



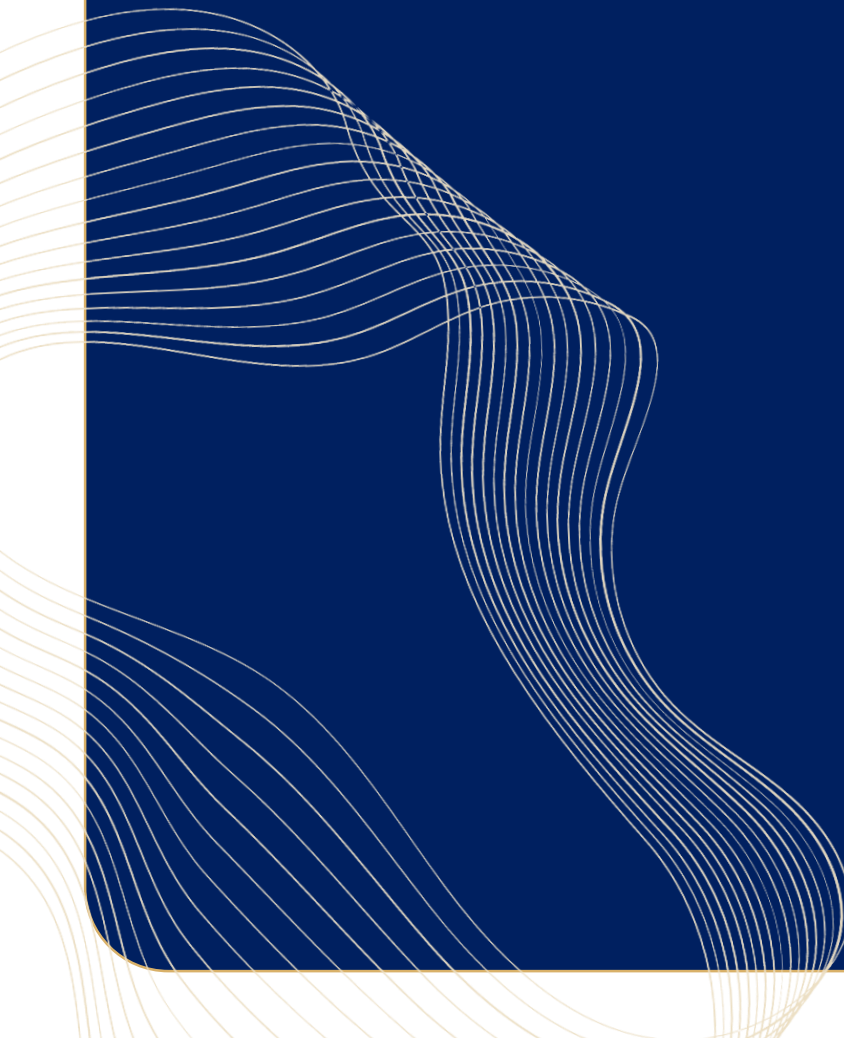
صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی
صباگستر نفت و گاز تامین

