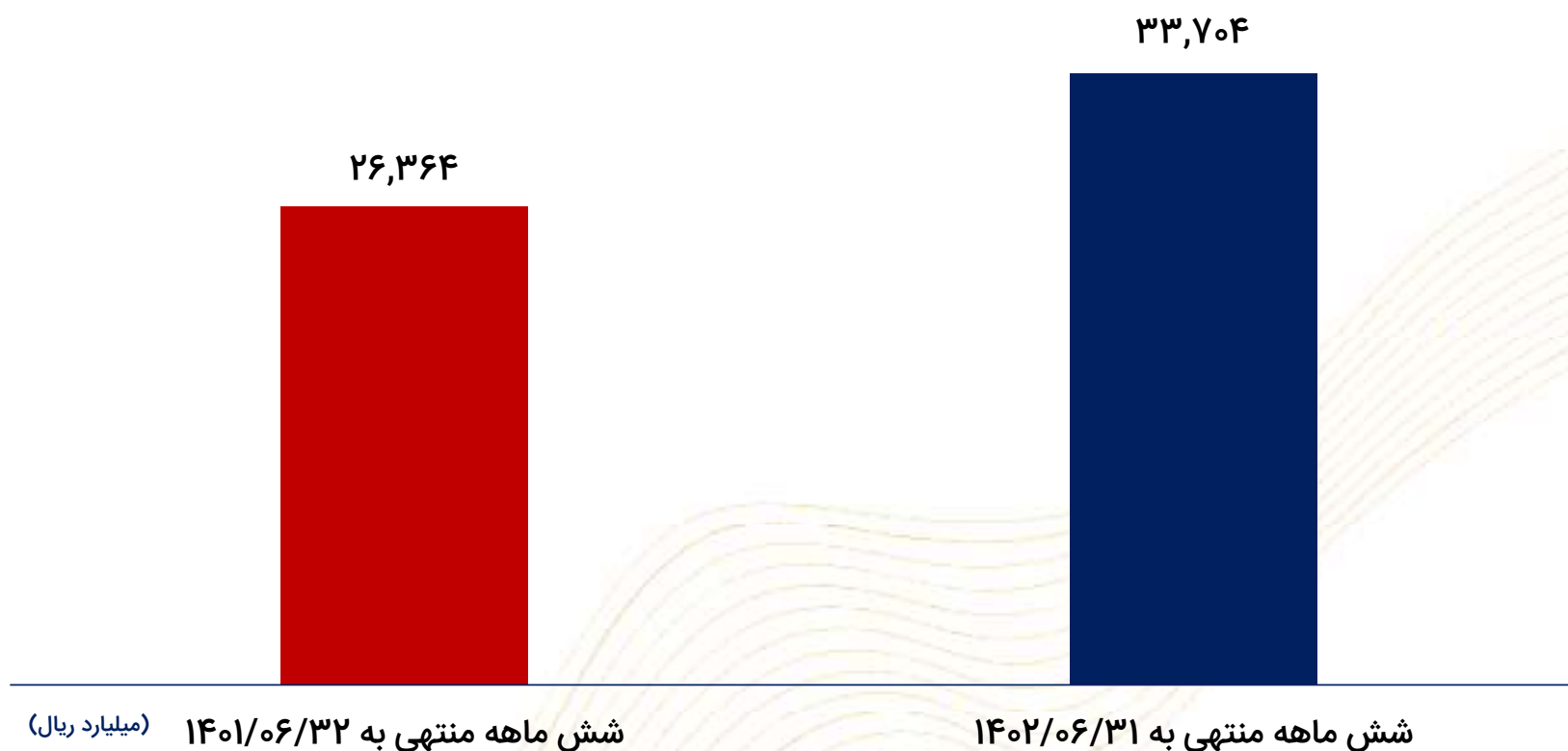


بخش هشتم:

