



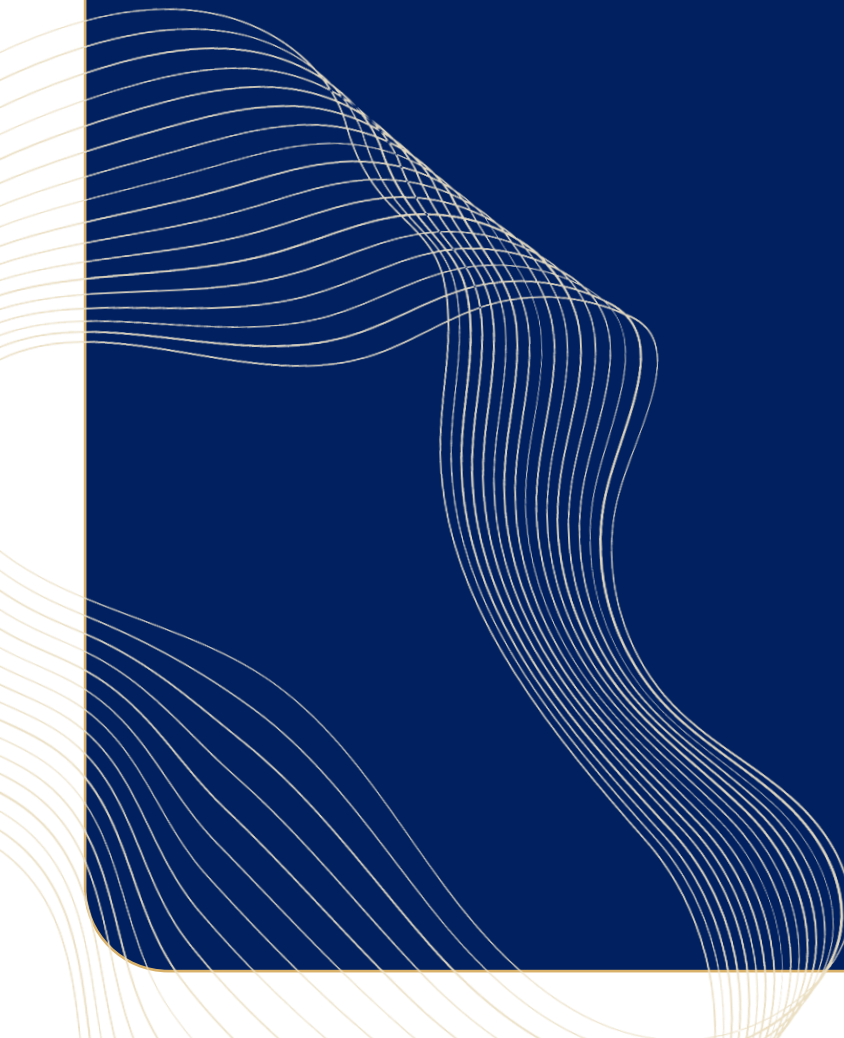
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

מסורת
מסורת



فهرست





مقدمه و معرفی

اركان و واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

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

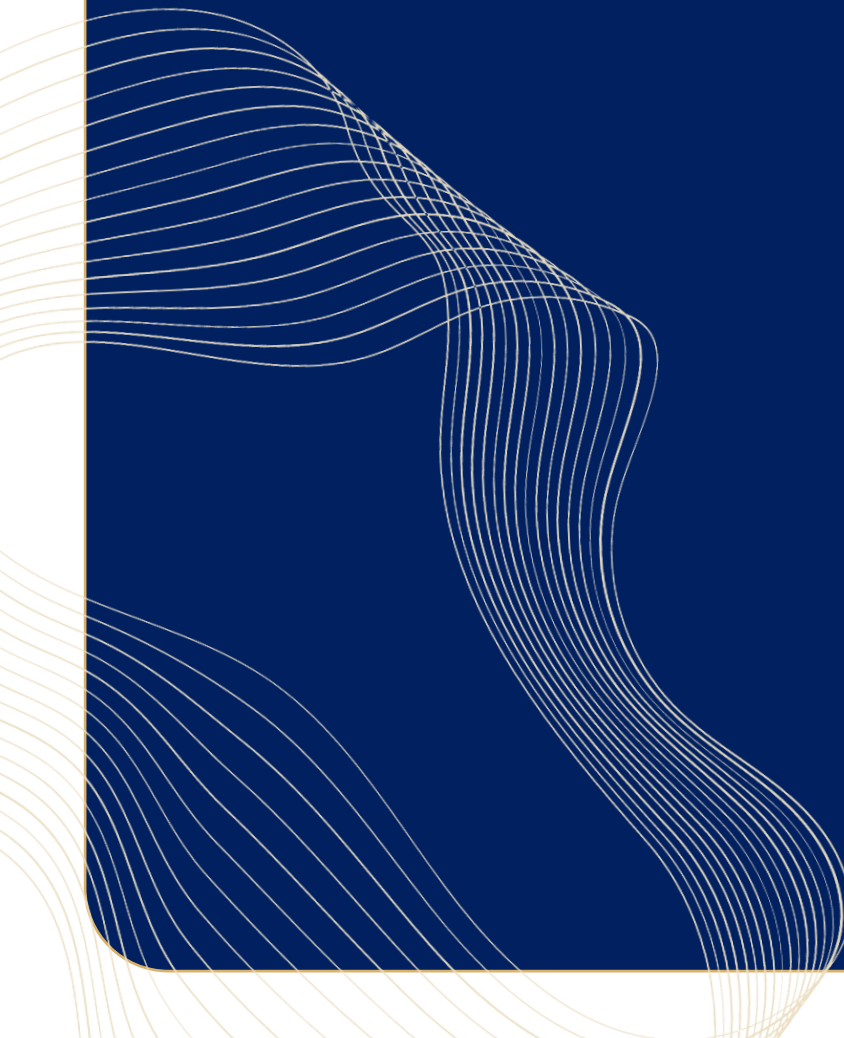
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه

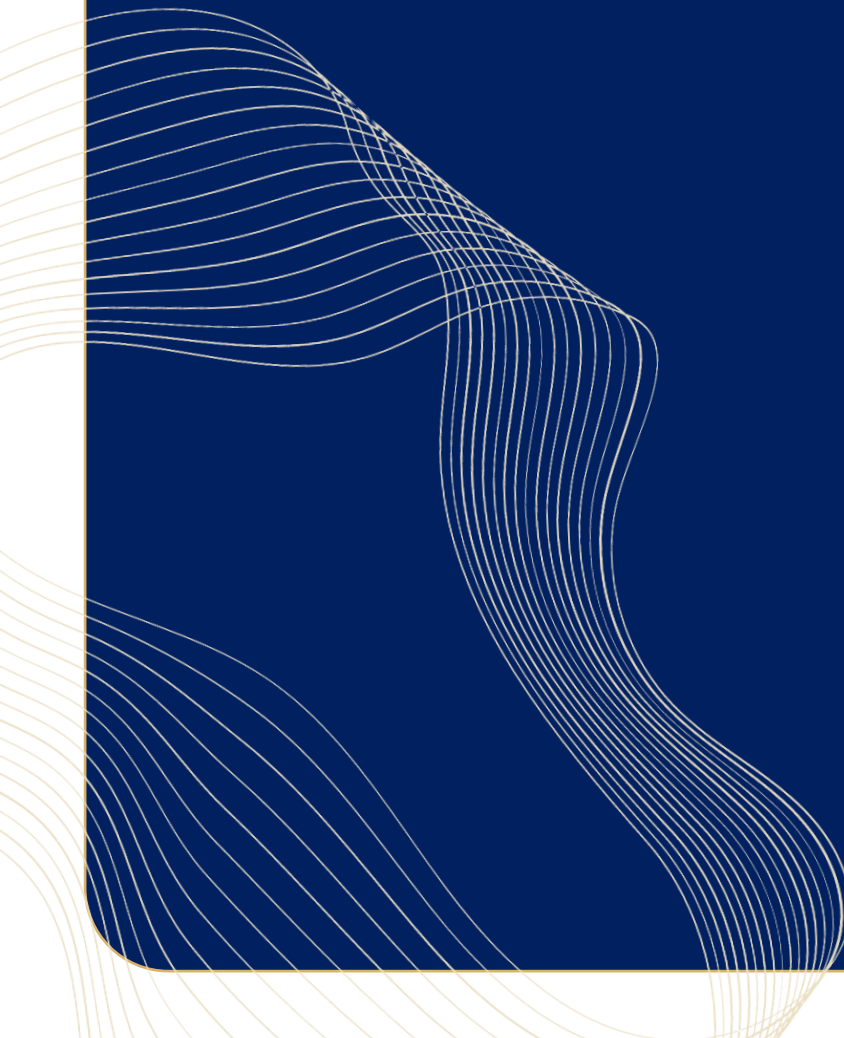
صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد. بلکه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

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 ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۸۴ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازار سرمایه کشور از این حیث شناخته می‌شود.

در این تاریخ خالص ارزش دارایی‌های صندوق ۱۲۸,۴۸۱ میلیارد ریال می‌باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ افزایش ۵۰ درصدی داشته است.



