



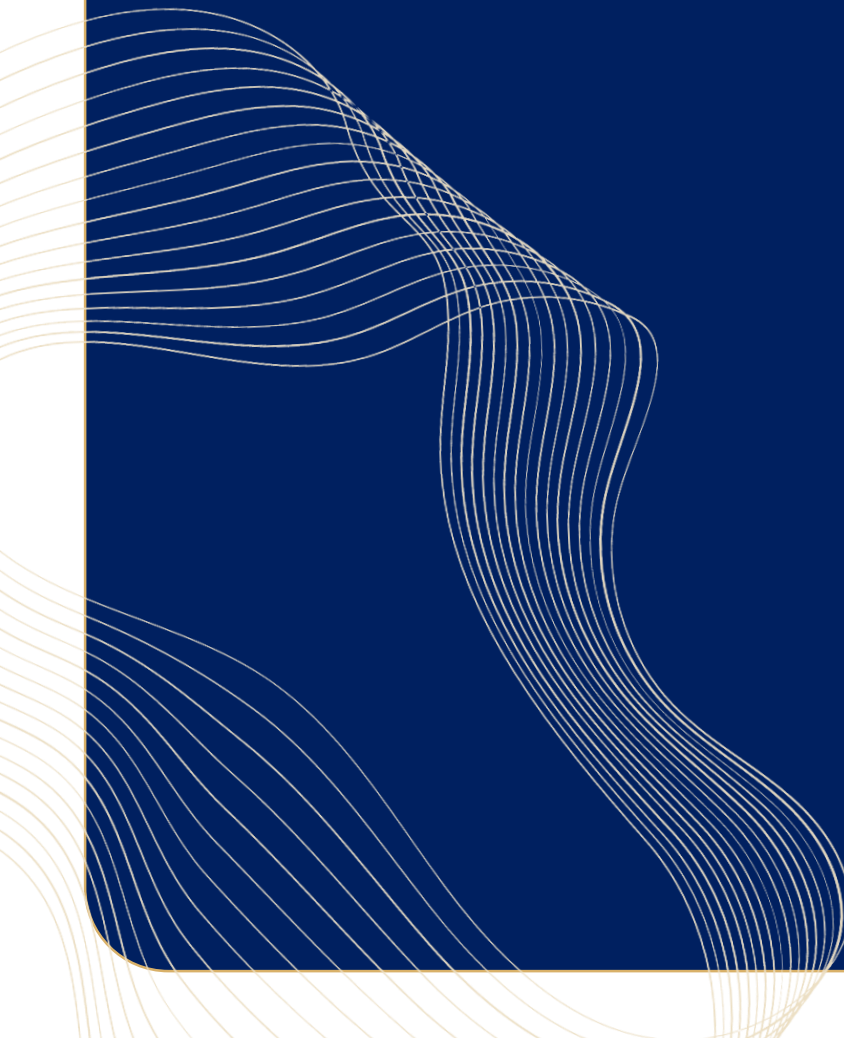
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

מסורת
מסורת



فهرست





مقدمه و معرفی

ارکان و واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در دوره منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

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

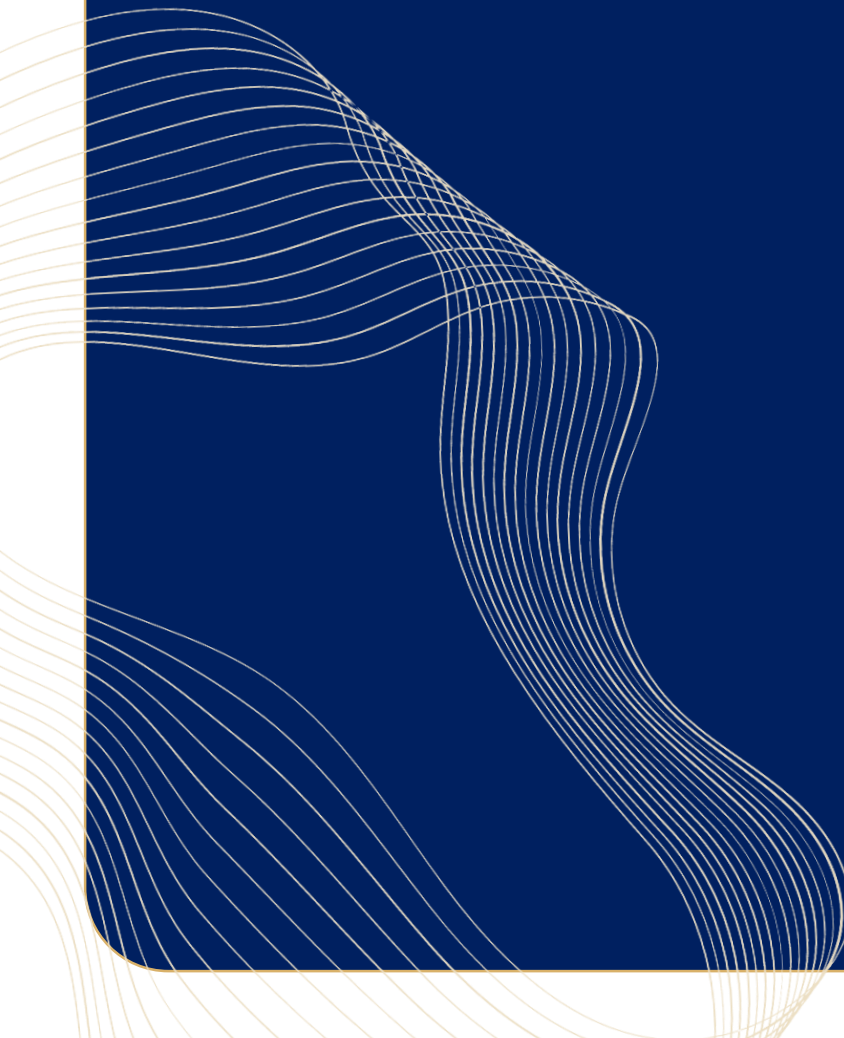
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه

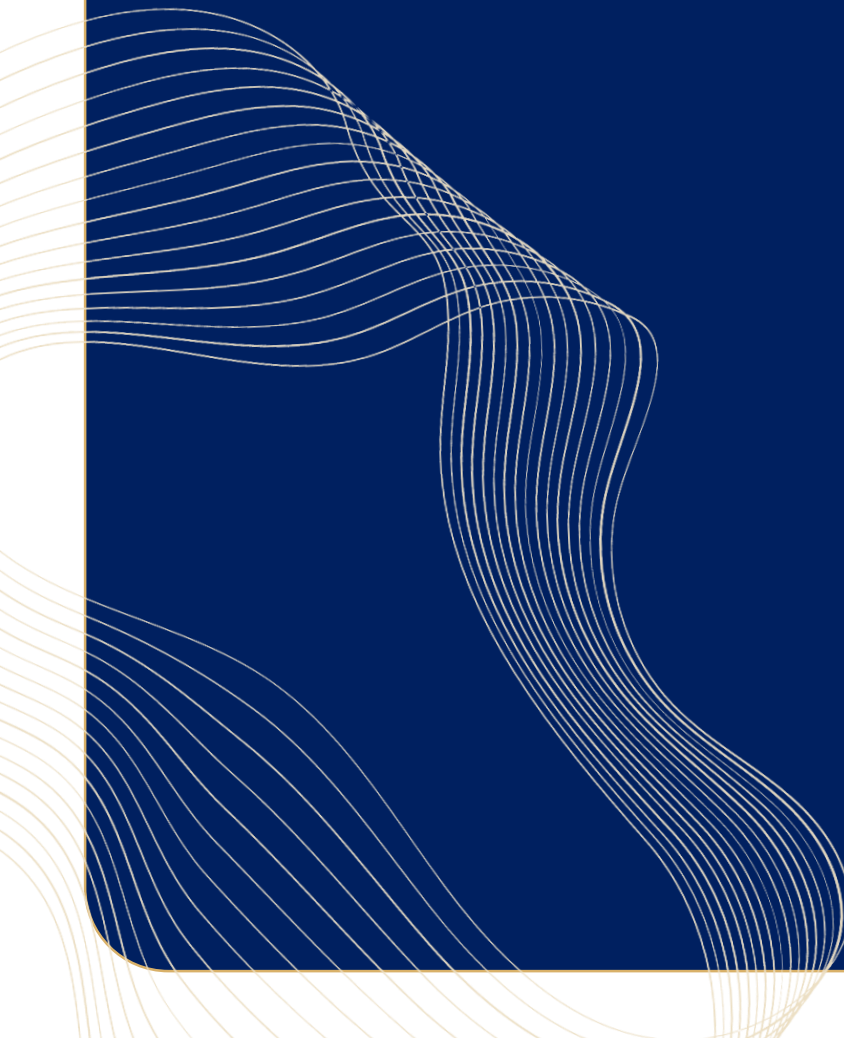
صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند. هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد. بلکه 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 ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردانی ۸۵ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازار سرمایه کشور از این حیث شناخته می‌شود.

در این تاریخ خالص ارزش دارایی‌های صندوق ۱۲۳,۷۳۷ میلیارد ریال می‌باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ افزایش ۱۷ درصدی داشته است.