معاملات سهام صندوق

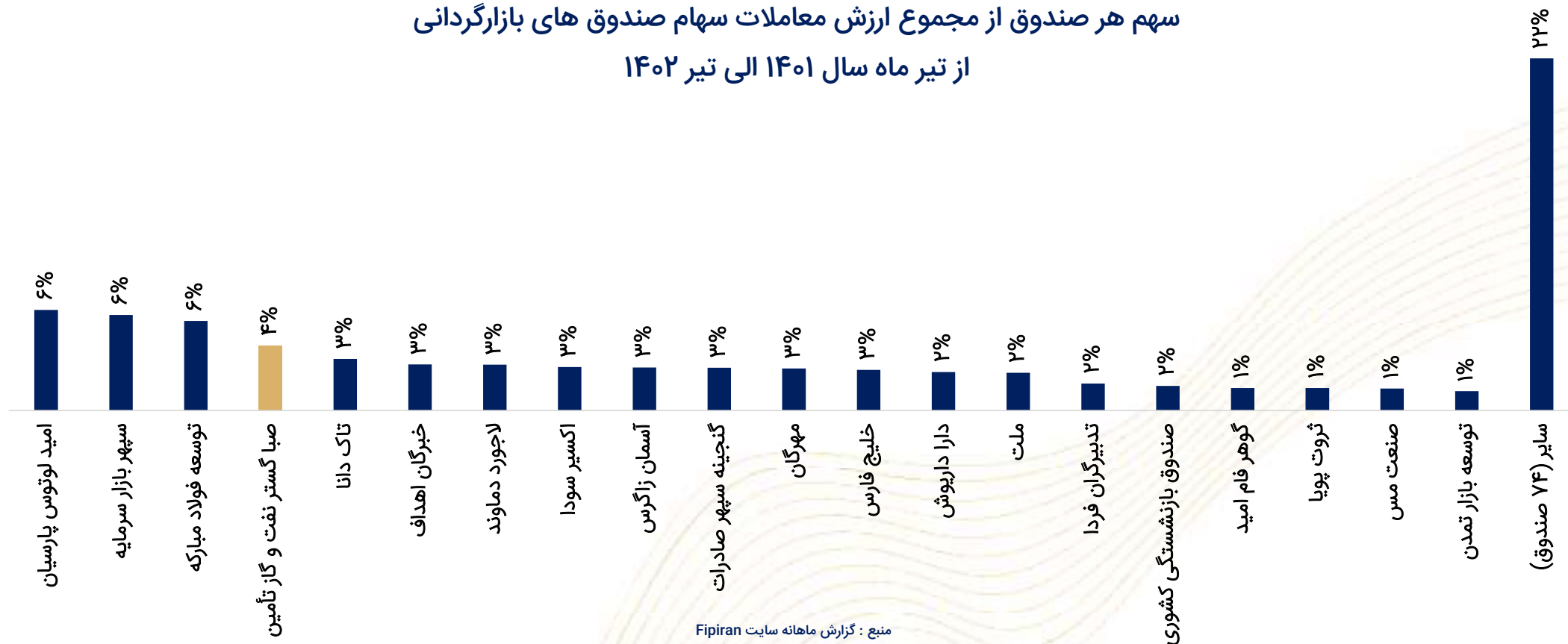
ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر

با توجه به افزایش ارزش معاملات در بازار سرمایه، در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۲ نسبت به مدت مشابه سال گذشته ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر افزایش ۲۸ درصدی را تجربه کرده است