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

رکن	دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰	دوره منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
مدیر	شرکت سبدگردان اندیشه صبا	شرکت سبدگردان اندیشه صبا
متولی	موسسه حسابرسی رهیافت	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز
حسابرس	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر	موسسه حسابرسی و خدمات مالی فاطر
کارگزار	شرکت کارگزاری صبا تامین و بانک رفاه کارگران	شرکت کارگزاری صبا تامین

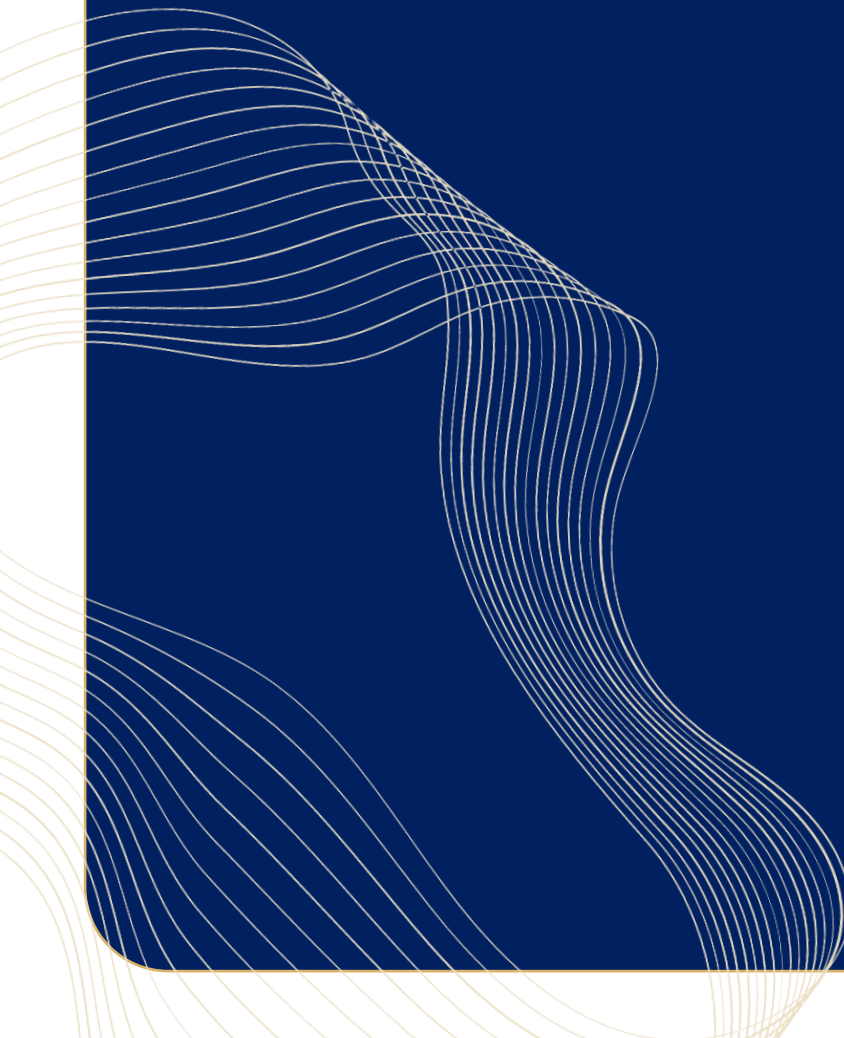
در دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ رکن متولی و کارگزار (کارگزاری بانک رفاه کارگران اضافه گردیده است) صندوق تغییر کرده‌اند و سایر ارکان نسبت به دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ بدون تغییر بوده است.

واحدهای سرمایه گذاری صندوق



سبدگردان
اندیشه صبا

نوع واحد	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱۴۰۲/۰۹/۳۰	67,557,612
ممتاز	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	شرکت گروه مالی صبا تأمین
ممتاز	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	شرکت سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین
ممتاز	۸۹۶	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

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 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