گزارش فعالیت مدیریت

صندوق بازارگردانی صباگستر نفت و گاز تامین

نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

מסורת
מסורת



فهرست



مقدمه و معرفی

ارکان و واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق

عملیات بازارگردانی

صورت سود و زیان صندوق در دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

صورت خالص دارایی صندوق در ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

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

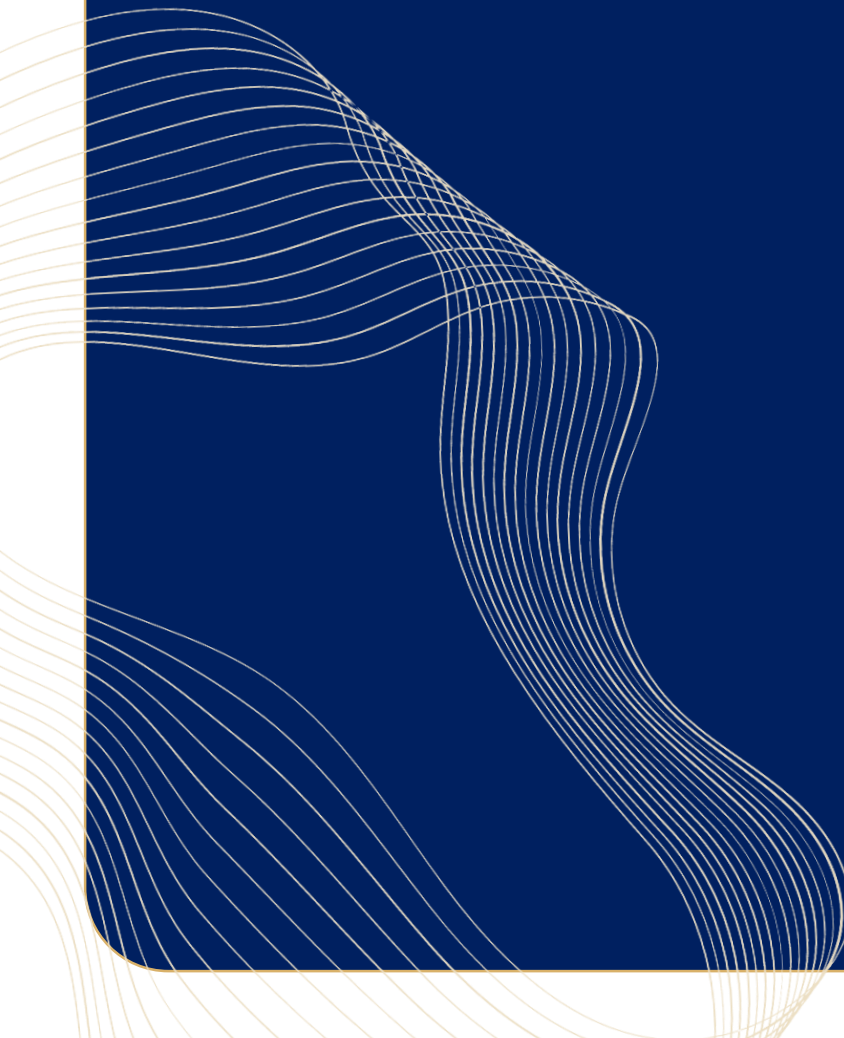
۶

۷

۸

۹

۱۰



بخش اول: معرفی و مقدمه

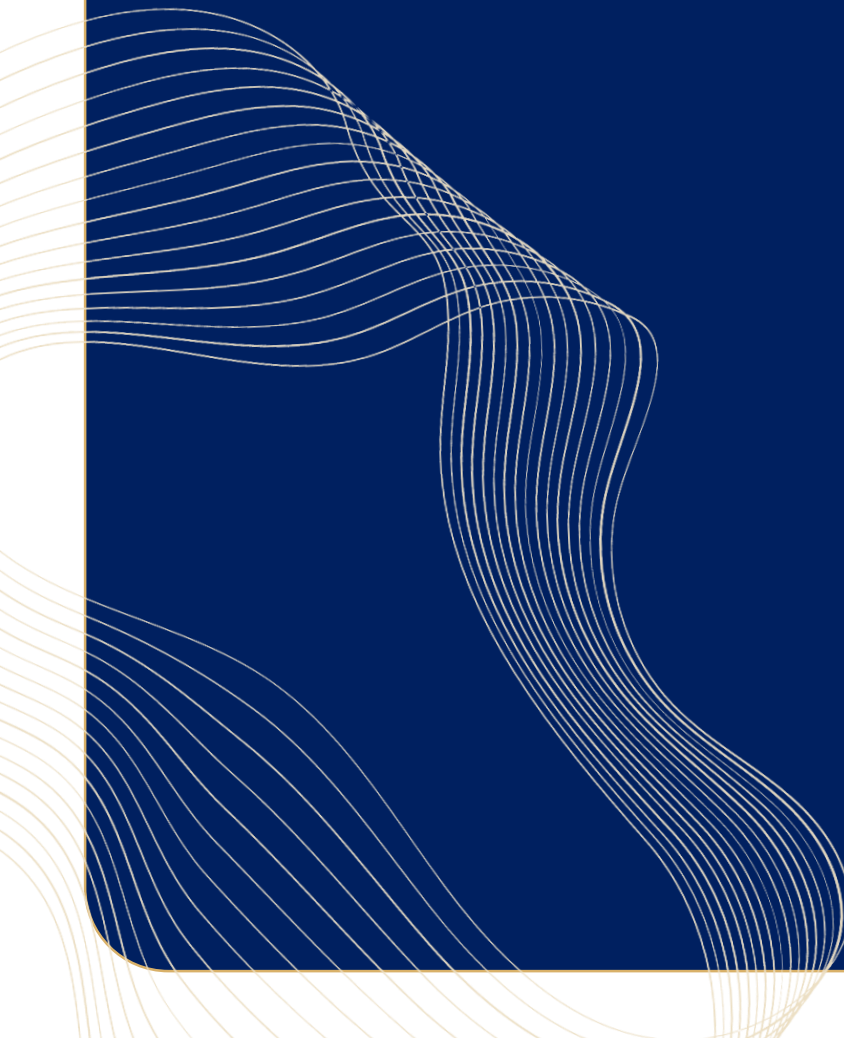
صندوق‌های بازارگردانی، شکلی از صندوق‌های سرمایه‌گذاری هستند که با جذب منابع (اوراق بهادار، وجه نقد) از سرمایه‌گذاران (ناشر و سهامداران عمده) مطابق دستورالعمل فعالیت بازارگردانی تعهدات مشخص شده از سوی شرکت بورس و فرابورس را ایفا می‌نمایند/ هدف بازارگردانی افزایش، کاهش و یا کنترل قیمت سهام نمی‌باشد/ بلکه 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 ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ این صندوق با ایفای تعهد بازارگردان ۸۲ نماد بورسی و فرابورسی به عنوان بزرگترین صندوق بازار سرمایه کشور از این حیث شناخته می‌شود/

در این تاریخ خالص ارزش دارایی‌های صندوق ۱۷۴,۰۵۷ میلیارد ریال می‌باشد که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ افزایش ۳۵/۵ درصدی داشته است/



بخش دوم:

ارکان و واحدهای سرمایه گذاری

رکن	دوره منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰	دوره منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰
مدیر	شرکت سبدگردان اندیشه صبا	شرکت سبدگردان اندیشه صبا
متولی	موسسه حسابرسی رهیافت	موسسه حسابرسی هوشیار ممیز و موسسه حسابرسی رهیافت
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 و بانک رفاه کارگران

در دوره نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ نسبت به دوره مشابه سال قبل، رکن متولی صندوق تغییر کرده و سایر ارکان بدون تغییر بوده است/

واحدهای سرمایه گذاری صندوق



سبدگردان
اندیشه صبا

نوع واحد	۱۴۰۲/۰۹/۳۰	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	
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	۷۰,۱۴۶,۷۸۴	۸۹,۹۴۰,۳۴۶	مجموع واحدهای عادی
-	۷۰,۲۳۶,۳۸۴	۹۰,۰۲۹,۹۴۶	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/