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

رکن	دوره منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹	دوره منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹
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

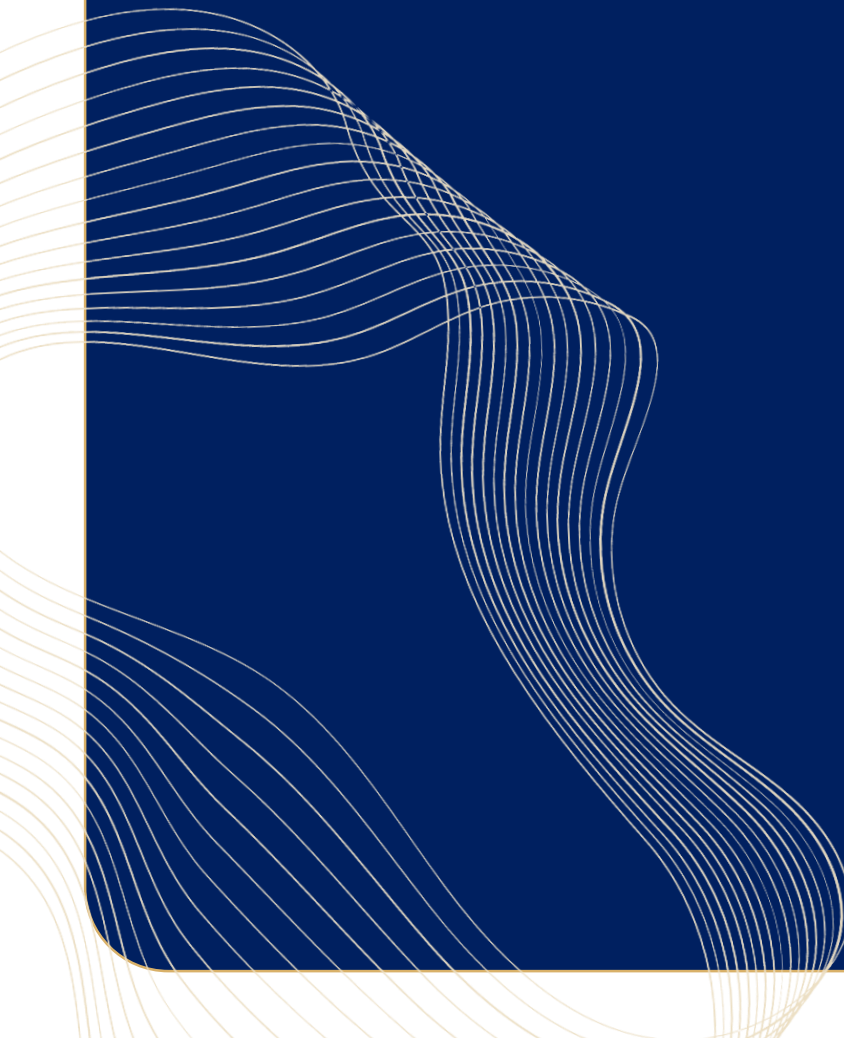
در دوره ۱۲ ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ رکن متولی و کارگزار (کارگزاری بانک رفاه کارگران اضافه گردیده است) صندوق تغییر کرده‌اند و سایر ارکان نسبت به دوره ۱۲ ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ بدون تغییر بوده است.

واحدهای سرمایه گذاری صندوق



سبدگردان
اندیشه صبا

نوع واحد	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۱۴۰۲/۱۲/۲۹	
ممتاز	۴۵,۶۹۶	۴۵,۶۹۶	شرکت گروه مالی صبا تأمین
ممتاز	۴۳,۰۰۸	۴۳,۰۰۸	شرکت سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تامین
ممتاز	۸۹۶	۸۹۶	شرکت سبدگردان اندیشه صبا
ممتاز	۸۹,۶۰۰	۸۹,۶۰۰	مجموع واحدهای ممتاز
عادی	۶۹,۴۶۱,۷۲۴	۷۱,۱۵۶,۷۳۱	مجموع واحدهای عادی
-	۶۹,۵۵۱,۳۲۴	۷۱,۲۴۶,۳۳۱	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