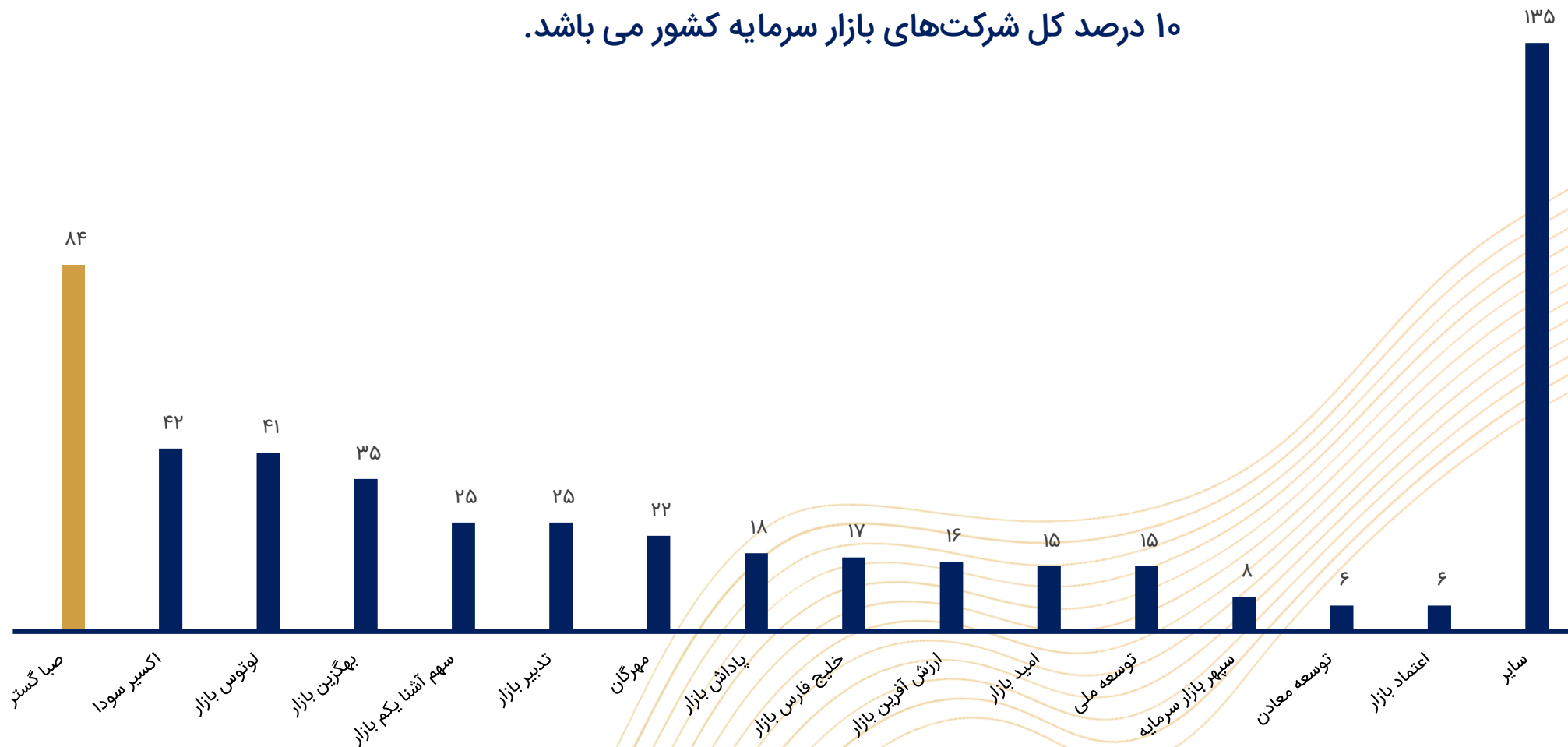


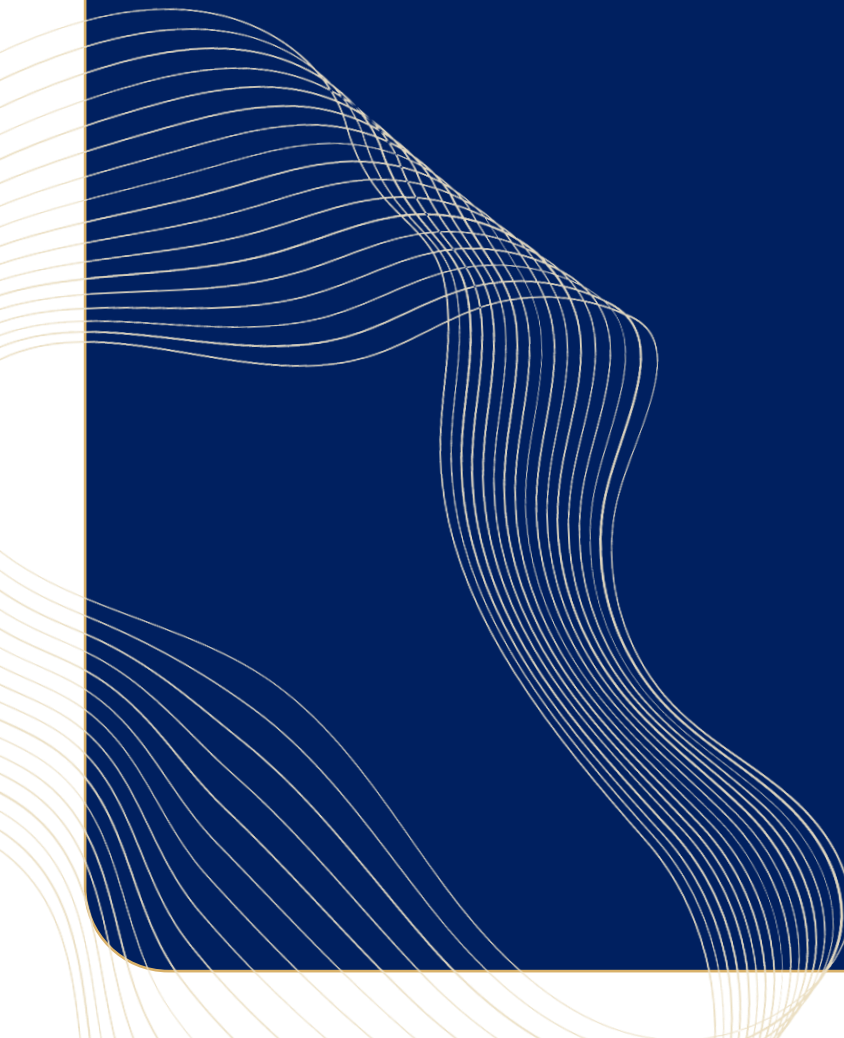
سبذگردان
اندیشه صبا

نماد						هلدینگ
تپیپکو	سیتا	تاصیکو	صبا	تاپیکو	شستا	هلدینگ شستا
پکرمان	شرانل	شغدیر	شپاس	خراسان	شفن	هلدینگ تاپیکو
		شکلر	شپترو	شفارا	وپترو	
دارو	دقاضی	دفارا	دلر	دیپارس	ویپخش	هلدینگ تپیپکو
کمر	دتماد	هجرت	درازک	دتوزیع	دزهرای	
دکپسول	دشیری	ددام	دشیمی	کاسپین	دابور	
					درهآور	
کلوند	کسعدی	کفرا	شاملا	فباهر	کخاک	هلدینگ تاصیکو
		ذوب	شلعاب	کزغال	کپشیر	
ساوه	سرود	سقاین	ساروم	سصوفی	سفارس	هلدینگ سیتا
سبهان	سبجنو	سفانو	سخرز	سفار	سخوز	
سآبیک	سفاسی	سدور	سنیر	سخاش	سغرب	
	لخانه	زگلدشت	زملارد	زفکا	لپارس	هلدینگ صنایع عمومی
	پلوله	رتکو	شدوص	شکربن	پسهند	هلدینگ وپترو
			لطیف	چخزر	چکاو	هلدینگ سلولزی
		شپنا	شکبیر	شاوان	مداران	بانک رفاه
				حخرز	حکشتی	هلدینگ کشتیرانی جمهوری اسلامی
					آباد	هلدینگ هگتا
صندوق پتروصبا	اوراق گام توسعه تعاون	صندوق دیبا	صندوق نفیس	صندوق اوصتا	وهامون	هلدینگ صبا تامین

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

صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی ۸۴ نماد، بازارگردان ۱۰ درصد کل شرکتهای بازار سرمایه کشور می باشد.





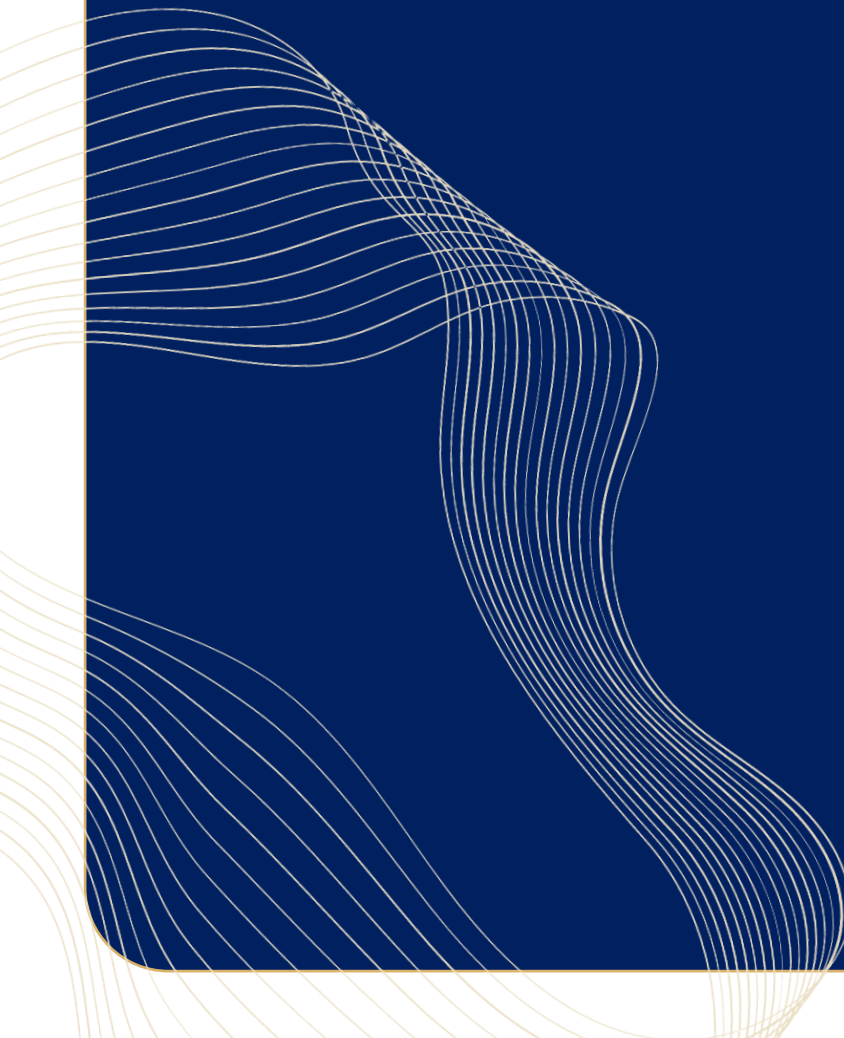
بخش چهارم:

صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰
درآمد ها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۳,۹۲۶,۷۸۷	۲,۱۳۴,۰۳۶
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۰,۷۲۶,۲۱۱	۳,۲۱۸,۱۰۹
سود سهام	۱۰,۷۹۷,۴۲۹	۸,۵۴۸,۳۰۹
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۵۷۱,۵۲۸	۵۰۲,۴۲۵
درآمد حاصل از بازارگردانی	۴۰,۳۰۵	۱۸,۲۲۴
سایر درآمدها	۳,۲۹۱	۴۴,۸۳۵
جمع درآمدها	۲۶,۰۶۵,۵۵۲	۱۴,۴۶۵,۹۴۱
هزینه ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۷۰۸,۱۷۳)	(۵۱۵,۵۷۸)
هزینه مالی	(۹,۰۴۷)	(۱۴۱,۴۳۶)
سایر هزینه ها	(۲۶,۱۶۱)	(۱۶,۸۳۵)
جمع هزینه ها	(۷۴۳,۳۸۱)	(۶۷۳,۸۵۰)
سود (زیان)خالص	۲۵,۳۲۲,۱۷۰	۱۳,۷۹۲,۰۹۰



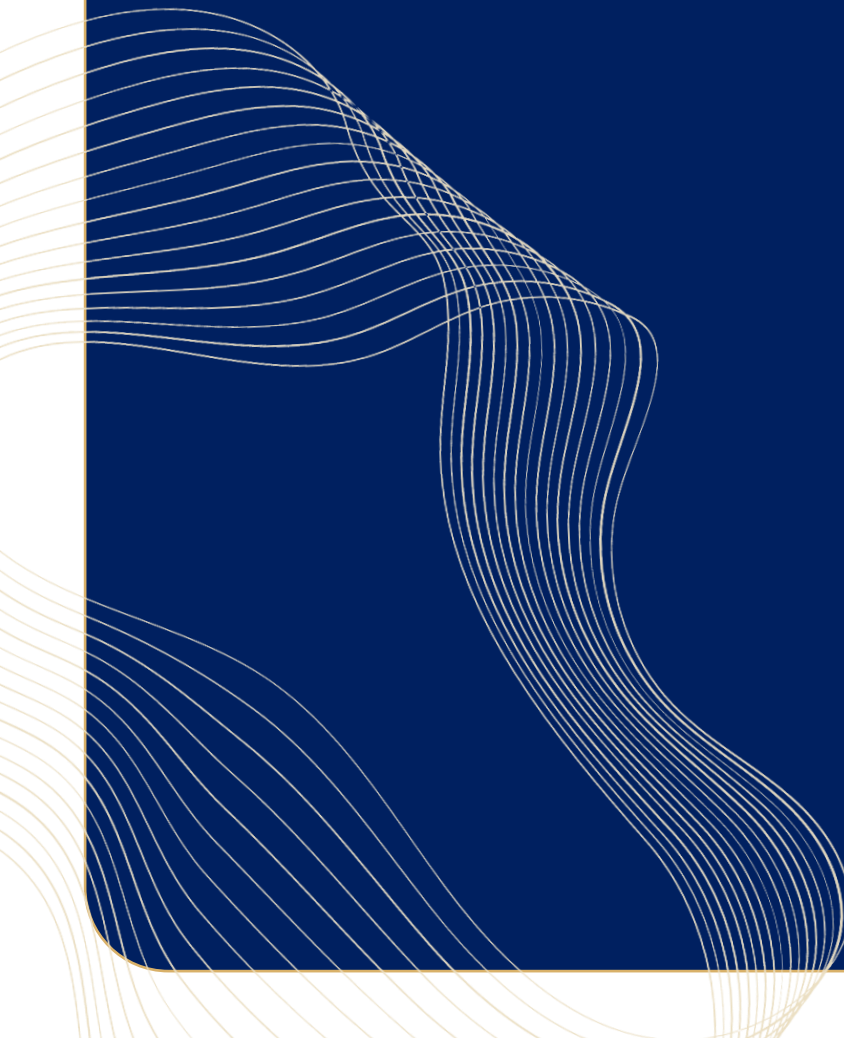
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی‌ها