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/

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

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

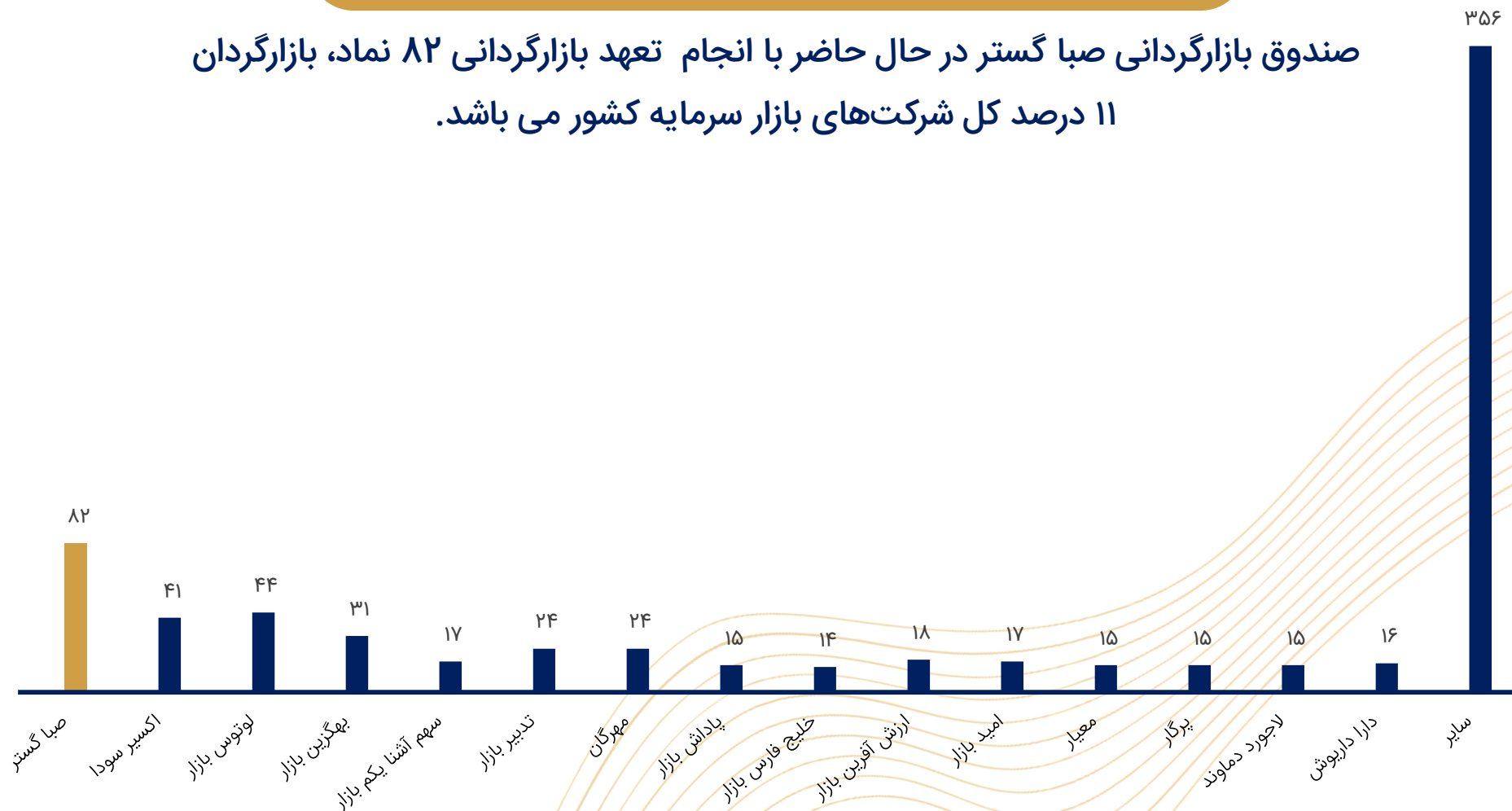


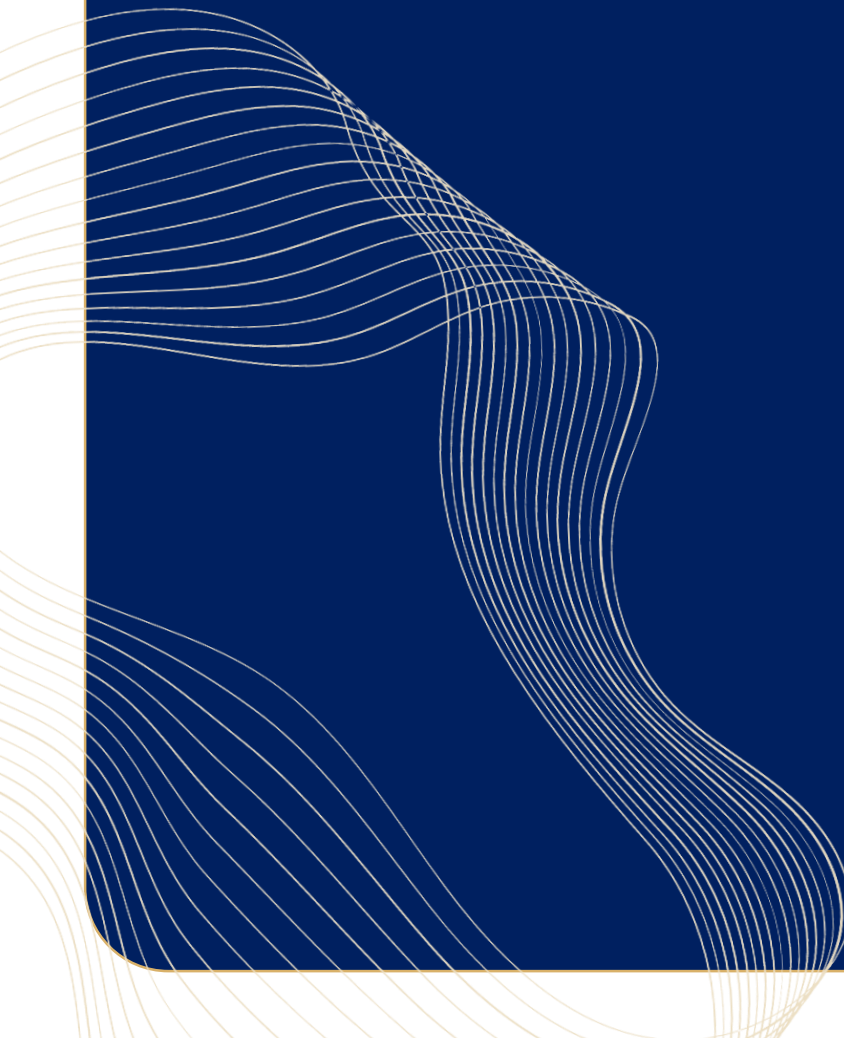
سازمان
اندریشه صبا

نماد						هلدینگ
تایپیکو	سیتا	تاصیکو	صبا	تایپیکو	شستا	هلدینگ شستا
پکرمان	شرانل	شغدیر	شپاس	خراسان	شفن	هلدینگ تایپیکو
			شپترو	شفارا	وپترو	
دارو	دقاضی	دفارا	دلر	دپارس	وپخش	هلدینگ تیپیکو
کلر	دتماد	هجرت	درازک	دتوزیع	دزهرای	
دکپسول	دشیری	ددام	دشیمی	کاسپین	دابور	
				بیوتیک	دره‌آور	
کلوند	کسعدی	کفرا	شاملا	فباهنر	کخاک	هلدینگ تاصیکو
		ذوب	شلعاب	کزغال	کپشیر	
ساوه	سرود	سقاین	ساروم	سصوفی	سفارس	هلدینگ سیتا
سبهان	سبجنو	سفانو	سخرز	سفار	سخوز	
	سآبیک	سدور	سنیر	سخاش	سغرب	
	لخانه	زگلدشت	زملارد	زفکا	لپارس	هلدینگ صنایع عمومی
	وساخت	پلوله	شدوص	شکربن	پسهند	هلدینگ وپترو
			لطیف	چخزر	چکاوه	هلدینگ سلولزی
			وثنو	شپنا	شاون	سایر
				حخرز	حکشتی	هلدینگ کشتیرانی جمهوری اسلامی
					آباد	هلدینگ هگتا
	صندوق پتروصبا	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 ۸۲ نماد، بازارگردان ۱۱ درصد کل شرکتهای بازار سرمایه کشور می باشد.





بخش چهارم:

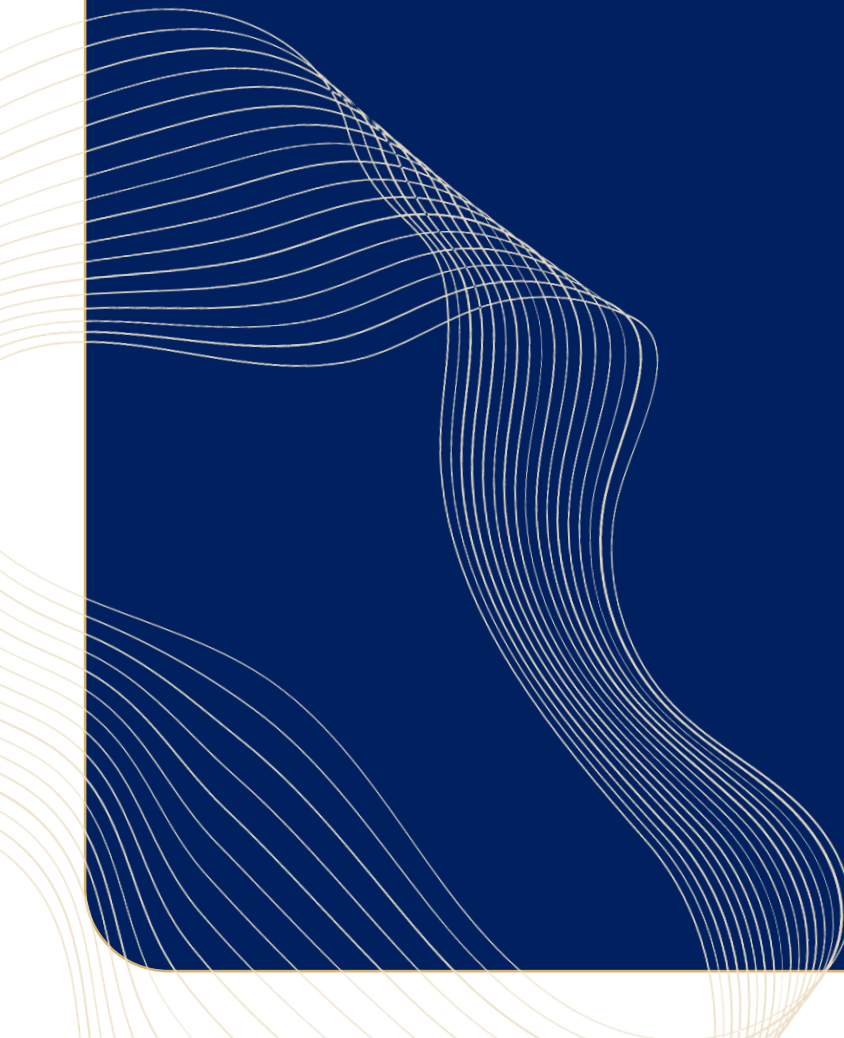
صورت سود و زیان صندوق

صورت سود و زیان

صورت سود و زیان صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح/دوره	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰	نه ماهه منتهی به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰
درآمدها :		
سود(زیان) فروش اوراق بهادار	۱,۹۸۵,۴۵۱	۳,۹۲۶,۷۸۷
سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار	۱۱,۵۸۵,۸۵۷	۱۰,۷۲۶,۲۱۱
سود سهام	۱۳,۶۹۰,۷۱۰	۱۰,۷۹۷,۴۲۹
سود اوراق بهادار با درآمد ثابت یا علی الحساب	۱۴۳,۳۰۰	۵۷۱,۵۲۸
درآمد حاصل از بازارگردانی	۴۵,۱۵۴	۴۰,۳۰۵
سایر درآمدها	۰/۰۰۹	۳,۲۹۱
جمع درآمدها	۲۷,۴۵۰,۴۷۳	۲۶,۰۶۵,۵۵۲
هزینه‌ها :		
هزینه کارمزد ارکان	-۸۷۰,۷۰۶	-۷۰۸,۱۷۳
سایر هزینه‌ها	-۴۷,۴۰۷	-۲۶,۱۶۱
هزینه مالی	-۹,۶۱۰	-۹,۰۴۷
جمع هزینه‌ها	-۹۲۷,۷۲۴	-۷۴۳,۳۸۱
سود (زیان) خالص	۲۶,۵۲۲,۷۴۹	۲۵,۳۲۲,۱۷۰