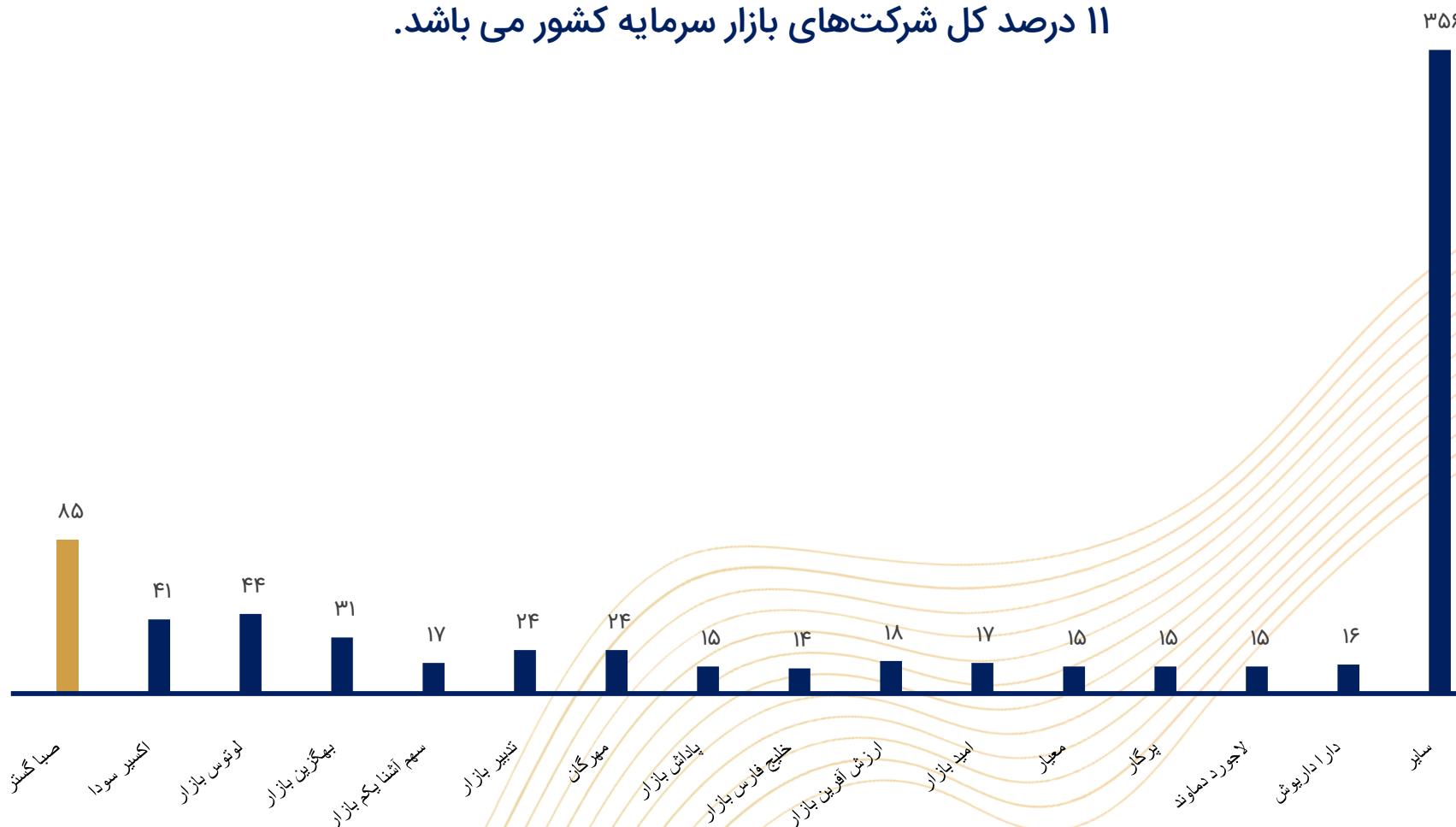


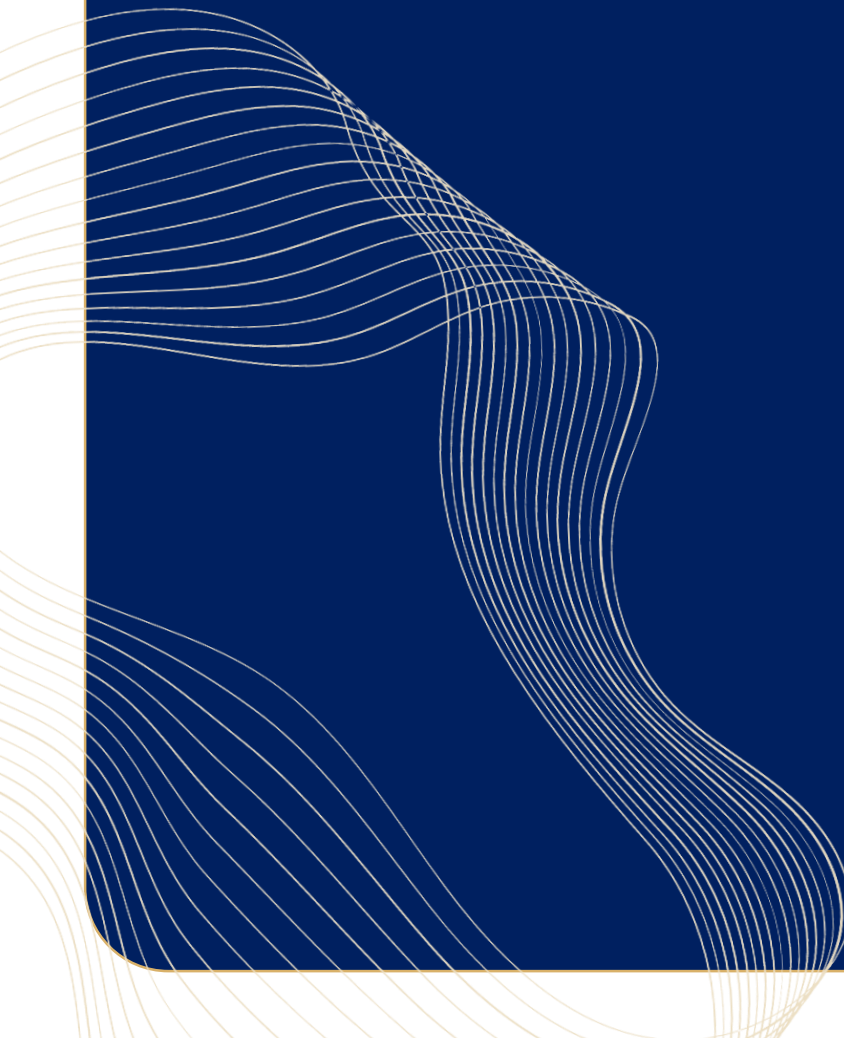
سبذگردان
اندیشه صبا

هلدینگ	نماد	هلدینگ
هلدینگ شستا	شستا	تاپیکو
هلدینگ تاپیکو	شفن وپیتر	خراسان شفارا
هلدینگ تیپیکو	وپیخ دزهرای دابور دره‌آور	دپارس دتوزیع کاسپین بیوتیک
هلدینگ تاسیکو	کخاک کپشیر	شاملا شلعاب
هلدینگ سیتا	سفارس سخوز سغرب	ساروم سخزر سنیر
هلدینگ صنایع عمومی	لپارس	زفکا
هلدینگ وپیتر	پسهند	شکربن
هلدینگ سلولزی	چکاو	لطف
بانک رفاه	مداران	شکیر
هلدینگ کشتیرانی جمهوری اسلامی	حکشتی	حخر
هلدینگ هگتا	آباد	
هلدینگ صبا تامین	وهامون	صندوق اوصتا
		صندوق نفیس
		صندوق دیبا
		اوراق گام توسعه تعاون
		صندوق پتروصبا

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

صندوق بازارگردانی صبا گستر در حال حاضر با انجام تعهد بازارگردانی ۸۵ نماد، بازارگردان ۱۱ درصد کل شرکتهای بازار سرمایه کشور می باشد.





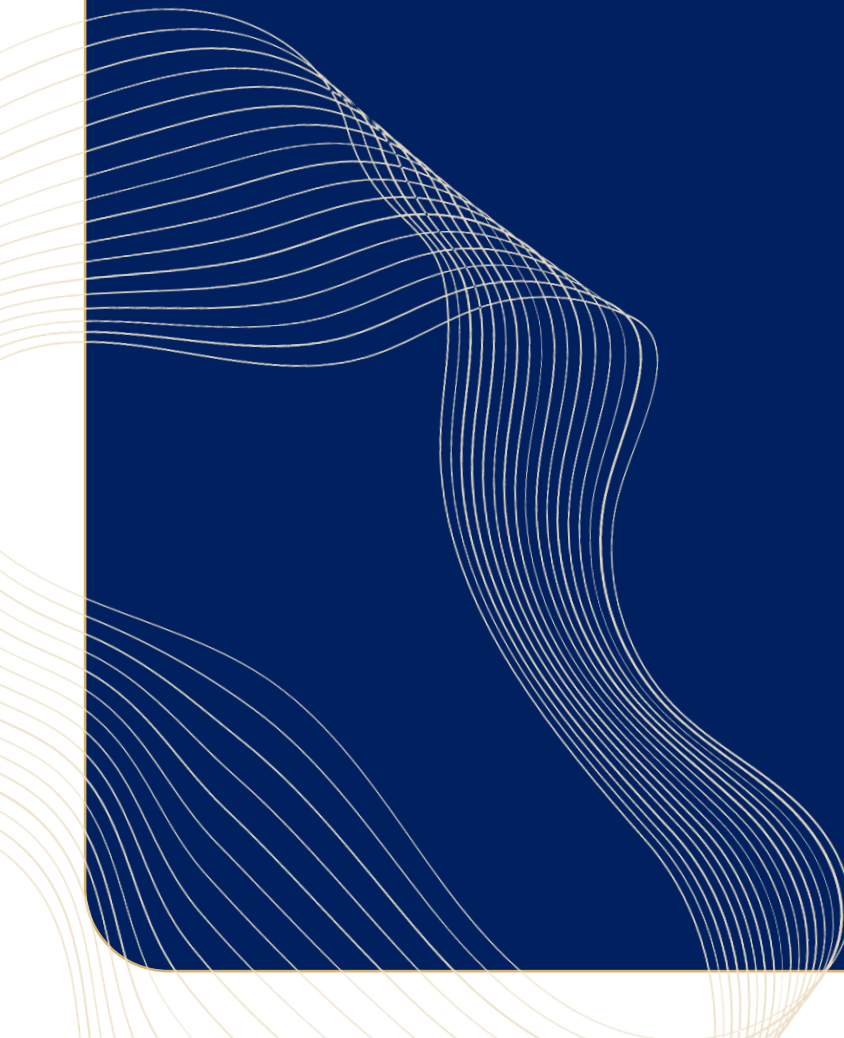
بخش چهارم:

صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹
درآمد ها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۵,۹۰۰,۴۷۲	۵,۱۹۶,۵۷۹
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۳,۷۶۵,۶۲۰	۲۵,۹۱۲,۳۵۹
سود سهام	۱۰,۸۵۳,۴۶۵	۸,۵۹۷,۳۸۲
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۶۵۰,۱۰۰	۶۱۰,۹۶۶
درآمد حاصل از بازارگردانی	۵۳,۳۵۵	۲۹,۵۷۴
سایر درآمدها	۳,۲۹۱	۴۴,۸۳۵
جمع درآمدها	۲۱,۲۲۶,۳۰۵	۴۰,۳۹۱,۶۹۷
هزینه ها :		
هزینه کارمزد ارکان	(۹۴۹,۳۳۹)	(۶۹۶,۷۰۱)
هزینه مالی	(۱۰,۳۹۱)	(۱۴۹,۹۹۶)
سایر هزینه ها	(۴۸,۳۹۹)	(۳۲,۵۷۰)
جمع هزینه ها	(۱,۰۰۸,۱۳۰)	(۸۷۹,۲۳۹)
سود (زیان)خالص	۲۰,۲۱۸,۱۷۵	۳۹,۵۱۲,۴۵۸



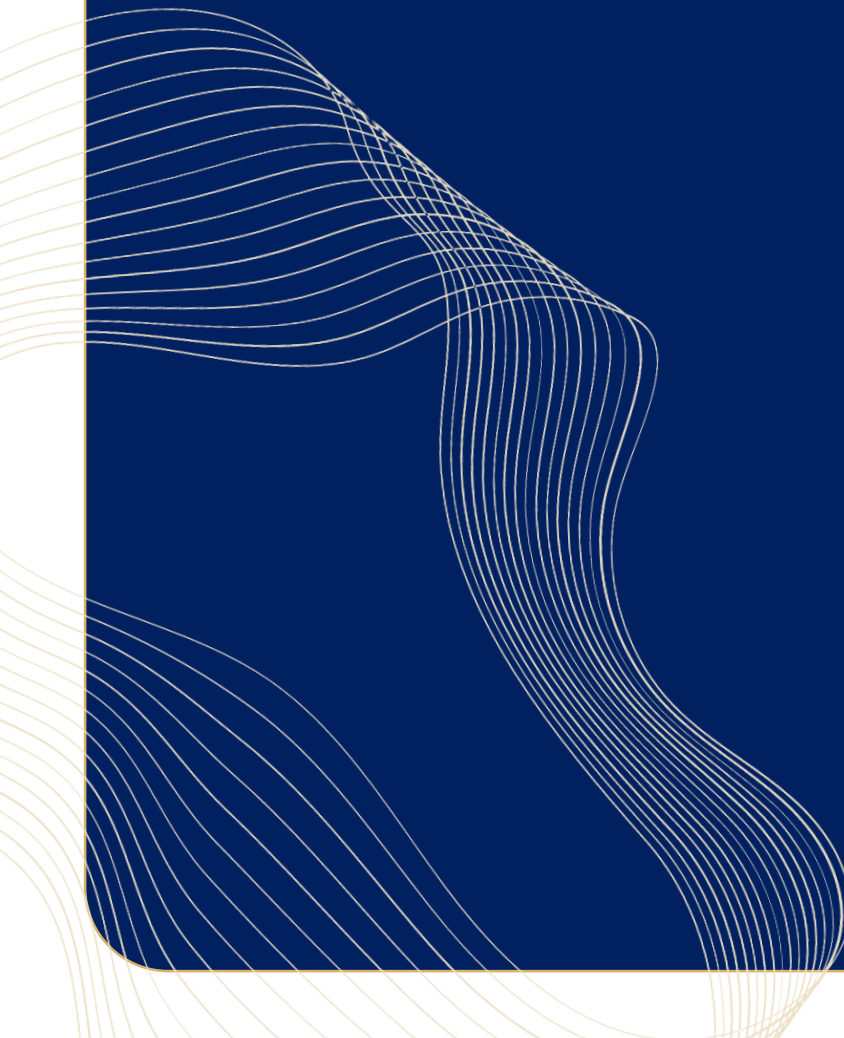
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی‌ها