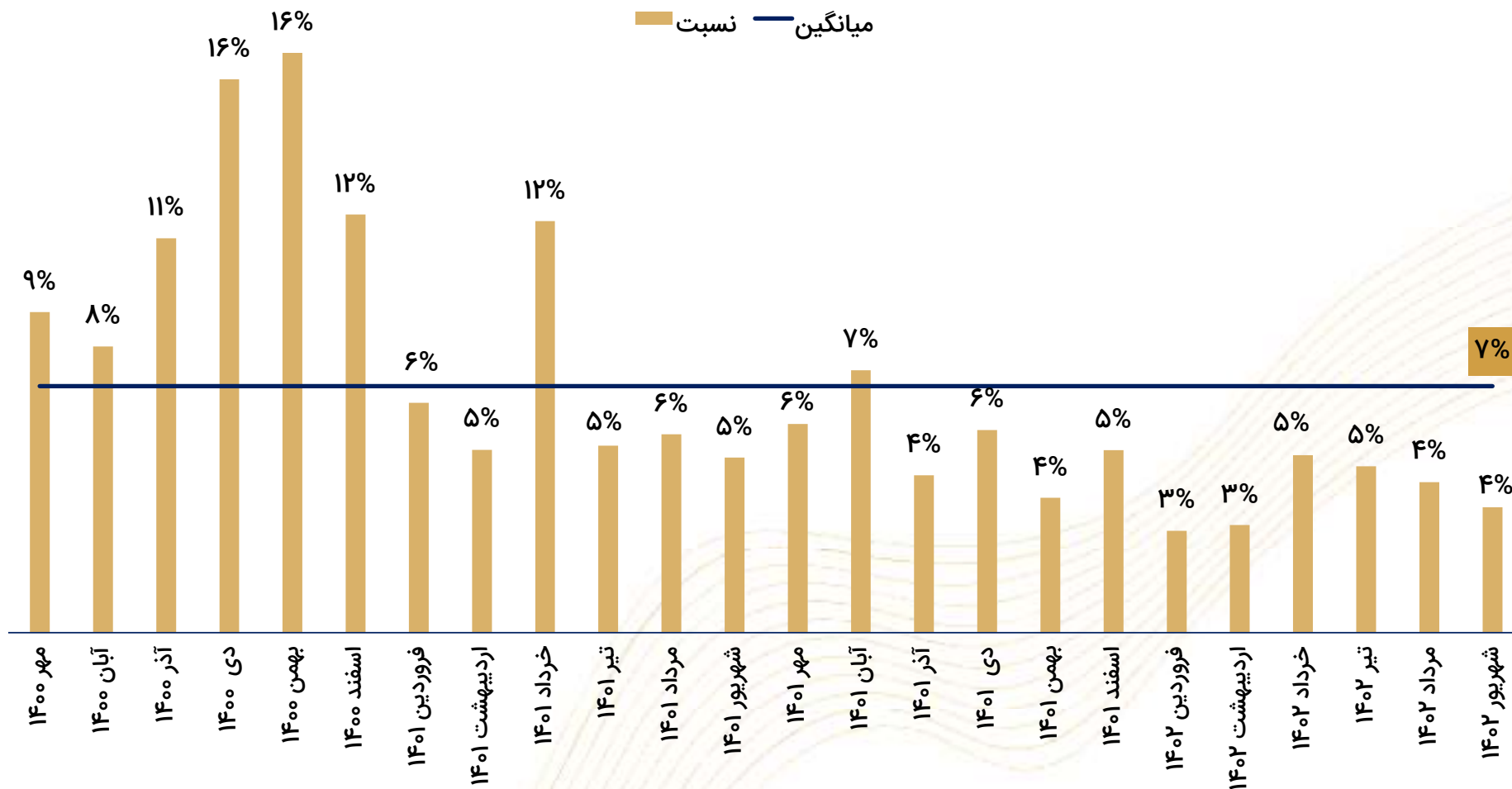


چهارمین صندوق فعال بازارگردانی بازار سرمایه کشور با در اختیار داشتن سهم ۴ درصدی از کل ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