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر – نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰



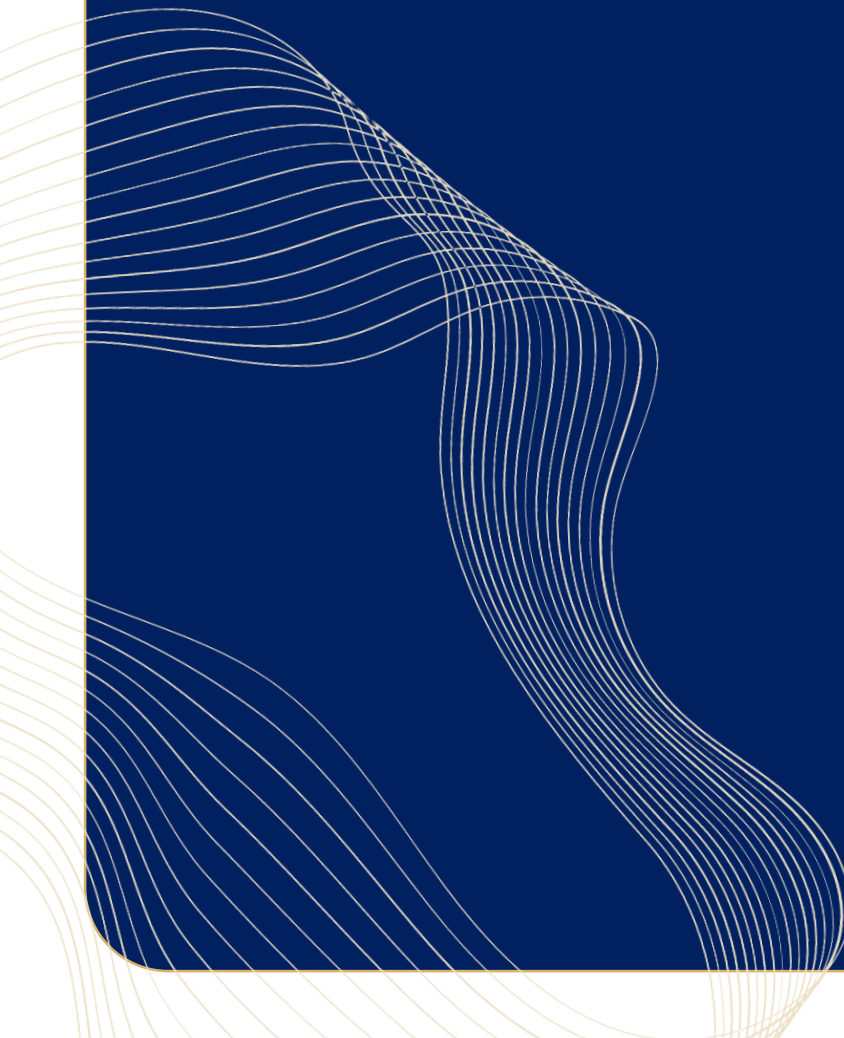
بخش پنجم:

صورت خالص دارایی ها صندوق

صورت خالص دارایی‌ها

صورت خالص دارایی‌ها صندوق صباگستر (میلیون ریال)

شرح	۱۴۰۳/۰۹/۳۰	۱۴۰۲/۱۲/۲۹
دارایی‌ها :		
سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم	۱۳۶,۷۵۴,۹۶۶	۹۰,۹۹۰,۱۴۳
سرمایه‌گذاری در سپرده و گواهی سپرده بانکی	۷۶۱,۹۹۸	۱۵۱,۳۷۹
سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۶۰,۱۲۷	۹۰۲,۹۰۷
سرمایه‌گذاری در واحد صندوق‌های سرمایه‌گذاری	۲۳,۵۱۱,۷۹۰	۲۵,۰۸۳,۹۵۰
حساب‌های دریافتی	۱۳,۸۰۳,۶۵۲	۶,۹۴۱,۴۸۳
سایر دارایی‌ها	۳,۱۹۵	۰
موجودی نقد	۱,۱۱۶,۳۲۶	۵۰
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۱۲۹,۶۶۷	۴۲,۸۲۷
جمع دارایی‌ها	۱۷۶,۱۴۱,۷۲۴	۱۲۴,۱۱۲,۷۴۲
بدهی‌ها :		
جاری کارگزاران و صندوق‌ها	۱,۵۸۵,۵۶۸	۰
پرداختی به ارکان صندوق	۴۷۲,۱۸۰	۳۶۵,۰۰۹
سایر حساب‌های پرداختی و ذخایر	۲۶,۵۴۱	۹,۸۰۳
بدهی به سرمایه‌گذاران	۱۶۲	۱۶۰
جمع بدهی‌ها	۴۹۸,۸۸۳	۳۷۴,۹۷۲
خالص دارایی‌ها	۱۷۴,۰۵۷,۲۷۳	۱۲۳,۷۳۷,۷۷۰
خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری	۱,۹۳۳,۳۲۶	۱,۷۳۶,۷۶۰