صورت خالص دارایی‌ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۲/۰۹/۳۰	۱۴۰۱/۱۲/۲۹
دارایی‌ها :		
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۹۵,۳۰۳,۵۲۷	۷۹,۹۲۵,۵۳۳
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۱۲۹,۱۸۶	۳۴۷,۶۱۸
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۲,۳۰۴,۶۰۵	۳,۶۹۰,۲۷۱
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۲۳,۰۰۲,۳۴۳	۱۶,۹۵۳,۲۹۶
حساب‌های دریافتی	۷,۵۶۴,۸۳۲	۶,۱۰۸,۷۴۹
سایر دارایی‌ها	۸,۹۳۵	۰
موجودی نقد	۶۴	۰
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۴۹۷,۲۹۰	۸۳۹,۰۱۷
جمع دارایی‌ها	۱۲۸,۸۱۰,۲۴۶	۱۰۷,۸۶۴,۴۸۵
بدهی‌ها :		
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۰	۰
پرداختی به ارکان صندوق	۳۱۰,۲۰۳	۱۹۹,۶۸۷
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۱۹,۳۳۶	۱۷,۶۰۳
بدهی به سرمایه‌گذاران	۱۶۰	۱,۵۰۰,۱۶۲
جمع بدهی‌ها	۳۲۹,۶۹۹	۱,۷۱۷,۴۵۲
خالص دارایی‌ها	۱۲۸,۴۸۰,۵۴۶	۱۰۶,۱۴۷,۰۳۴
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری	۱,۸۲۹,۲۵۹	۱,۵۲۶,۱۶۸

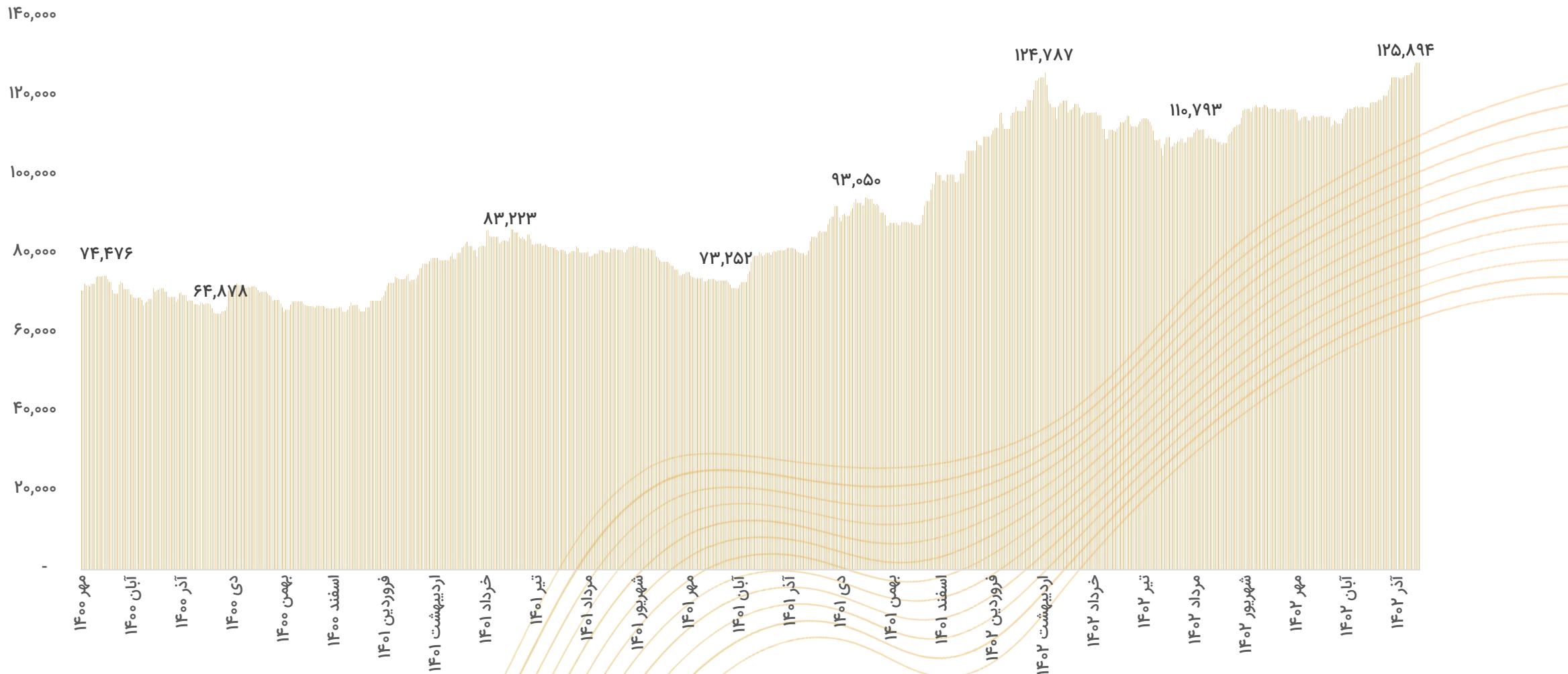


بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق

روند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

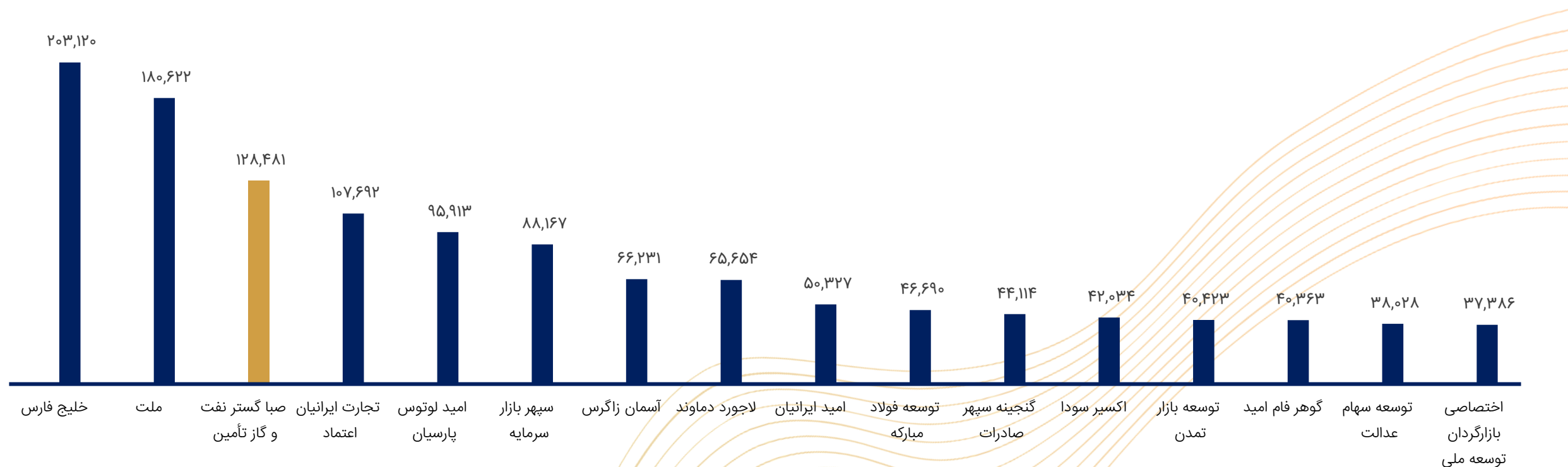
در تاریخ ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۱۲۸,۴۸۱ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰ افزایش ۵۰ درصدی را تجربه کرده است.

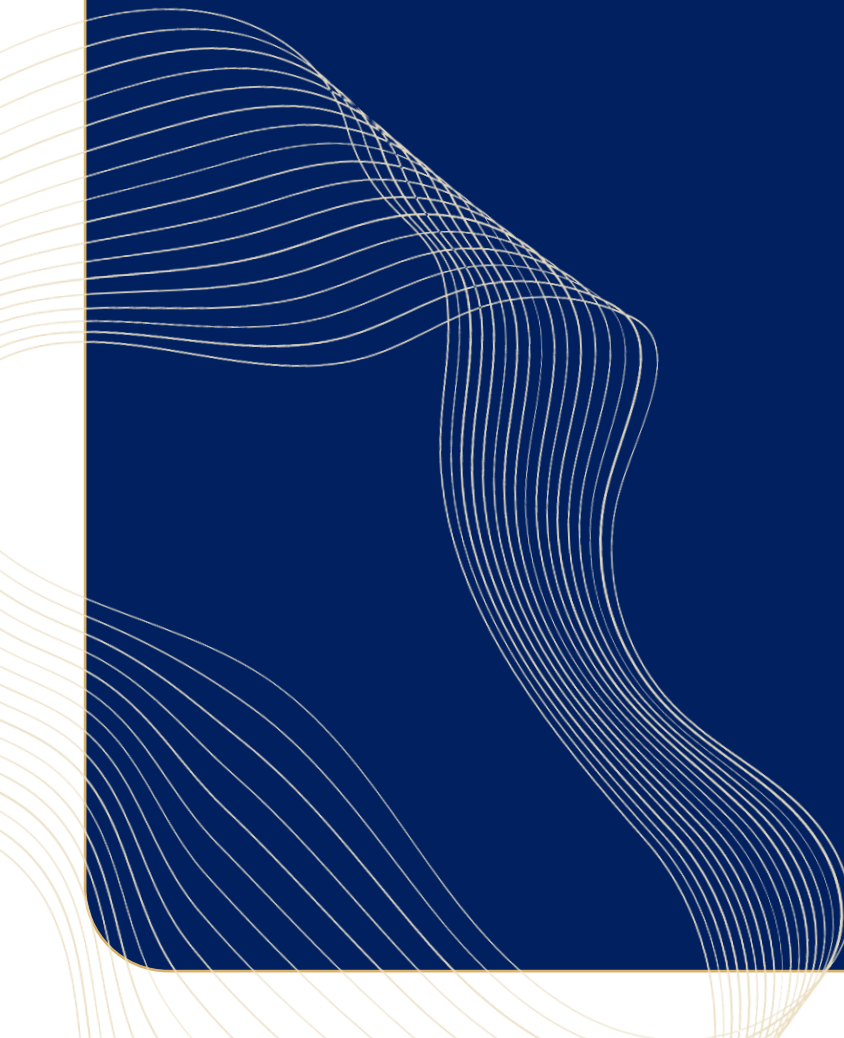


گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

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

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (میلیارد ریال)