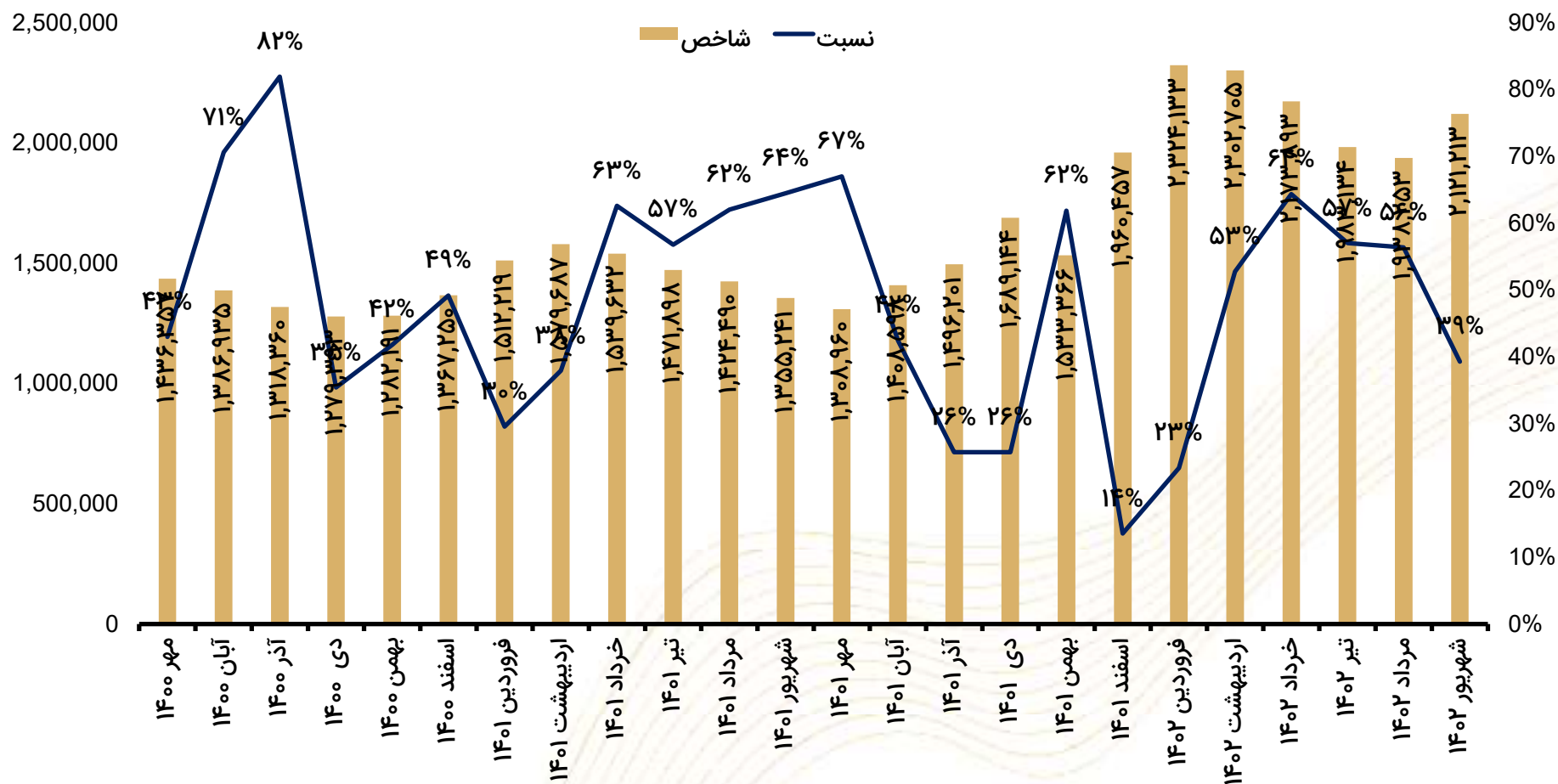
سهم هر صندوق از مجموع ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی
از تیر ماه سال ۱۴۰۱ الی تیر ۱۴۰۲



روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملات نمادهای موضوع 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 ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۸۱۷	۱,۶۳۳	۲,۴۴۹	۳۳%	۱.۹%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۱۹۷	۳۸۱	۵۷۸	۳۴%	۲%
سر. صبا تامین	صبا	۶۸۱	۵۱۴	۱,۱۹۶	۵۷%	۶%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۱۱۳	۱۱۱	۲۲۴	۵۰%	۲%
سر. سیمان تامین	سیتا	۵۶	۱۲۳	۱۷۹	۳۱%	۱%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۷۷	۸۵	۱۶۲	۴۸%	۴%
مجموع		۱,۹۴۱	۲,۸۴۷	۴,۷۸۸		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۲۱۱	۱۴۶	۳۵۷	۵۹%	۲.۲%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۶۸	۹۹	۱۶۸	۴۱%	۲%
نفت پاسارگاد	شپاس	۱۵۳	۲۷۲	۴۲۵	۳۶%	۷%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۱۹۲	۱۴۵	۳۳۷	۵۷%	۳%
نفت ایرانول	شرانل	۹۱	۱۹۹	۲۹۱	۳۱%	۷%
صنعتی بارز	پکرمان	۸۸	۱۲۲	۲۱۰	۴۲%	۵%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۱۲	۱۵۴	۲۶۶	۴۲%	۳%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۲۰۴	۳۶۸	۵۷۲	۳۶%	۱۶%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۲۸۱	۲۸۱	۵۶۲	۵۰%	۶%
مجموع		۱,۴۰۰	۱,۷۸۶	۳,۱۸۷		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۷۶	۷۸	۱۵۴	۴۹%	۴%
مس باهنر	فباهر	۷۹	۸۶	۱۶۴	۴۸%	۰.۶%
معدنی املاح ایران	شاملا	۹۹	۲۱۴	۳۱۳	۳۲%	۴%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۰۸	۱۱۸	۲۲۶	۴۸%	۶%
کاشی سعدی	کسعدی	۱۳۲	۹۹	۲۳۱	۵۷%	۴%
کاشی الوند	کلوند	۱۱۴	۶۵	۱۷۸	۶۴%	۵%
زغال پرورده طبس	کزغال	۲۷۷	۲۱۵	۴۹۲	۵۶%	۵%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۳۴	۱۶۷	۳۰۱	۴۴%	۳%
لعبیران	شلعاب	۲۶۰	۲۳۱	۴۹۱	۵۳%	۲%
مجموع		۱,۲۷۹	۱,۲۷۲	۲,۵۵۱		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۱۰۵	۱۲۹	۲۳۴	۴۵%	۳%
پارس دارو	دپارس	۷۸	۹۵	۱۷۴	۴۵%	۵%
دارو اکسیر	دلر	۵۵	۸۶	۱۴۱	۳۹%	۳%
دارو فارابی	دفارا	۸۹	۱۲۹	۲۱۸	۴۱%	۲%
داروسازی قاضی	دقاضی	۴۲	۱۵۶	۱۹۸	۲۱%	۱۱۶%
کارخانجات داروپخش	دارو	۲۸	۵۵	۸۲	۳۳%	۳%
دارو زهراوی	دزهراوی	۸۴	۹۹	۱۸۲	۴۶%	۴%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۱۵۲	۱۱۲	۲۶۴	۵۸%	۴%
دارو رازک	درازک	۷۶	۷۴	۱۵۰	۵۱%	۲%
پخش هجرت	هجرت	۱۰۵	۱۳۰	۲۳۵	۴۵%	۴%
مواد داروپخش	دتماد	۸۴	۹۸	۱۸۲	۴۶%	۴%
کلر پارس	کلر	۱۶۵	۱۲۰	۲۸۵	۵۸%	۲%
دارو ابوریحان	دابور	۶۲	۳۴	۹۵	۶۵%	۵%
کاسپین تامین	کاسپین	۸۲	۱۱۰	۱۹۲	۴۳%	۶%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۲۹	۱۴۳	۲۷۲	۴۷%	۴%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۱۰۰	۱۴۳	۲۴۴	۴۱%	۵%
شیرین دارو	دشیری	۹۷	۱۰۸	۲۰۵	۴۷%	۱۸%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۹۴	۹۰	۱۸۴	۵۱%	۵%
دارویی ره آورد تامین	درهآور	۳۴۲	۲۸۶	۶۲۸	۵۵%	۷%
مجموع		۱,۹۶۹	۲,۱۹۶	۴,۱۶۵		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۱۴۷	۱۵۲	۲۹۸	۴۹%	۲%
سیمان صوفیان	سصوفی	۵۱	۴۲	۹۳	۵۵%	۲%
سیمان ارومیه	ساروم	۷۲	۶۳	۱۳۵	۵۳%	۳%
سیمان قائن	سقاین	۸۲	۱۷۷	۲۵۹	۳۲%	۵%
سیمان شاهرود	سرود	۷۶	۹۳	۱۶۹	۴۵%	۴%
سیمان ساوه	ساوه	۱۴۹	۱۲۴	۲۷۳	۵۴%	۴%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۱۴	۶۳	۱۷۷	۶۴%	۵%
سیمان فارس	سفار	۲۹۲	۶۷۶	۹۶۹	۳۰%	۱۲%
سیمان خزر	سخزر	۱۲۶	۱۸۶	۳۱۳	۴۰%	۳%
سیمان فارس نو	سفانو	۷۹	۷۸	۱۵۷	۵۰%	۴%
سیمان بجنورد	سبجنو	۶۲	۸۳	۱۴۵	۴۳%	۴.۴%
سیمان بهبهان	سبهان	۱۴۲	۱۳۴	۲۷۶	۵۱%	۳%
سیمان غرب	سغرب	۸۰	۹۳	۱۷۳	۴۶%	۷%
سیمان خاش	سخاش	۳۵	۴۷	۸۲	۴۳%	۲%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۲۰۳	۱۹۳	۳۹۶	۵۱%	۶%
سیمان دورود	سدور	۸۵	۱۱۷	۲۰۲	۴۲%	۳%
فارسیت اهواز	سفاسی	۱۳۲	۱۳۱	۲۶۳	۵۰%	۱۰%
سیمان آبیک	سآبیک	۱۸۸	۳۵۴	۵۴۲	۳۵%	۷%
مجموع		۲,۱۱۵	۲,۸۰۶	۴,۹۲۱		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره شش ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۶/۳۱