صورت خالص دارایی‌ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۲/۱۲/۲۹	۱۴۰۱/۱۲/۲۹
دارایی‌ها :		
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۹۰,۹۹۰,۱۴۳	۷۹,۹۲۵,۵۳۳
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۱۵۱,۳۷۹	۳۴۷,۶۱۸
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۹۰۲,۹۰۷	۳,۶۹۰,۲۷۱
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۲۵,۰۸۳,۹۵۰	۱۶,۹۵۳,۲۹۶
حساب‌های دریافتی	۶,۹۴۱,۴۸۳	۶,۱۰۸,۷۴۹
سایر دارایی‌ها	۰	۰
موجودی نقد	۵۰	۰
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۴۲,۸۲۷	۸۳۹,۰۱۷
جمع دارایی‌ها	۱۲۴,۱۱۲,۷۴۲	۱۰۷,۸۶۴,۴۸۵
بدهی‌ها :		
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۰	۰
پرداختی به ارکان صندوق	۳۶۵,۰۰۹	۱۹۹,۶۸۷
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۹,۸۰۳	۱۷,۶۰۳
بدهی به سرمایه‌گذاران	۱۶۰	۱,۵۰۰,۱۶۲
جمع بدهی‌ها	۳۷۴,۹۷۲	۱,۷۱۷,۴۵۲
خالص دارایی‌ها	۱۲۳,۷۳۷,۷۷۰	۱۰۶,۱۴۷,۰۳۴
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری	۱,۷۳۶,۷۵۹	۱,۵۲۶,۱۶۸

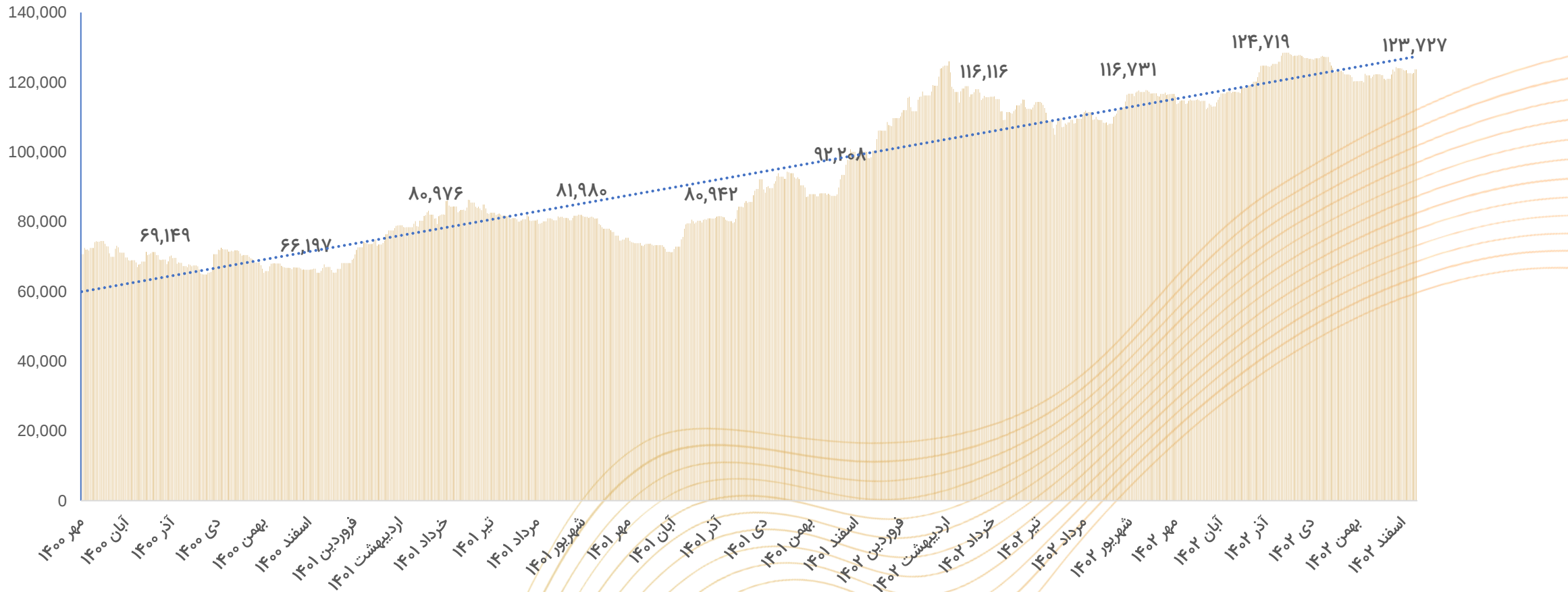


بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق

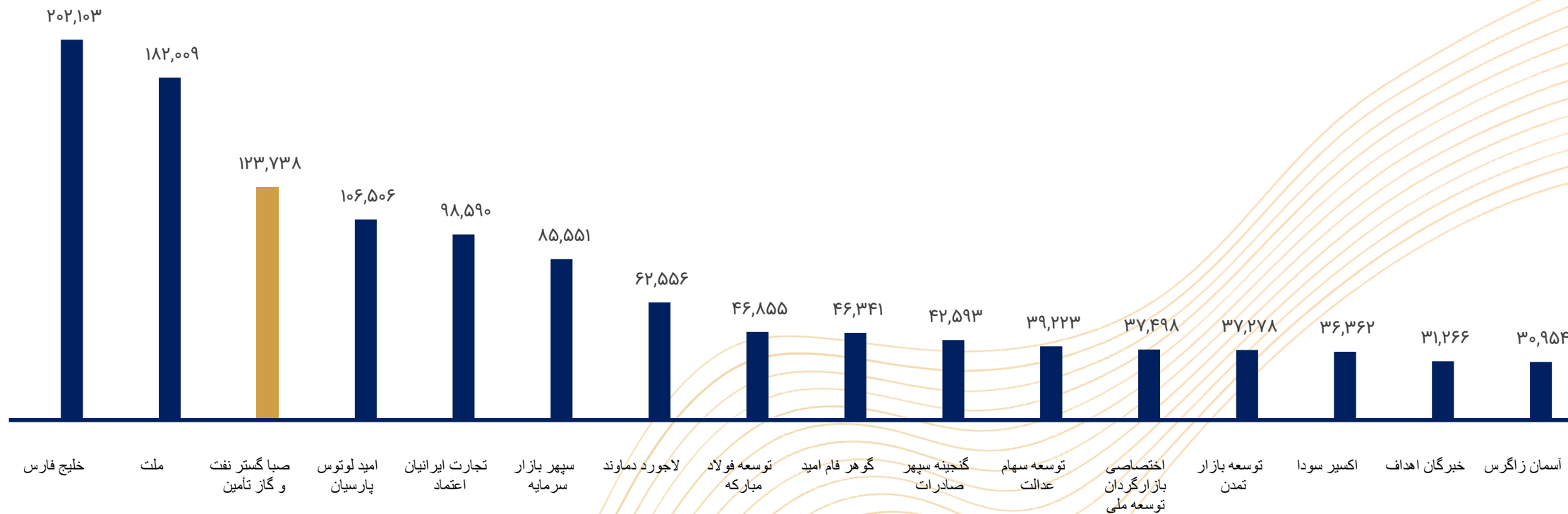
روند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

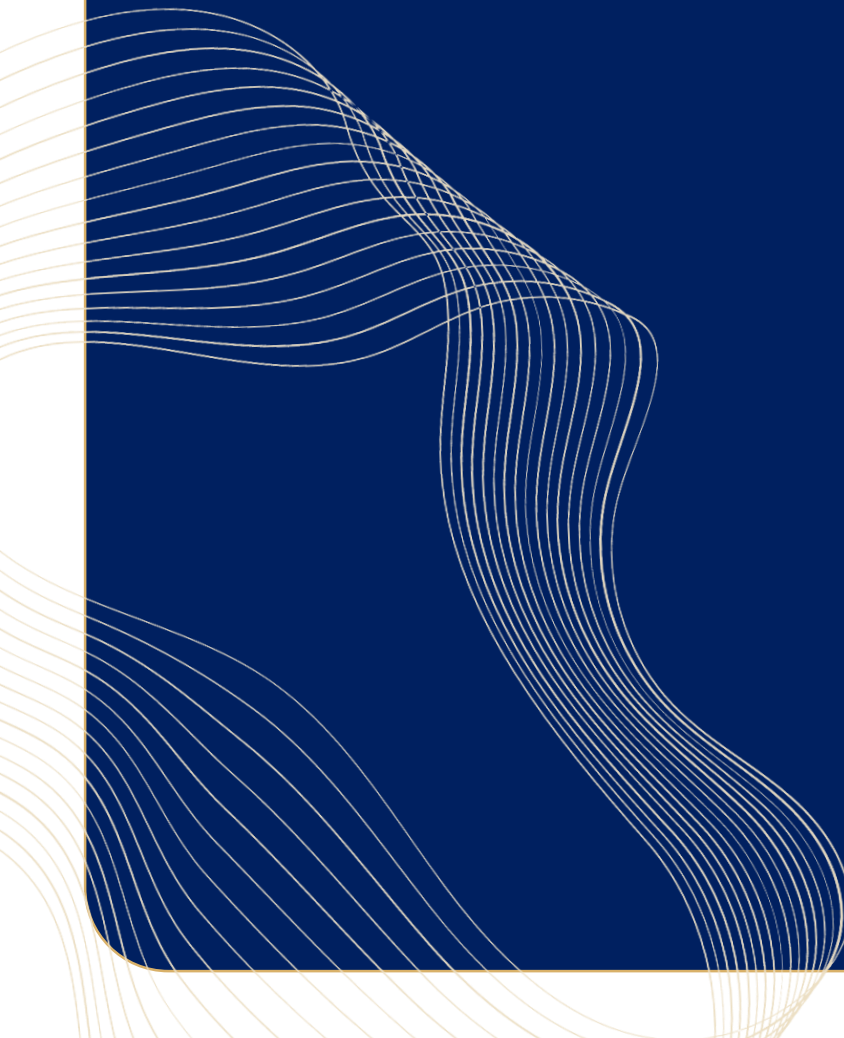
در تاریخ ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۱۲۳,۷۳۷ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ **افزایش ۱۷ درصدی** را تجربه کرده است.