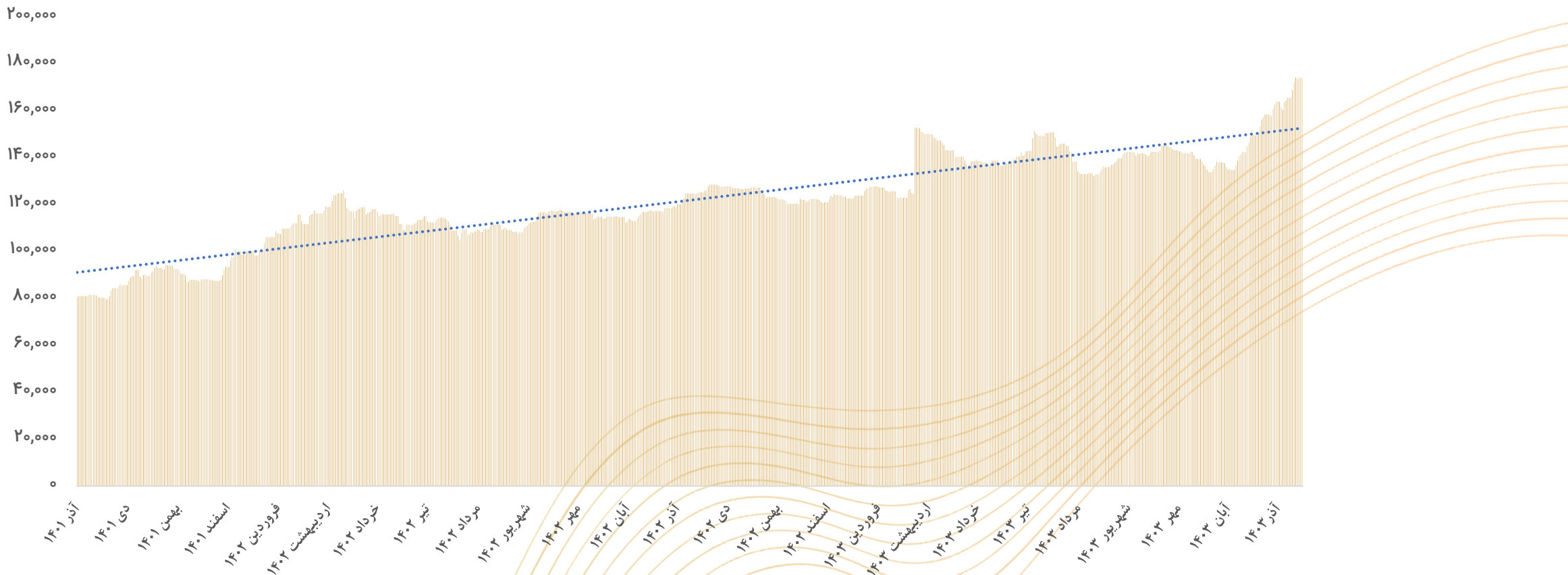


بخش ششم:

خالص ارزش دارایی ها صندوق

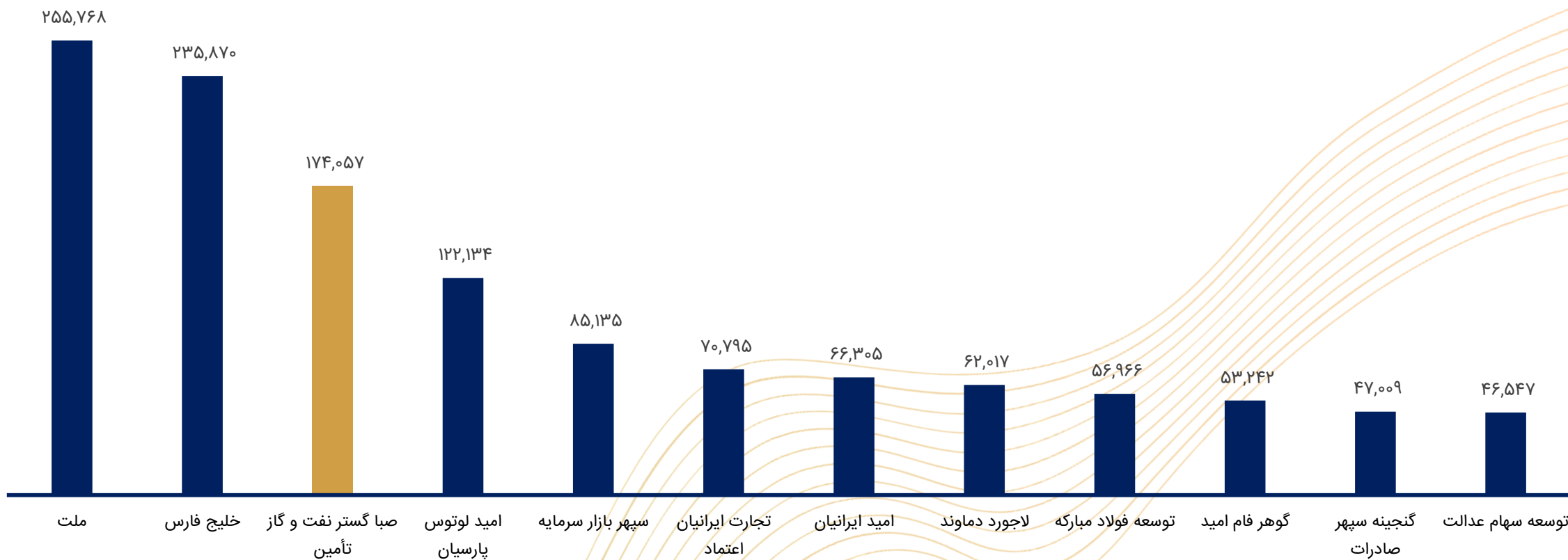
روند خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)

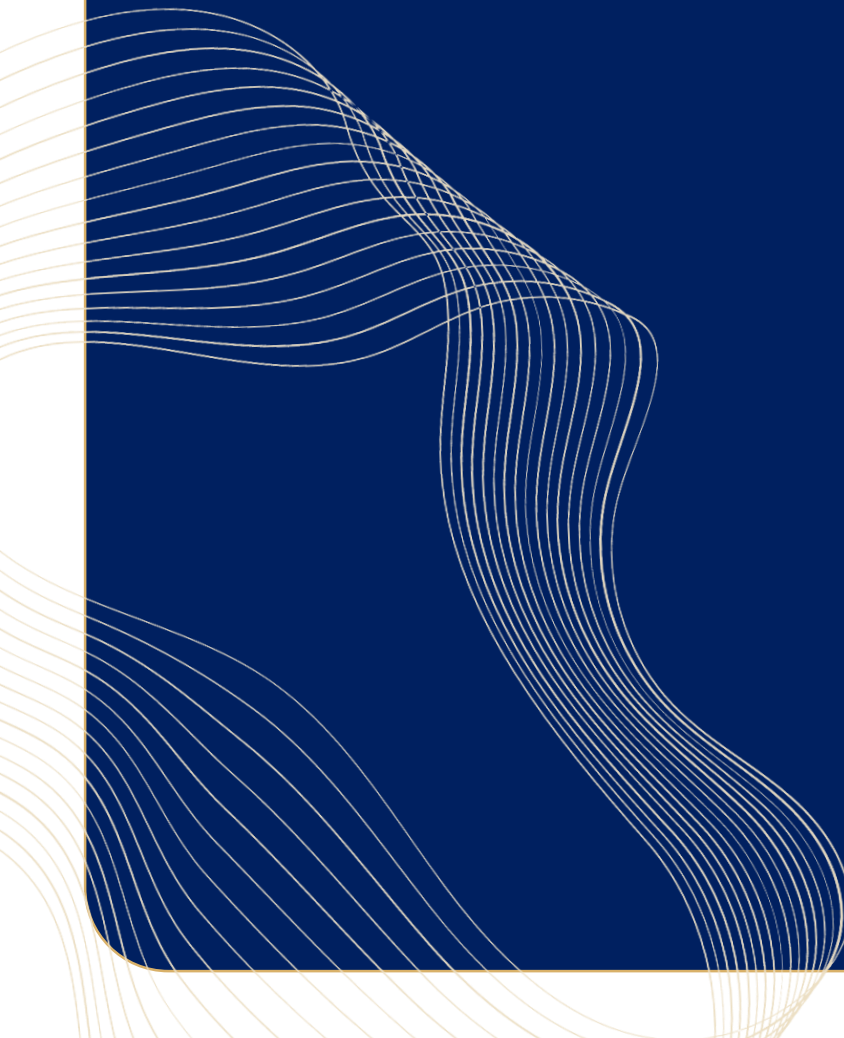
در تاریخ ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ خالص ارزش دارایی صندوق صباگستر ۱۷۴,۰۵۷ میلیارد ریال بوده است که این مبلغ نسبت به ۱۴۰۲/۰۹/۳۰ **افزایش ۳۵/۵ درصدی** را تجربه کرده است/



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

خالص ارزش دارایی در ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (میلیارد ریال)