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	لیارس	۴۳۲	۴۸۳	۹۱۵	۴۷%	۴%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۵۶۲	۵۸۰	۱,۱۴۲	۴۹%	۸%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۲۴۱	۴۱۸	۶۵۸	۳۷%	۳%
کشت و دام گلدهشت نمونه اصفهان	زگلدهشت	۳۷۷	۳۸۹	۷۶۶	۴۹%	۱۱%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۱۳۰	۱۰۲	۲۳۲	۵۶%	۲۳%
مجموع		۱,۷۴۲	۱,۹۷۱	۳,۷۱۳		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۵۶	۵۹	۱۱۶	۴۹%	۶%
کربن ایران	شکربن	۱۶۰	۲۰۰	۳۶۰	۴۴%	۳%
لوله و گاز	پلوله	۱۴۲	۱۴۶	۲۸۸	۴۹%	۱۰%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۷۰	۹۱	۱۶۱	۴۳%	۴%
تکین کو	رتکو	۰	۴۰	۴۰	۰%	۲%
مجموع		۴۲۸	۵۳۷	۹۶۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سلولزی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۲۶۹	۲۰۶	۴۷۵	۵۷%	۴%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۵۲۵	۶۲۲	۱,۱۴۷	۴۶%	۱۱%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۱۰۶	۱۹۴	۳۰۰	۳۵%	۹%
مجموع		۹۰۰	۱,۰۲۲	۱,۹۲۲		

خرید و فروش بازارگردان در سایر مجموعه ها

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۶/۳۱ (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	۲۱۵	۲۱۴	۴۲۹	۵۰%	۸%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۴۶۹	۴۳۰	۸۹۹	۵۲%	۵%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۶۶۳	۲۴۷	۹۱۰	۷۳%	۳۱%
سرمایه گذاری هامون صبا	وهامون	۱۳۸	۱۹۷	۳۳۵	۴۱%	۶%
ذوب آهن اصفهان	ذوب	۶۲۸	۵۳۸	۱,۱۶۵	۵۴%	۱%
پالایشگاه نفت اصفهان	شپنا	۱۹۷	۱۵۸	۳۵۵	۵۶%	۰.۱۷%
مجموع		۲,۳۱۰	۱,۷۸۳	۴,۰۹۳		