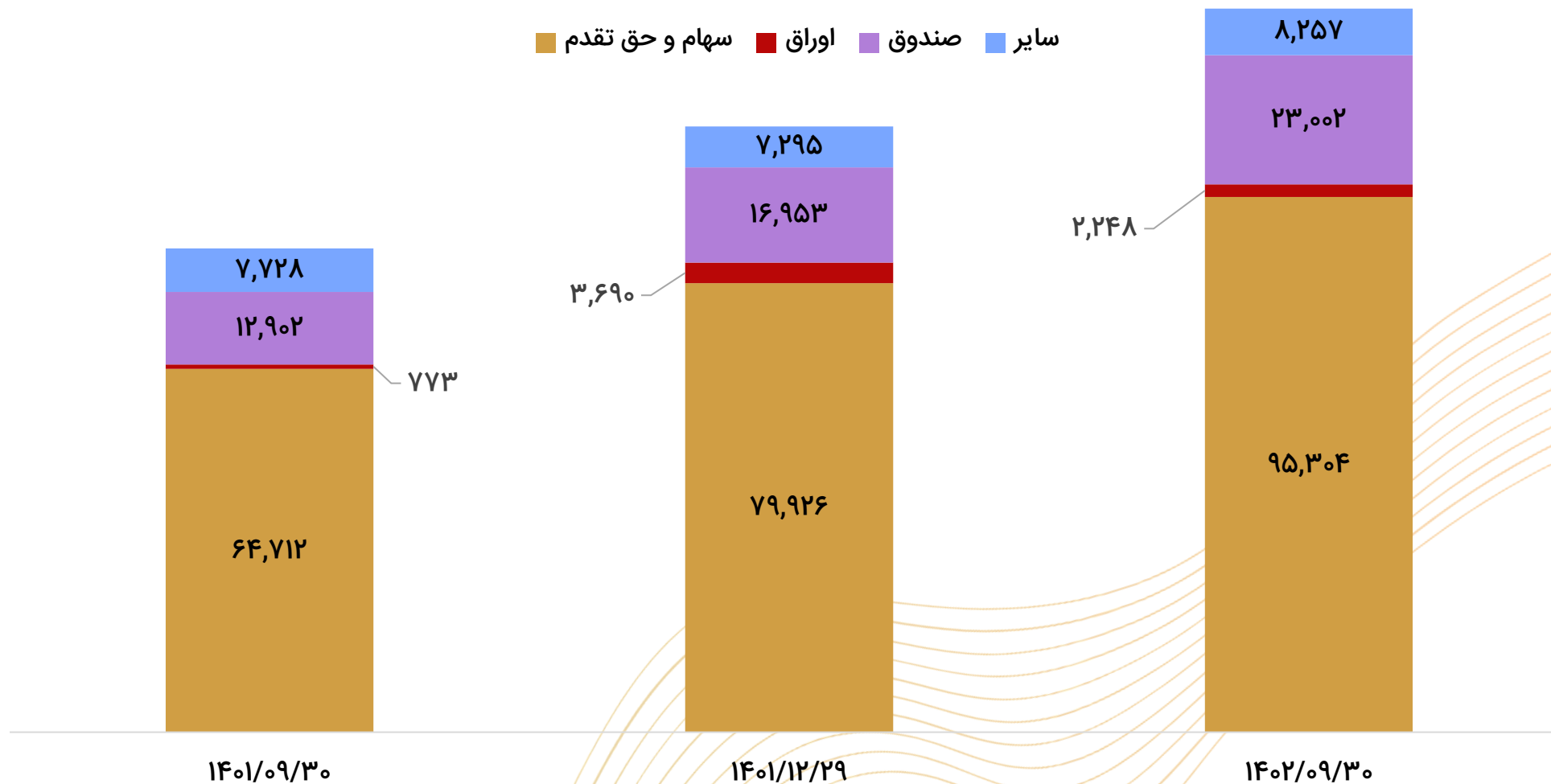
بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

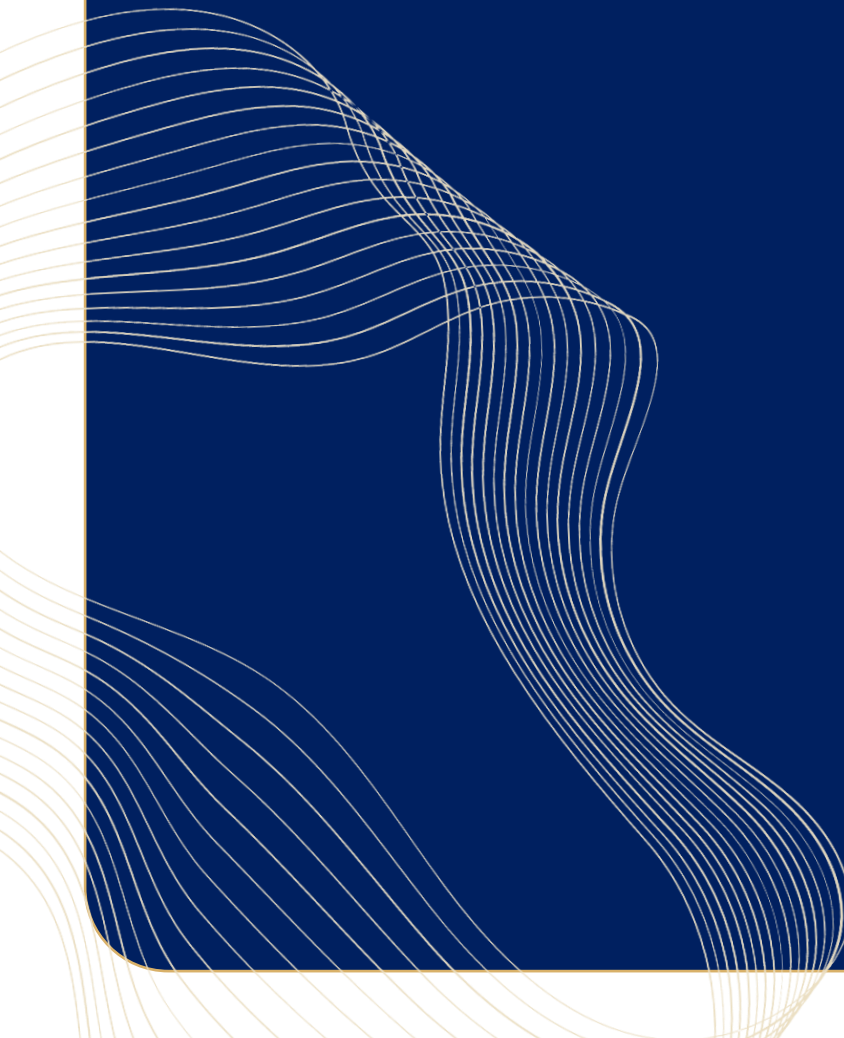
ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)

سایر صندوق اوراق سهام و حق تقدم



عمده (۹۲ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتنی (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 نه ماهه نخست سال
۱۴۰۲ نسبت به مدت مشابه سال گذشته ارزش معاملات خرد سهام صندوق
صباگستر افزایش ۶.۳ درصدی را تجربه کرده است

۴۰,۶۰۹

۳۸,۲۰۲

(میلیارد ریال)