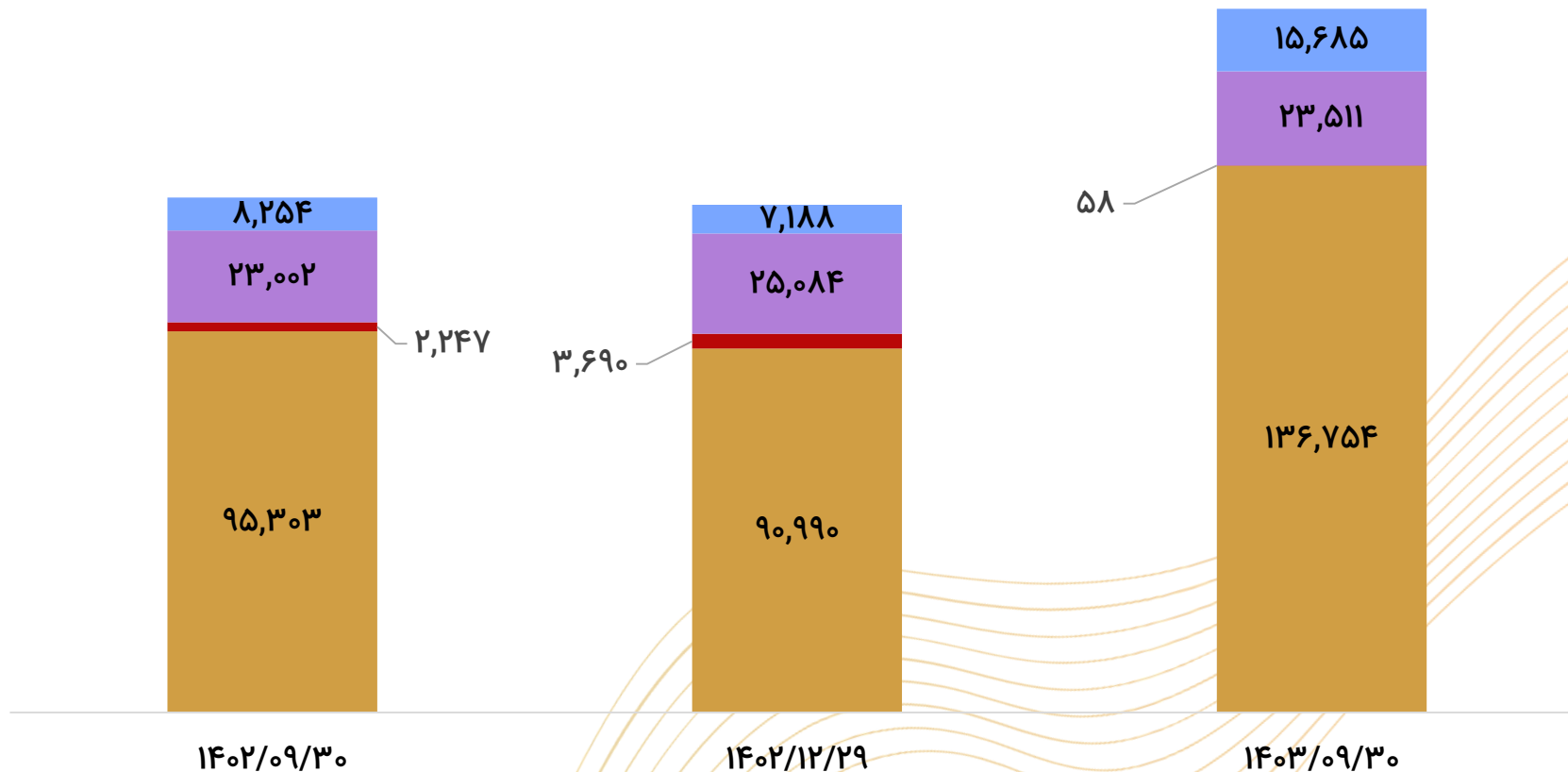
بخش هفتم:

ترکیب دارایی ها صندوق

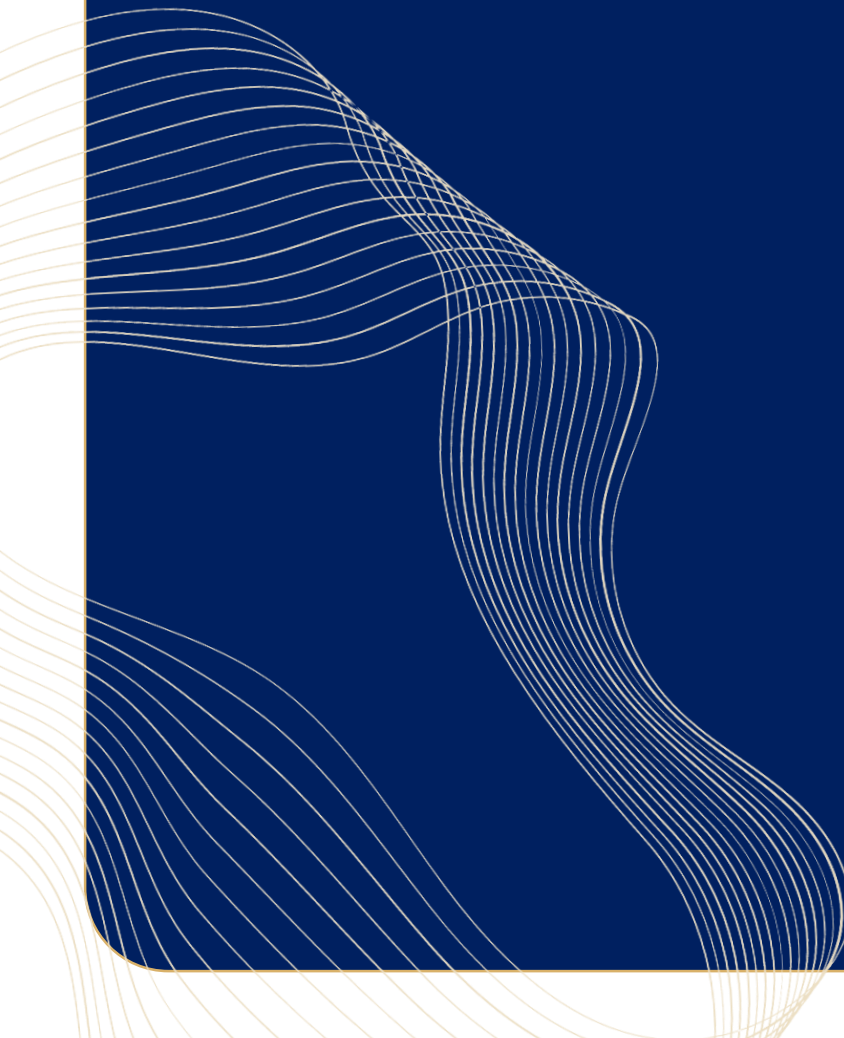
ترکیب دارایی‌های صندوق

ترکیب دارایی های صندوق صباگستر به تفکیک (میلیارد ریال)

سایر صندوق اوراق سهام و حق تقدم



عمده (۸۸ درصد) بخش سایر، مربوط به حساب سود دریافتی (سررسید نشده) می باشد که به تدریج از شرکت‌ها وصول می‌گردد.