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

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (میلیارد ریال)



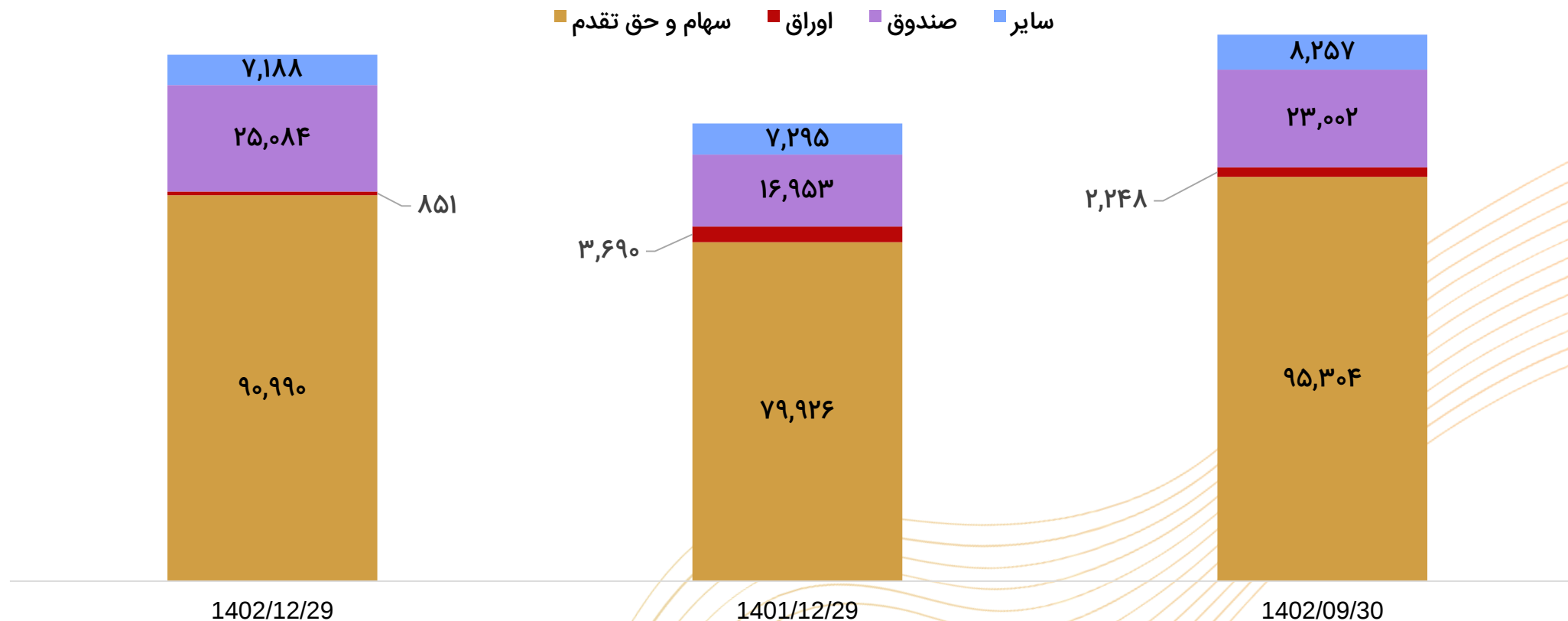


بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

ترکیب دارایی های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)



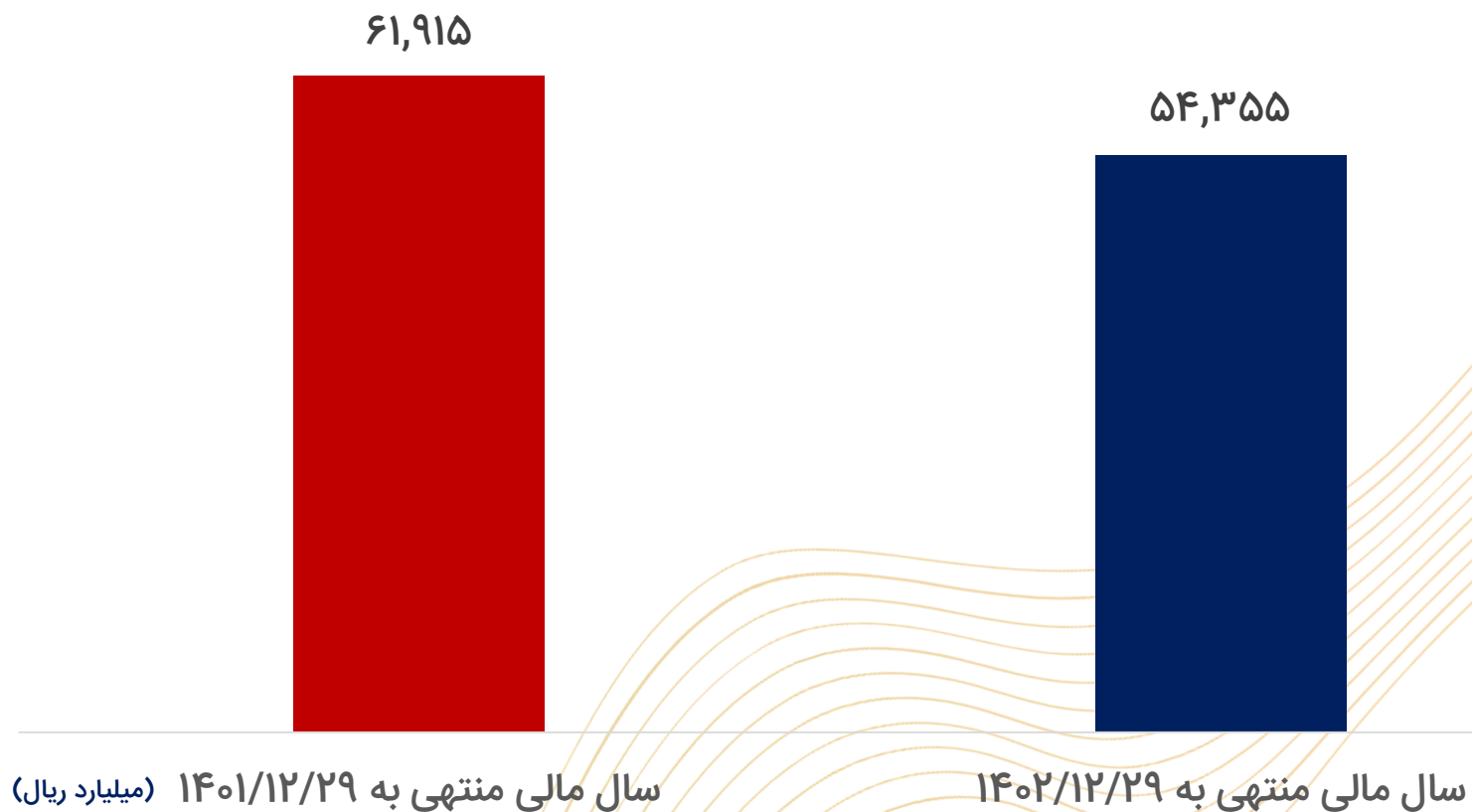
عمده (۹۷ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتی (سررسید نشده) می باشد که به تدریج از شرکت ها وصول می گردد.

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

بخش هشتم:
معاملات سهام صندوق

ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر

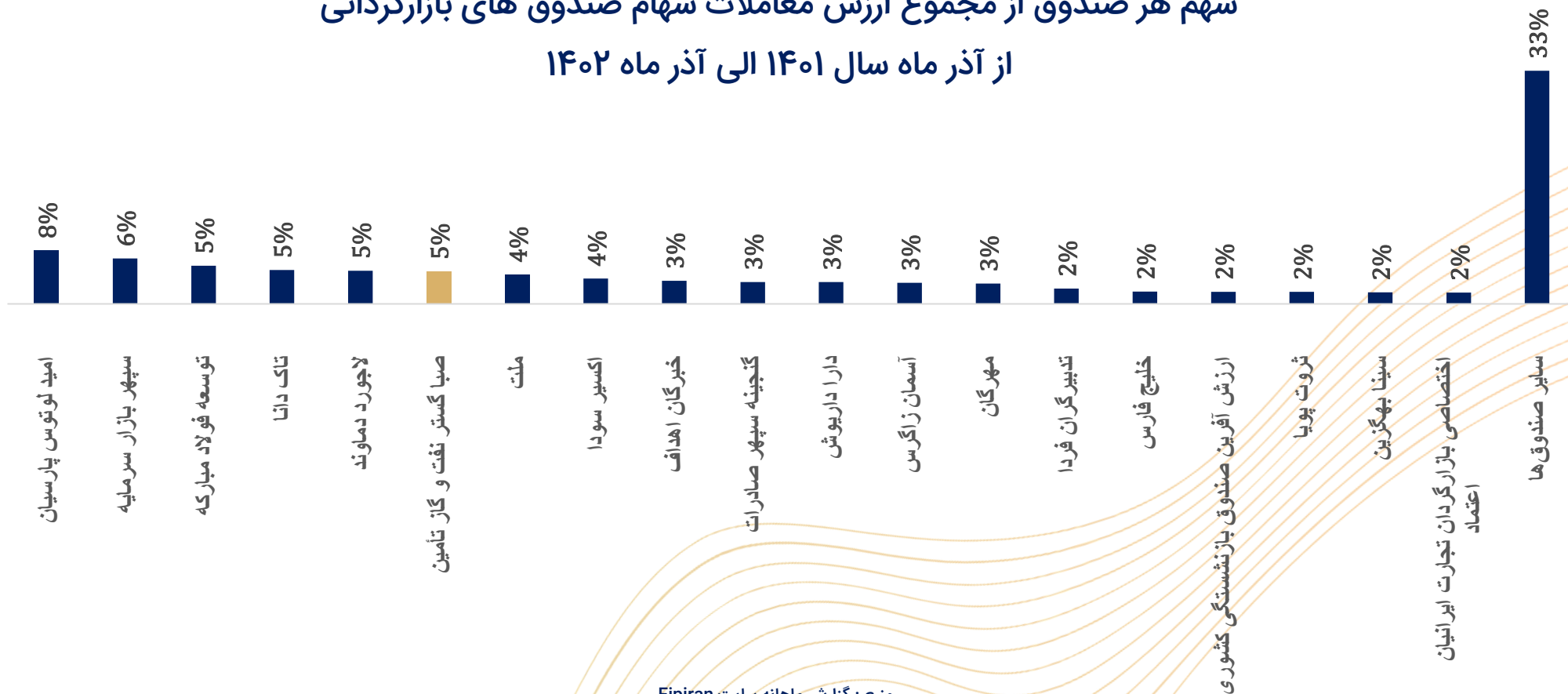
با توجه به کاهش ارزش معاملات در بازار سرمایه در سال مالی منتهی به اسفند ۱۴۰۲ نسبت به مدت مشابه سال گذشته، ارزش معاملات خرد سهام صندوق صباگستر کاهش ۱۲ درصدی را تجربه کرده است