۳۴.۱۴ درصد میانگین بازدهی شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۲

درحالی‌که در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۲ بازده شاخص کل ۸.۲٪ بوده است، ۶۲ نماد (۷۵ درصد) از شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در شش ماهه نخست سال ۱۴۰۲

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
لپارس	۱۶۶.۱۲	دکپسول	۵۶.۷۸	ددام	۳۹.۴۶	سبهان	۳۰.۵۶	سقاین	۱۷.۷۰	شکرین	۶.۱۷	لخانه	-۲.۱۷
دپارس	۱۳۵.۵۶	کخاک	۵۳.۶۳	کزغال	۳۹.۴۱	سرخاش	۲۹.۸۹	دشیری	۱۶.۶۹	زملارد	۵.۰۲	لطیف	-۶.۰۲
شاوان	۱۲۳.۶۴	مداران	۵۲.۷۱	وپترو	۳۹.۱۴	سخرز	۲۹.۶۳	دشیمی	۱۶.۶۹	زگلدشت	۴.۸۳	فباهتر	-۶.۹۷
شپترو	۱۲۲.۵۶	دابور	۵۲.۳۱	شستا	۳۸.۰۷	سرخوز	۲۹.۲۵	چخرز	۱۶.۶۴	زفکا	۴.۰۶	شاملا	-۷.۷۶
شکبیر	۱۱۰.۲۲	دلر	۵۱.۶۰	تیپیکو	۳۶.۴۳	سدور	۲۹.۰۱	پکرمان	۱۶.۵۴	کمر	۳.۷۹	دتماد	-۹.۴۳
خراسان	۱۰۸.۷۹	درازک	۴۹.۷۴	سیتا	۳۶.۱۲	ساوه	۲۸.۱۴	سفاسی	۱۵.۱۵	رتکو	۲.۰۳	شرانل	-۱۲.۷۷
شغدیر	۷۸.۰۲	دزهرای	۴۸.۲۳	صبا	۳۵.۹۳	سنیر	۲۷.۳۵	کفرا	۱۴.۹۰	پلوله	۱.۷۸	شپاس	-۱۳.۵۸
شفارا	۷۶.۵۴	دفارا	۴۸.۱۱	تاصیکو	۳۵.۶۶	سرود	۲۵.۵۸	چکارن	۱۳.۰۶	پسهند	۱.۶۰	شکمر	-۱۴.۳۴
شفن	۷۰.۹۸	ویخش	۴۷.۶۲	تاپیکو	۳۵.۰۵	سصوفی	۲۴.۱۸	دارو	۹.۴۲	شلعاب	۱.۱۹		
هجرت	۶۳.۹۹	دقاضی	۴۴.۰۹	وهامون	۳۴.۴۳	سغرب	۲۳.۷۶	کاسپین	۸.۹۴				
کپشیر	۶۲.۶۴	دره‌آور	۴۲.۴۸	سآبیک	۳۳.۵۷	سفار	۲۳.۴۱	کلوند	۷.۸۸				
آباد	۶۱.۱۱	شدوص	۴۰.۴۹	ساروم	۳۲.۵۶	سفانو	۱۹.۳۵	کسعدی	۶.۹۲				
دتوزیع	۵۹.۶۸	ذوب	۴۰.۲۷	سبجنو	۳۲.۱۶	سفارس	۱۹.۰۷	چکاو	۶.۱۹				



بخش دهم:

اهم اقدامات انجام شده و برنامه

های آتی صندوق

برنامه های آتی صندوق

✓ بهبود عملکرد و بهینه سازی ایفای تعهدات فعلی بازارگردانی

✓ تکمیل و بهبود سامانه زیرک

✓ افزایش تعداد نمادهای موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق های کلایی و ...