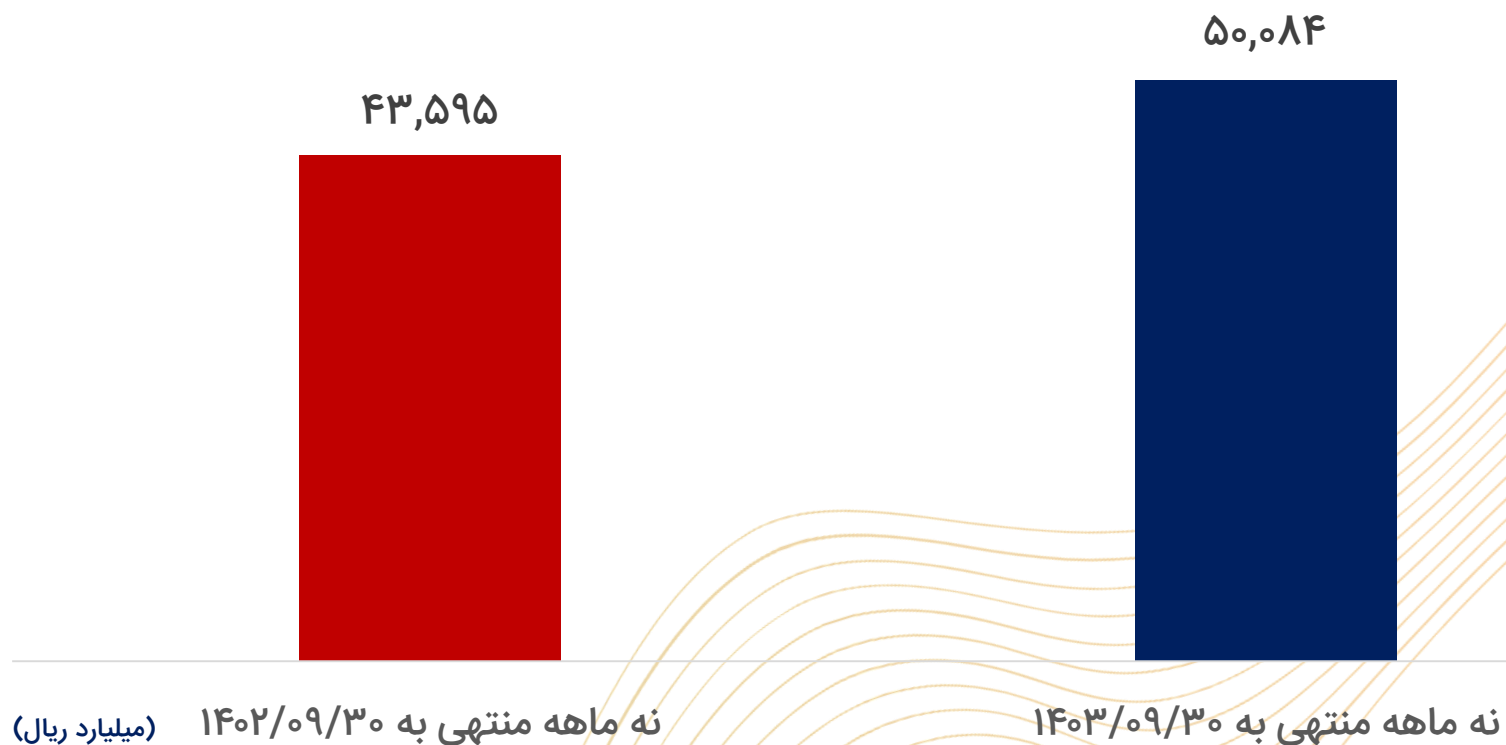


بخش هشتم:

معاملات سهام صندوق

ارزش معاملات سهام صندوق صباگستر

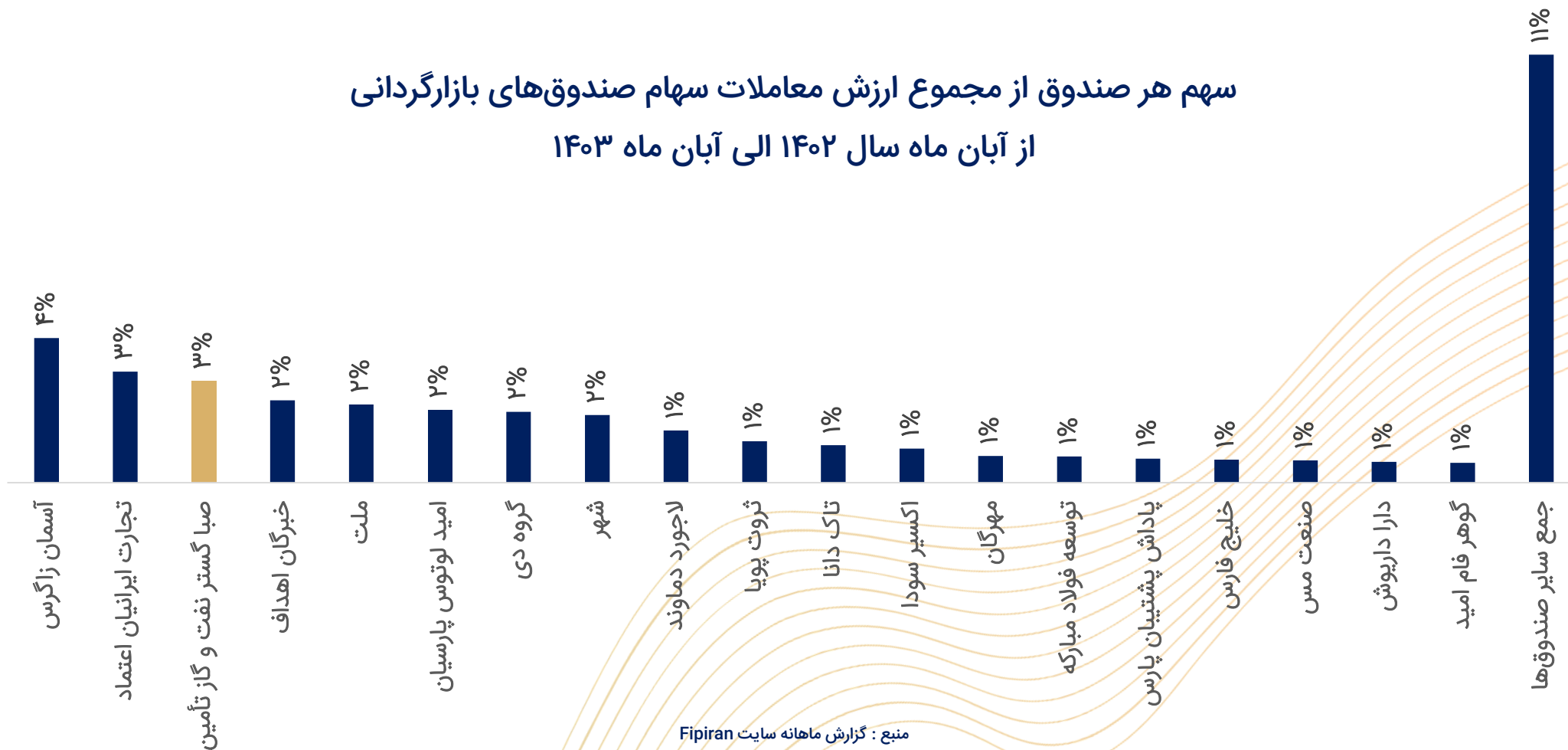
با افزایش ارزش معاملات در بازار سرمایه در ۹ ماهه منتهی به آذر ۱۴۰۳ نسبت به مدت مشابه سال گذشته، ارزش معاملات سهام صندوق صباگستر افزایش ۱۵ درصدی را تجربه کرده است.