ششمین صندوق فعال بازارگردانی بازار سرمایه کشور

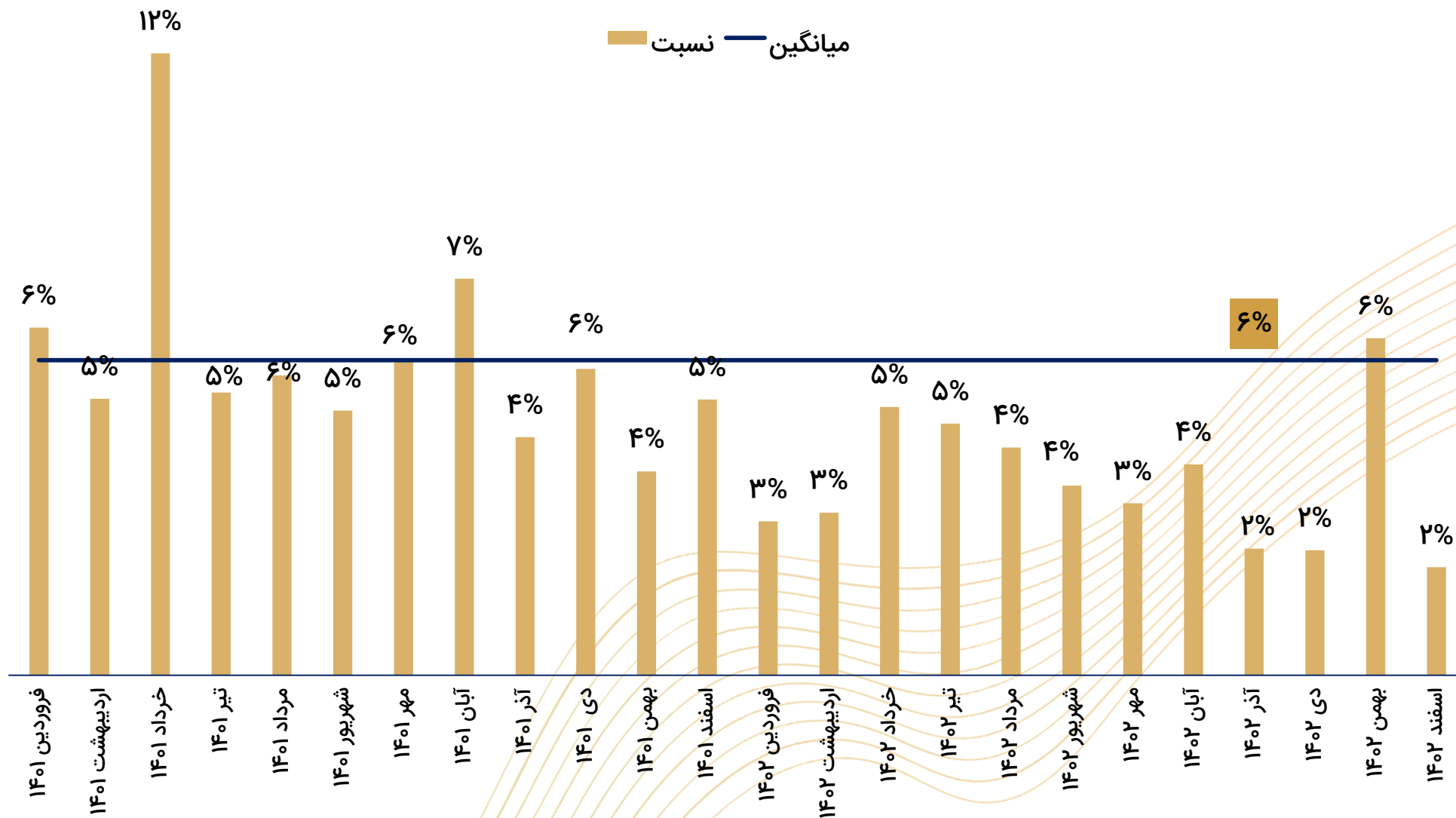
با در اختیار داشتن سهم ۵ درصدی از کل ارزش معاملات سهام صندوق های بازارگردانی