نه ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۹/۳۰

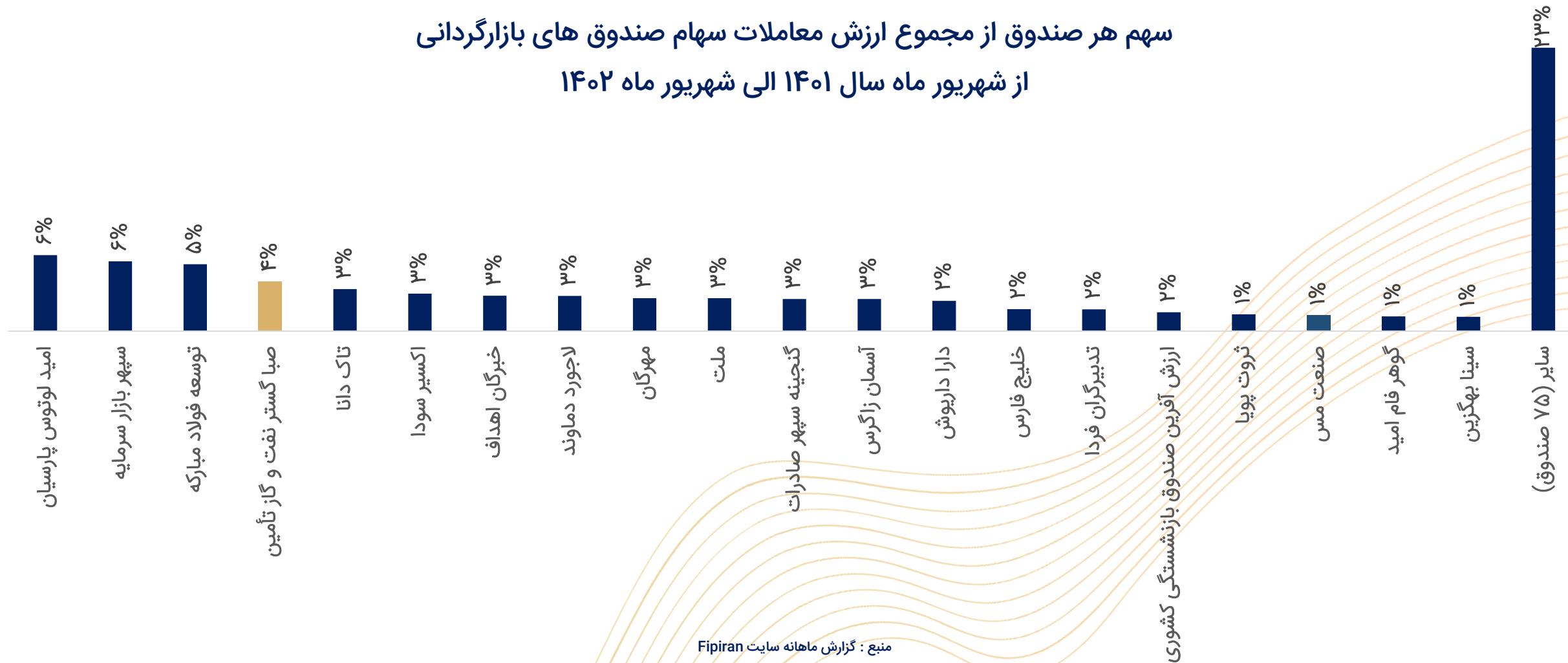
نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

چهارمین صندوق فعال بازارگردانی بازار سرمایه کشور

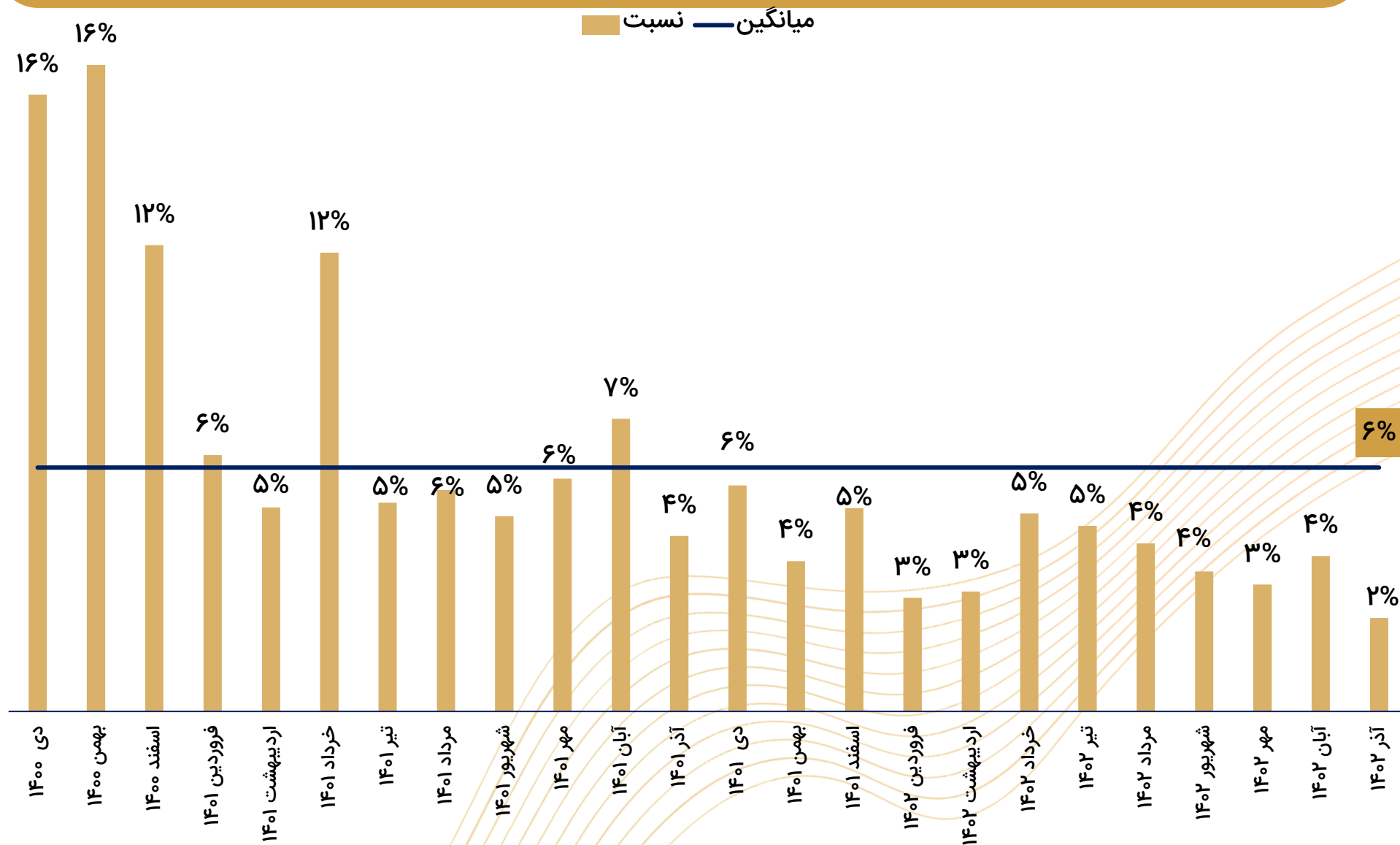
با در اختیار داشتن سهم ۴ درصدی از کل ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

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



منبع: گزارش ماهانه سایت Fipiran

روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملاتی موضوع بازارگردانی



گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

روند سهم خرید از ارزش معاملات ماهانه صندوق صباگستر



سبدگردان
اندیشه صبا

۲,۵۰۰,۰۰۰

۲,۰۰۰,۰۰۰

۱,۵۰۰,۰۰۰

۱,۰۰۰,۰۰۰

۵۰۰,۰۰۰

۹۰%

۸۰%

۷۰%

۶۰%

۵۰%

۴۰%

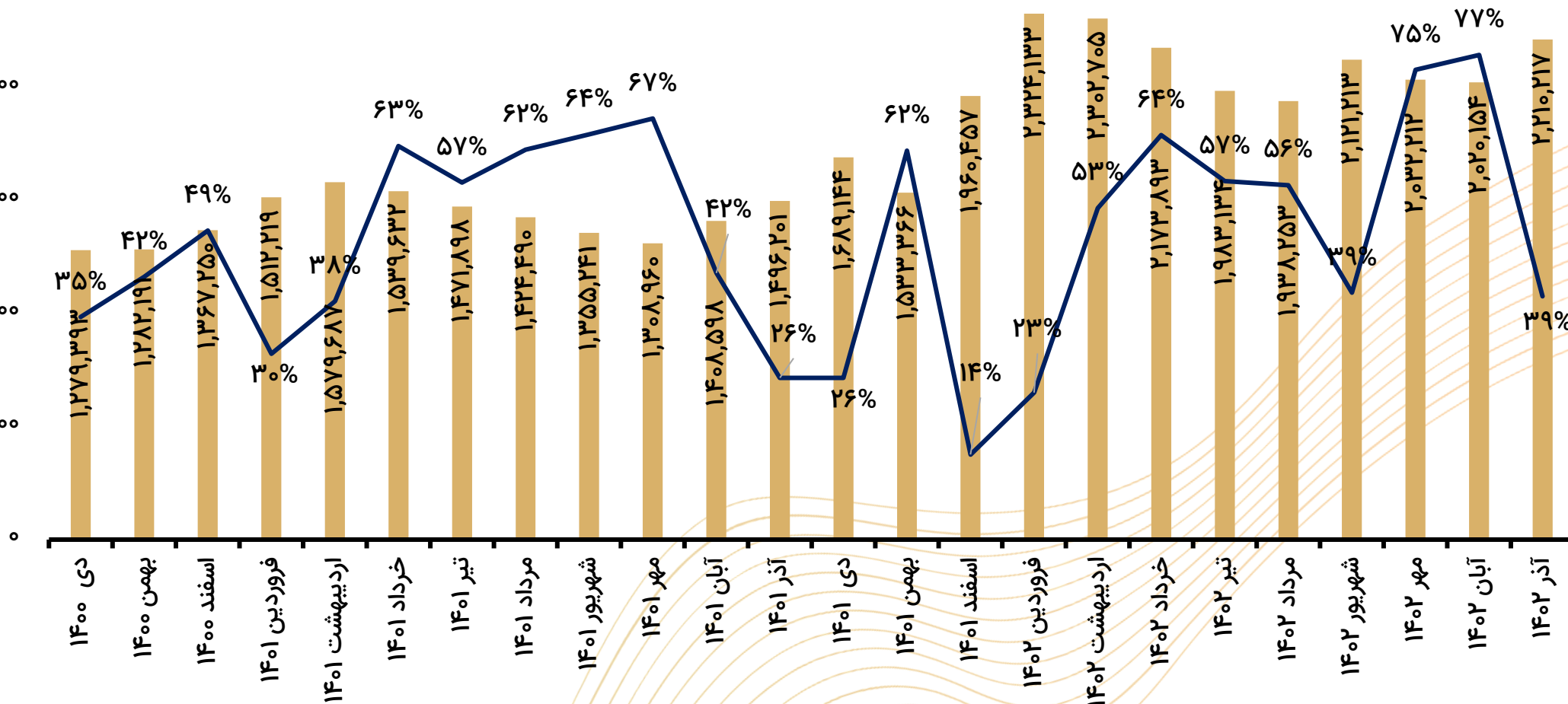
۳۰%

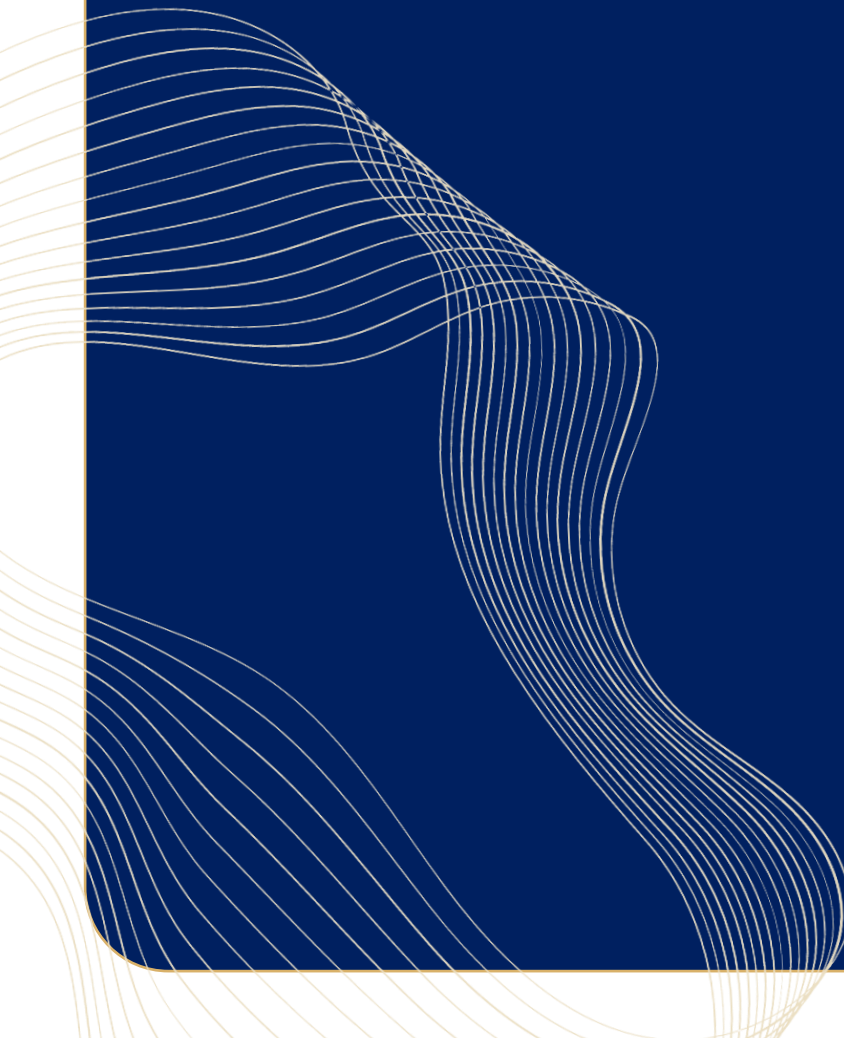
۲۰%

۱۰%

۰%

نسبت خرید صندوق به کل معاملات — شاخص کل





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 ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۱,۹۷۵	۱,۷۰۰	۳,۶۷۵	۵۴%	۲.۳%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۳۷۵	۴۱۵	۷۹۱	۴۷%	۲%
سر. صبا تامین	صبا	۷۲۹	۶۶۹	۱,۳۹۸	۵۲%	۷%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۱۸۰	۱۷۳	۳۵۲	۵۱%	۲%
سر. سیمان تامین	سیتا	۷۱	۱۵۸	۲۲۹	۳۱%	۱%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۱۳۲	۸۶	۲۱۹	۶۱%	۴%
مجموع		۳,۴۶۲	۳,۲۰۲	۶,۶۶۴		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۲۳۲	۱۵۴	۳۸۷	۶۰%	۲.۰%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۷۶	۱۰۰	۱۷۶	۴۳%	۱.۹%
نفت پاسارگاد	شپاس	۲۱۳	۳۰۰	۵۱۳	۴۲%	۷%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۲۰۰	۱۴۷	۳۴۷	۵۸%	۳%
نفت ایرانول	شرانل	۱۰۶	۲۰۲	۳۰۸	۳۴%	۶%
صنعتی بارز	پکرمان	۱۰۶	۱۶۵	۲۷۱	۳۹%	۵%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۱۹	۱۸۲	۳۰۱	۳۹%	۲%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۲۹۰	۳۹۳	۶۸۳	۴۳%	۱۶%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۳۶۹.۵۰	۳۹۸.۴۶	۷۶۸	۴۸%	۷%
مجموع		۱,۷۱۲	۲,۰۴۱	۳,۷۵۳		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۹۲	۸۸	۱۸۰	۵۱%	۴%
مس باهنر	فباهنر	۸۵	۸۷	۱۷۲	۴۹%	۰.۵%
معدنی املاح ایران	شاملا	۱۲۴	۲۳۳	۳۵۷	۳۵%	۴%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۳۷	۱۶۵	۳۰۲	۴۵%	۴%
کاشی سعدی	کسعدی	۱۵۵	۱۳۵	۲۹۰	۵۴%	۴%
کاشی الوند	کلوند	۱۲۰	۷۳	۱۹۳	۶۲%	۴%
زغال پرورده طبس	کزغال	۳۳۴	۲۵۴	۵۸۸	۵۷%	۵%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۶۸	۱۷۹	۳۴۷	۴۸%	۳%
لعابیران	شلعاب	۳۳۶	۳۲۳	۶۵۸	۵۱%	۲%
مجموع		۱,۵۵۱	۱,۵۳۷	۳,۰۸۸		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	ویپخش	۱۱۳	۱۳۱	۲۴۴	۴۶%	۳%
پارس دارو	دپارس	۹۴	۱۰۲	۱۹۶	۴۸%	۴%
دارو اکسیر	دلر	۵۹	۹۳	۱۵۲	۳۹%	۲%
دارو فارابی	دفارا	۹۸	۱۳۲	۲۳۰	۴۳%	۲%
داروسازی قاضی	دقاضی	۵۱	۱۷۲	۲۲۳	۲۳%	۱۶%
کارخانجات داروپخش	دارو	۳۰	۵۶	۸۶	۳۵%	۳%
دارو زهراوی	دزهراوی	۱۰۶	۱۲۶	۲۳۲	۴۶%	۴%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۱۹۶	۱۳۸	۳۳۴	۵۹%	۴%
دارو رازک	درازک	۸۶	۸۰	۱۶۶	۵۲%	۱%
پخش هجرت	هجرت	۱۳۷	۱۵۹	۲۹۶	۴۶%	۴%
مواد داروپخش	دتماد	۱۰۹	۱۰۴	۲۱۳	۵۱%	۴%
کلر پارس	کلر	۲۰۰	۱۵۰	۳۵۰	۵۷%	۲%
دارو ابوریحان	دابور	۷۳	۳۷	۱۱۰	۶۶%	۴%
کاسپین تامین	کاسپین	۹۹	۱۱۶	۲۱۵	۴۶%	۶%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۴۶	۱۶۱	۳۰۷	۴۸%	۴%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۱۴۲	۱۷۵	۳۱۷	۴۵%	۴%
شیرین دارو	دشیری	۱۲۵	۱۳۳	۲۵۸	۴۸%	۱۸%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۱۱۸	۱۰۳	۲۲۱	۵۳%	۵%
دارویی ره آورد تامین	درهآور	۳۸۳	۳۲۷	۷۱۰	۵۴%	۶%
مجموع		۲,۳۶۵	۲,۴۹۶	۴,۸۶۱		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۱۷۶	۱۷۷	۳۵۲	۵۰%	۲%
سیمان صوفیان	سصوفی	۵۴	۴۵	۱۰۰	۵۵%	۱%
سیمان ارومیه	ساروم	۸۱	۶۶	۱۴۷	۵۵%	۲%
سیمان قائن	سقاین	۱۴۳	۲۲۶	۳۶۹	۳۹%	۵%
سیمان شاهرود	سرود	۱۰۲	۱۰۰	۲۰۲	۵۱%	۴%
سیمان ساوه	ساوه	۱۸۶	۱۵۴	۳۴۰	۵۵%	۴%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۲۴	۶۸	۱۹۲	۶۴%	۴%
سیمان فارس	سفار	۴۳۷	۸۸۰	۱,۳۱۷	۳۳%	۱۱%
سیمان خزر	سخزر	۱۵۵	۱۹۹	۳۵۴	۴۴%	۳%
سیمان فارس نو	سفانو	۹۵	۸۰	۱۷۵	۵۴%	۴%
سیمان بجنورد	سبجنو	۸۳	۹۷	۱۸۰	۴۶%	۴.۹%
سیمان بهبهان	سبهبان	۱۹۱	۱۵۶	۳۴۷	۵۵%	۳%
سیمان غرب	سغرب	۹۷	۱۰۲	۱۹۹	۴۹%	۷%
سیمان خاش	سبخاش	۴۴	۶۴	۱۰۸	۴۱%	۲%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۲۷۴	۲۵۸	۵۳۲	۵۱%	۵%
سیمان دورود	سدور	۱۰۷	۱۴۷	۲۵۴	۴۲%	۳%
فارسیت اهواز	سفاسی	۱۶۲	۱۵۸	۳۲۰	۵۱%	۱۰%
سیمان آبیک	سآبیک	۱۹۸	۴۰۷	۶۰۵	۳۳%	۷%
مجموع		۲,۷۱۱	۳,۳۸۴	۶,۰۹۵		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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 الکترونیک	لپارس	۵۳۳	۵۵۵	۱,۰۸۸	۴۹%	۴%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۶۶۰	۶۶۵	۱,۳۲۶	۵۰%	۸%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۲۸۴	۵۰۰	۷۸۴	۳۶%	۳%
کشت و دام گلدهشت نمونه اصفهان	زگلدهشت	۵۲۰	۴۷۴	۹۹۴	۵۲%	۱۳%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۱۳۵	۱۰۷	۲۴۲	۵۶%	۱۷%
مجموع		۲,۱۳۳	۲,۳۰۲	۴,۴۳۴		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۶۶	۶۹	۱۳۵	۴۹%	۵%
کربن ایران	شکرین	۱۷۲	۲۱۱	۳۸۳	۴۵%	۳%
لوله و گاز	پلوله	۲۱۱	۱۶۰	۳۷۱	۵۷%	۱۰%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۸۶	۱۰۴	۱۹۰	۴۵%	۳%
تکین کو	رتکو	۲۷	۱۱۵	۱۴۳	۱۹%	۵%
مجموع		۵۶۲	۶۵۹	۱,۲۲۱		