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

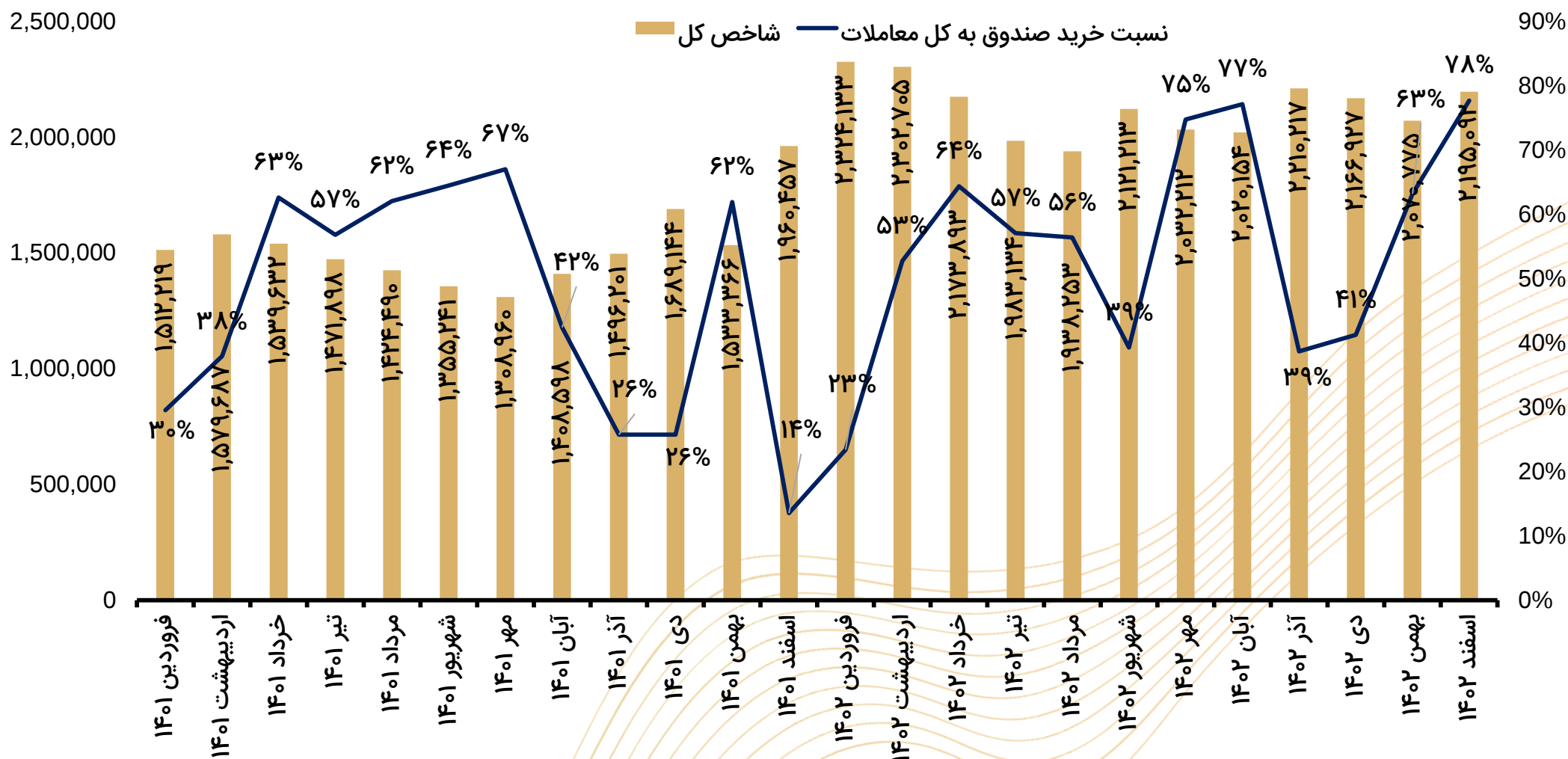


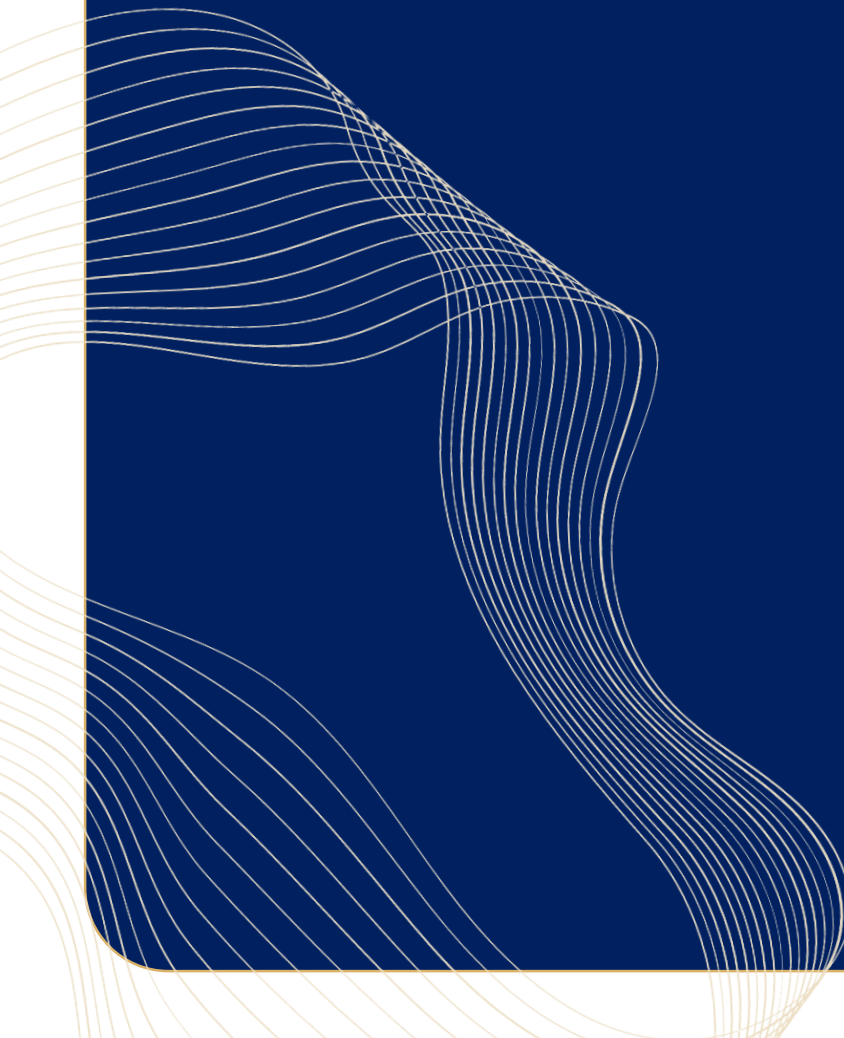
منبع : گزارش ماهانه سایت Fipiran

روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملاتی 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 ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۲,۳۴۸	۱,۷۰۳	۴,۰۵۰	۵۸%	۱/۴%
سر. نفت و گاز تامین	تاپیکو	۷۰۲	۴۱۶	۱,۱۱۸	۶۳%	۲%
سر. صبا تامین	صبا	۱,۲۴۷	۱,۱۰۴	۲,۳۵۰	۵۳%	۶%
سر. صدر تامین	تاصیکو	۲۰۹	۱۷۳	۳۸۲	۵۵%	۱%
سر. سیمان تامین	سیتا	۹۰	۱۶۰	۲۵۰	۳۶%	۱%
سر. دارویی تامین	تیپیکو	۱۵۱	۸۷	۲۳۸	۶۳%	۲%
مجموع		۴,۷۴۶	۳,۶۴۳	۸,۳۸۹		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۲۳۶	۱۵۶	۳۹۲	۶۰%	۱/۲%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۷۹	۱۰۱	۱۸۰	۴۴%	۱/۱%
نفت پاسارگاد	شپاس	۲۵۸	۳۳۱	۵۸۹	۴۴%	۴%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۲۱۴	۱۵۹	۳۷۳	۵۷%	۲%
نفت ایرانول	شرانل	۱۱۳	۲۰۴	۳۱۶	۳۶%	۳%
صنعتی بارز	پکرمان	۱۱۵	۱۹۳	۳۰۸	۳۷%	۳%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۳۰	۲۰۶	۳۳۷	۳۹%	۱%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۳۵۳	۴۴۷	۸۰۱	۴۴%	۱۰%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۴۲۷/۳۷	۴۲۴/۹۴	۸۵۲	۵۰%	۴%
مجموع		۱,۹۲۶	۲,۲۲۲	۴,۱۴۸		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۱۰۸	۱۰۷	۲۱۶	۵۰%	۲%
مس باهنر	فباهنر	۸۸	۸۷	۱۷۵	۵۰%	۰/۳%
معدنی املاح ایران	شاملا	۱۸۵	۲۶۵	۴۵۰	۴۱%	۲%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۶۲	۱۹۸	۳۶۰	۴۵%	۲%
کاشی سعدی	کسعدی	۱۹۱	۱۸۳	۳۷۴	۵۱%	۲%
کاشی الوند	کلوند	۱۲۵	۸۵	۲۱۰	۵۹%	۲%
زغال پرورده طبس	کزغال	۳۶۶	۳۲۵	۶۹۱	۵۳%	۳%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۸۴	۲۱۱	۳۹۵	۴۷%	۱%
لعابیران	شلعاب	۳۵۷	۳۲۶	۶۸۴	۵۲%	۱%
مجموع		۱,۷۶۶	۱,۷۸۸	۳,۵۵۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۱۲۸	۱۳۲	۲۶۰	۴۹%	۲%
آنتی بیوتیک سازی ایران	بیوتیک	۷۶۷	۱,۸۳۲	۲,۵۹۹	۳۰%	۲۴%
پارس دارو	دپارس	۱۰۲	۱۰۶	۲۰۸	۴۹%	۲%
دارو اکسیر	دکسیر	۶۳	۹۶	۱۵۸	۴۰%	۱%
دارو فارابی	دفارا	۱۰۱	۱۳۳	۲۳۴	۴۳%	۱%
داروسازی قاضی	دقاضی	۵۵	۱۷۳	۲۲۸	۲۴%	۹%
کارخانجات داروپخش	دارو	۳۲	۶۵	۹۶	۳۳%	۲%
دارو زهراوی	دزهراوی	۱۱۸	۱۳۷	۲۵۵	۴۶%	۲%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۲۲۴	۱۶۳	۳۸۶	۵۸%	۲%
دارو رازک	درازک	۹۱	۸۳	۱۷۴	۵۲%	۱%
پخش هجرت	هجرت	۱۶۱	۱۸۵	۳۴۶	۴۷%	۳%
مواد داروپخش	دتماد	۱۱۶	۱۰۹	۲۲۵	۵۲%	۲%
کلر پارس	کلر	۲۲۷	۱۶۰	۳۸۷	۵۹%	۱%
دارو ابوریحان	دابور	۷۸	۴۴	۱۲۲	۶۴%	۲%
کاسپین تامین	کاسپین	۱۱۱	۱۲۰	۲۳۱	۴۸%	۳%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۵۰	۱۶۳	۳۱۳	۴۸%	۲%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۱۶۱	۱۸۷	۳۴۸	۴۶%	۲%
شیرین دارو	دشیری	۱۷۱	۱۹۶	۳۶۷	۴۷%	۱۲%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۱۲۸	۱۰۸	۲۳۶	۵۴%	۳%
دارویی ره آورد تامین	درهآور	۴۲۴	۳۶۱	۷۸۶	۵۴%	۴%
مجموع		۳,۴۰۷	۴,۵۵۳	۷,۹۶۰		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۱۸۰	۱۸۰	۳۶۰	۵۰%	۱%
سیمان صوفیان	سصوفی	۵۹	۴۸	۱۰۶	۵۵%	۱%
سیمان ارومیه	ساروم	۸۳	۶۹	۱۵۲	۵۵%	۱%
سیمان قائن	سقاین	۱۷۶	۲۴۸	۴۲۴	۴۲%	۲%
سیمان شاهرود	سرود	۱۰۵	۱۰۱	۲۰۶	۵۱%	۲%
سیمان ساوه	ساوه	۱۹۴	۱۵۸	۳۵۲	۵۵%	۲%
سیمان خوزستان	سخوز	۱۲۹	۷۳	۲۰۲	۶۴%	۲%
سیمان فارس	سفار	۶۳۱	۱,۰۱۸	۱,۶۴۹	۳۸%	۷%
سیمان خزر	سخزر	۱۵۹	۲۰۱	۳۶۰	۴۴%	۲%
سیمان فارس نو	سفانو	۹۶	۸۱	۱۷۷	۵۴%	۲%
سیمان بجنورد	سبجنو	۸۸	۹۸	۱۸۷	۴۷%	۲/۷%
سیمان بهبهان	سبهان	۲۰۱	۱۷۱	۳۷۲	۵۴%	۲%
سیمان غرب	سغرب	۱۰۵	۱۰۷	۲۱۲	۵۰%	۴%
سیمان خاش	سخاش	۵۶	۷۱	۱۲۷	۴۴%	۱%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۳۱۵	۲۹۳	۶۰۸	۵۲%	۳%
سیمان دورود	سدور	۱۳۶	۱۶۷	۳۰۳	۴۵%	۲%
فارسیت اهواز	سفاسی	۱۷۴	۱۶۸	۳۴۲	۵۱%	۶%
سیمان آبیک	سآبیک	۲۰۵	۴۲۱	۶۲۶	۳۳%	۴%
مجموع		۳,۰۹۲	۳,۶۷۳	۶,۷۶۵		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - سال مالی منتهی به ۱۴۰۲/۱۲/۲۹