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۳۱۴	۲۴۰	۵۵۴	۵۷%	۴%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۶۰۲	۶۹۸	۱,۳۰۰	۴۶%	۱۱%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۱۲۴	۲۲۲	۳۴۶	۳۶%	۹%
مجموع		۱,۰۴۰	۱,۱۶۰	۲,۲۰۰		

خرید و فروش بازارگردان در سایر مجموعه‌ها

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (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	۲۶۷	۲۴۰	۵۰۷	۵۳%	۹%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۵۶۷	۴۷۳	۱,۰۴۰	۵۵%	۵%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۶۷۷	۲۶۵	۹۴۲	۷۲%	۳۰%
سرمایه‌گذاری هامون صبا	وهامون	۱۵۳	۲۲۶	۳۷۹	۴۰%	۵%
ذوب آهن اصفهان	ذوب	۹۸۵	۸۲۳	۱,۸۰۸	۵۴%	۲%
پالایشگاه نفت اصفهان	شپنا	۵۹۸	۲۶۱	۸۶۰	۷۰%	۱%
مجموع		۳,۲۴۶	۲,۲۸۸	۵,۵۳۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ کشتیرانی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ (میلیارد ریال)

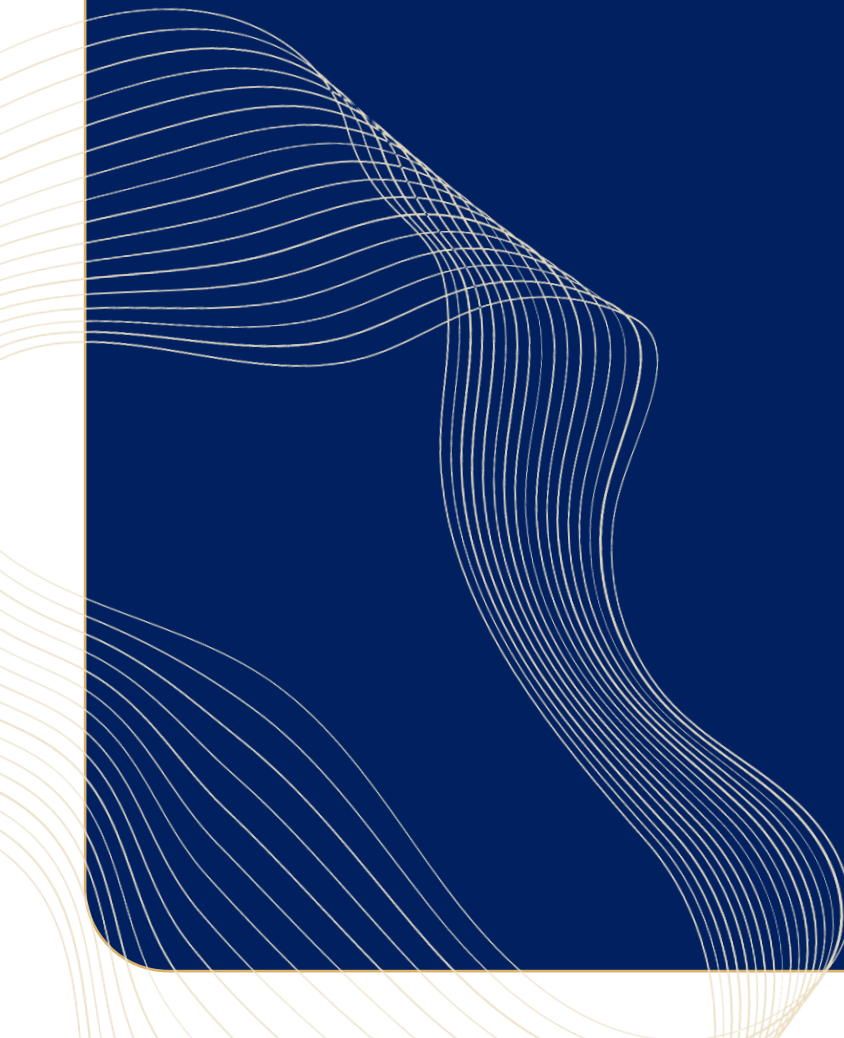
صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
کشتیرانی جمهوری اسلامی ایران	حکشتی	۱,۴۸۸	۴۱۲	۱,۹۰۰	۷۸%	۲%
کشتیرانی دریای خزر	خزر	۹۹	۲۹	۱۲۸	۷۷%	۱%
مجموع		۱,۵۸۸	۴۴۱	۲,۰۲۹		

۳۹.۲ درصد میانگین بازدهی شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر در نه ماهه نخست سال ۱۴۰۲

درحالی‌که در نه ماهه نخست سال ۱۴۰۲ بازده شاخص کل ۱۰.۶٪ بوده است، ۶۸ نماد (۸۲ درصد) از شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در نه ماهه نخست سال ۱۴۰۲

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
سفار	۲۲۹.۹۳	پکرمان	۶۹.۰۹	سرود	۵۲.۴۳	حکشتی	۳۶.۱۶	کلوند	۲۳.۷۶	لطیف	۱۲.۵۴	شکبیر	-۲.۱۷
شلعاب	۱۲۵.۲۲	سآبیک	۶۸.۲۰	دپارس	۵۰.۲۵	زگلدشت	۳۴.۹۶	سفاسی	۲۳.۴۵	رتکو	۱۲.۴۶	درازک	-۲.۲۲
آباد	۱۱۲.۴۲	شاملا	۶۵.۵۳	دفارا	۴۹.۲۷	دره‌آور	۳۳.۶۷	دشیری	۲۱.۱۵	دزهرای	۱۱.۲۹	کمر	-۸.۶۴
چخزر	۱۱۰.۸۱	سغرب	۶۴.۸۴	وهامون	۴۸.۱۳	دکپسول	۳۲.۸۸	لپارس	۱۹.۴۹	سخوز	۹.۶۸	دابور	-۹.۴۶
وپترو	۱۰۸.۵۵	پسهند	۶۲.۵۰	کاسپین	۴۶.۳۲	کسعدی	۳۰.۷۵	سخزر	۱۸.۸۱	شپترو	۸.۱۷	شفن	-۱۰.۰۵
کپشیر	۹۳.۵۲	سنیر	۶۱.۲۸	دقاضی	۴۳.۸۸	دارو	۳۰.۵۷	شپنا	۱۷.۵۲	شرانل	۷.۹۰	شغدییر	-۱۲.۳۴
حخزر	۸۹.۹۱	زفکا	۶۱.۱۴	ساوه	۴۱.۶۶	سفارس	۲۹.۸۴	فباهر	۱۵.۸۱	شاوان	۷.۱۳	کزغال	-۱۲.۷۶
سقایین	۸۳.۵۹	دشیمی	۶۰.۸۹	پلوله	۴۰.۵۶	خراسان	۲۹.۲۹	ذوب	۱۵.۷۶	کخاک	۵.۷۴	دتوزیع	-۱۵.۴۰
شدوص	۷۹.۲۲	شکرین	۵۹.۴۵	شفارا	۳۹.۸۷	تاپیکو	۲۸.۱۱	سصوفی	۱۵.۷۵	سفانو	۳.۳۸	لخانه	-۲۸.۸۴
سپهان	۷۸.۹۲	ددام	۵۸.۲۲	دتماد	۳۹.۲۰	کفرا	۲۷.۸۱	شستا	۱۳.۹۹	هجرت	۲.۳۱		
زملارد	۷۳.۹۹	سیتا	۵۷.۴۰	چکاو	۳۸.۹۷	وپخش	۲۷.۷۵	شکمر	۱۳.۸۷				
شپاس	۷۲.۲۱	سدور	۵۷.۱۹	مداران	۳۸.۲۰	تیپیکو	۲۶.۳۴	تاصیکو	۱۳.۸۶				
سبجنو	۶۹.۲۴	دلر	۵۶.۳۴	ساروم	۳۶.۷۹	سخاش	۲۴.۶۹	صبا	۱۳.۰۷				



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 كالایی و ...