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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 الکترونیک	لپارس	۶۷۰	۶۵۷	۱,۳۲۸	۵۰%	۲%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۶۹۵	۶۹۰	۱,۳۸۶	۵۰%	۴%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۳۳۲	۵۴۱	۸۷۴	۳۸%	۲%
کشت و دام گلدهشت نمونه اصفهان	زگلدهشت	۵۶۸	۵۱۵	۱,۰۸۳	۵۲%	۷%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۱۳۸	۱۱۹	۲۵۷	۵۴%	۱۱%
مجموع		۲,۴۰۴	۲,۵۲۲	۴,۹۲۶		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۷۵	۸۳	۱۵۸	۴۷%	۳%
کربن ایران	شکربن	۱۸۳	۲۲۱	۴۰۳	۴۵%	۱%
سرمایه‌گذاری ساختمان ایران	وساخت	۴۰	۰	۴۰	۱۰۰%	۰/۰۸%
لوله و گاز	پلوله	۲۴۲	۱۹۱	۴۳۳	۵۶%	۶%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۹۲	۱۰۵	۱۹۷	۴۷%	۲%
تکین کو	رتکو	۹۸	۱۴۹	۲۴۷	۴۰%	۴%
مجموع		۷۲۹	۷۴۹	۱,۴۷۹		



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۳۲۸	۲۵۳	۵۸۲	۵۶%	۲%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۶۳۶	۷۹۴	۱,۴۳۰	۴۴%	۶%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۱۳۴	۲۳۳	۳۶۷	۳۶%	۵%
مجموع		۱,۰۹۸	۱,۲۸۰	۲,۳۷۸		

خرید و فروش بازارگردان در سایر مجموعه‌ها

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (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	۲۸۵	۲۴۷	۵۳۲	۵۴%	۶%
پالایش نفت لاوان	شاوان	۷۰۳	۴۸۴	۱,۱۸۶	۵۹%	۳%
پتروشیمی امیرکبیر	شکبیر	۷۶۲	۴۴۴	۱,۲۰۵	۶۳%	۲۰%
سرمایه‌گذاری هامون صبا	وهامون	۱۶۰	۳۲۶	۴۸۶	۳۳%	۳%
ذوب آهن اصفهان	ذوب	۱,۰۳۱	۹۲۰	۱,۹۵۱	۵۳%	۱%
پالایشگاه نفت اصفهان	شپنا	۶۹۵	۲۶۶	۹۶۲	۷۲%	۰/۳۰%
مجموع		۳,۶۳۶	۲,۶۸۷	۶,۳۲۳		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ کشتیرانی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۲/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۲/۱۲/۲۹ (میلیارد ریال)

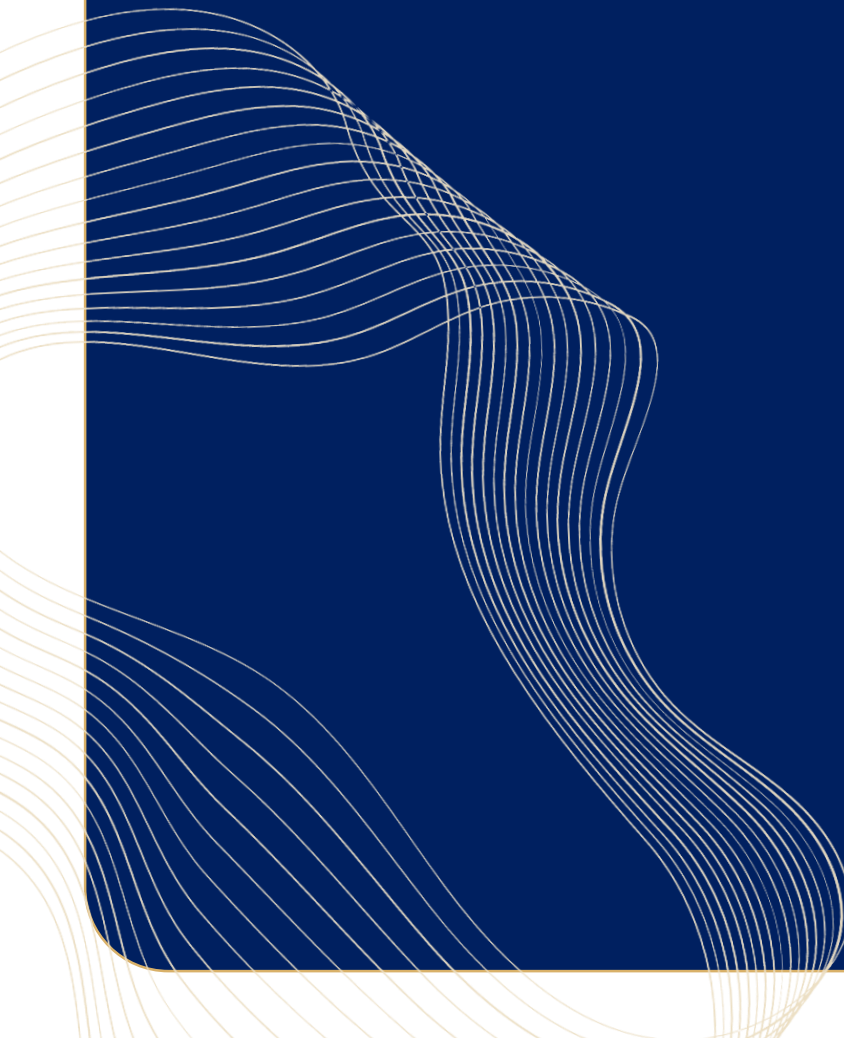
صندوق	نماد	مبلغ خرید طی دوره	مبلغ فروش طی دوره	مجموع ارزش معاملات صندوق	سهم خرید از ارزش معاملات صندوق	سهم بازارگردان از ارزش معاملات بازار سهم در دوره مذکور
کشتیرانی جمهوری اسلامی ایران	حکشتی	۷۰	۴۹۹	۵۶۹	۱۲%	۰/۳۴%
کشتیرانی دریای خزر	حخر	۵۹	۵۸	۱۱۷	۵۱%	۰/۴۸%
مجموع		۱۲۹	۵۵۷	۶۸۶		

۳۴.۶ درصد میانگین بازدهی شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر در سال ۱۴۰۲

درحالیکه در سال ۱۴۰۲ بازده شاخص کل ۹/۸٪ بوده است، ۵۹ نماد (۷۰ درصد) از شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در سال ۱۴۰۲

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
سفار	۱۶۹/۴۴	پسهند	۶۵/۶۴	دشیری	۵۱/۶۲	دفارا	۳۳/۴۷	بیوتیک	۱۶/۲۵	شکبیر	۶/۸۵	شپترو	-۲/۵۹
شلعاب	۱۲۳/۳۸	سنیر	۶۴/۹۳	دلر	۴۷/۶۰	سصوفی	۳۰/۲۲	سخوز	۱۴/۹۲	شستا	۶/۲۶	شغدیر	-۳/۵۱
کپشیر	۱۱۵/۸۵	سقاین	۶۳/۱۹	دشیمی	۴۷/۳۰	زگلدشت	۲۸/۰۳	وپخش	۱۳/۷۳	لپارس	۵/۲۹	شکمر	-۴/۶۱
حخر	۱۰۹/۷۶	شکربن	۶۲/۸۶	شفارا	۴۵/۲۰	حکشتی	۲۷/۸۵	سفاسی	۱۲/۴۹	صبا	۳/۳۴	رتکو	-۶/۰۲
چخر	۱۰۸/۶۵	دره‌آور	۶۲/۳۷	ساروم	۴۵/۱۷	فباهر	۲۶/۵۸	دارو	۱۱/۸۰	دزهرای	۳/۰۰	درازک	-۸/۵۵
وپترو	۹۹/۰۷	دتماد	۶۱/۳۸	ددام	۴۵/۱۲	کلوند	۲۶/۰۲	ذوب	۱۱/۷۵	سفانو	۱/۵۷	شاوان	-۹/۱۳
پکرمان	۹۱/۲۳	سبجنو	۶۰/۸۹	دقاضی	۴۴/۹۱	خراسان	۲۵/۱۱	سقاش	۱۰/۸۸	هجرت	۱/۱۹	وساخت	-۹/۳۰
شاملا	۸۸/۴۶	کاسپین	۶۰/۱۰	زملارد	۴۳/۷۷	شپنا	۲۳/۴۹	لطیف	۹/۰۵	چکاوه	۰/۱۵	کزغال	-۱۰/۳۱
وهامون	۸۴/۸۸	سدور	۵۹/۸۵	ساوه	۴۲/۹۷	پلوله	۲۲/۶۷	تاپیکو	۷/۸۱			کمر	-۱۲/۰۵
شدوص	۸۲/۵۳	شپاس	۵۹/۶۸	زفکا	۴۲/۲۴	سفارس	۲۰/۸۳	سخر	۷/۴۹			دابور	-۱۴/۱۹
سپهان	۷۶/۸۱	کسعدی	۵۹/۳۰	سرود	۳۹/۷۲	مداران	۱۸/۷۷	کفرا	۷/۳۰			دتوزیع	-۱۶/۴۷
سآبیک	۷۱/۰۳	سغرب	۵۴/۶۶	سیتا	۳۹/۲۵	تاصیکو	۱۶/۴۸	کخاک	۷/۰۷			شفن	-۱۷/۴۳
آباد	۶۷/۸۲	دکپسول	۵۲/۶۹	دپارس	۳۴/۵۹	تیپیکو	۱۶/۴۲	شرانل	۶/۹۷			لخانه	-۳۹/۲۵



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 کالایی و ...