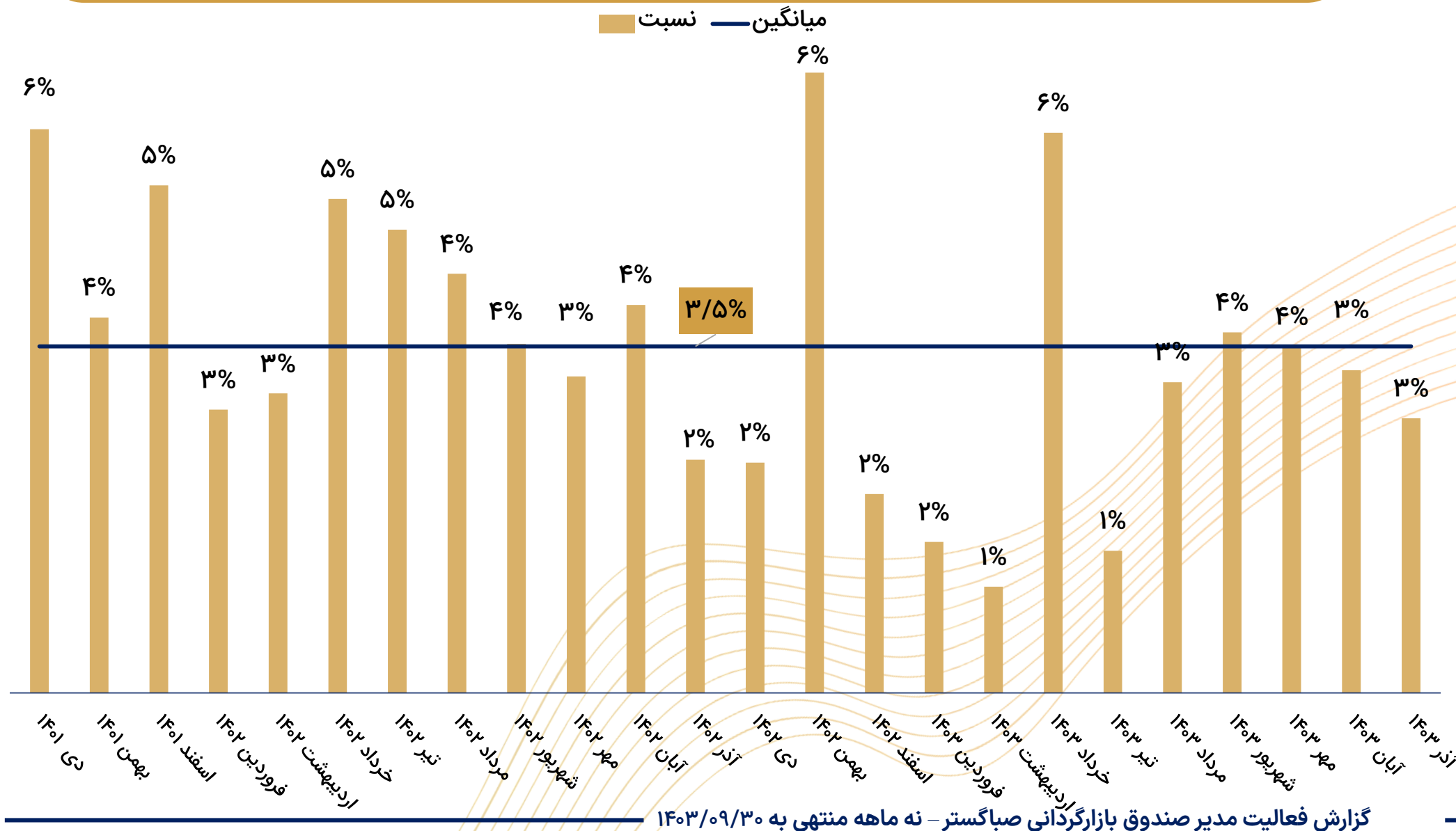
سومین صندوق فعال بازارگردانی بازار سرمایه کشور

با در اختیار داشتن سهم ۳ درصدی از کل ارزش معاملات سهام صندوق‌های بازارگردانی

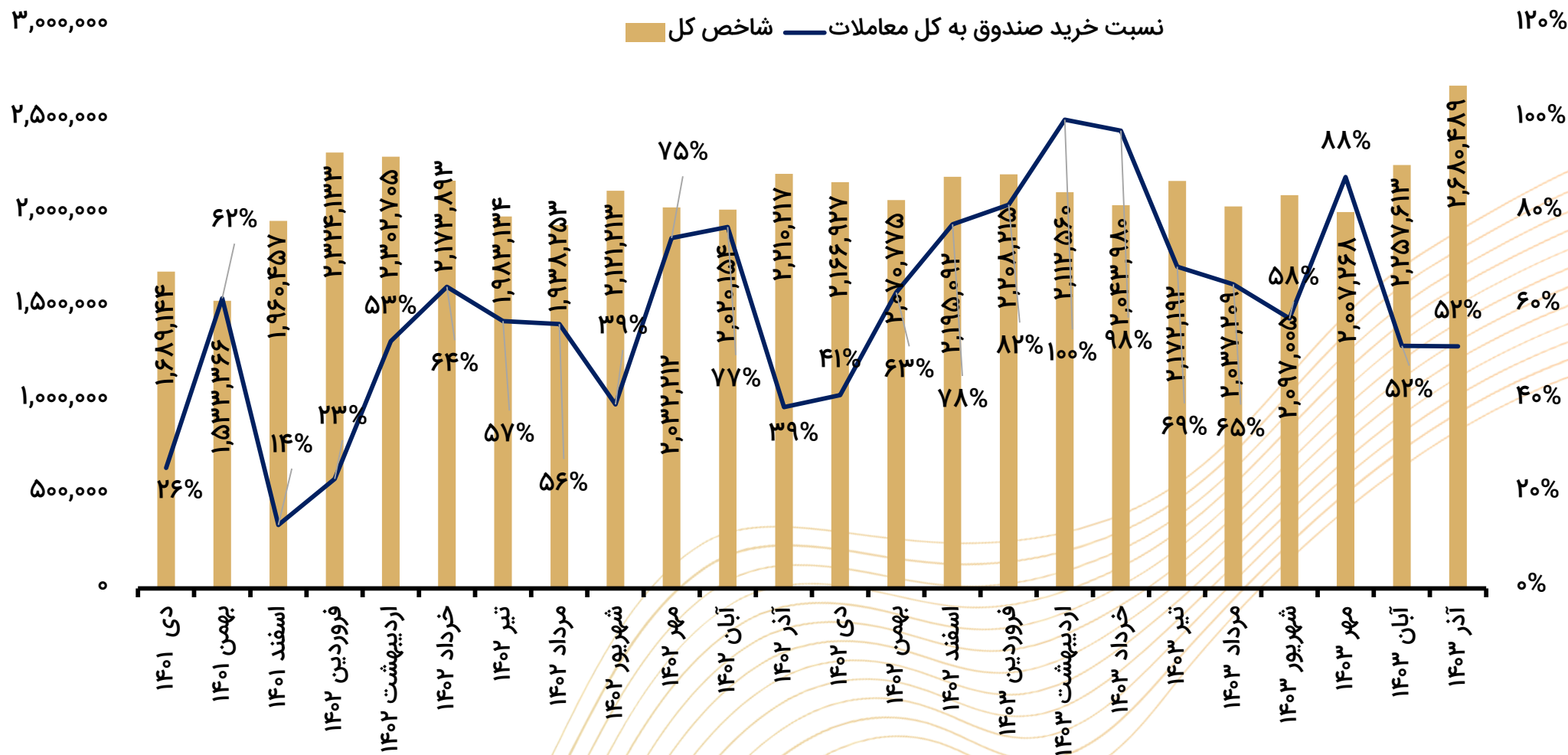
سهم هر صندوق از مجموع ارزش معاملات سهام صندوق‌های بازارگردانی
از آبان ماه سال ۱۴۰۲ الی آبان ماه ۱۴۰۳

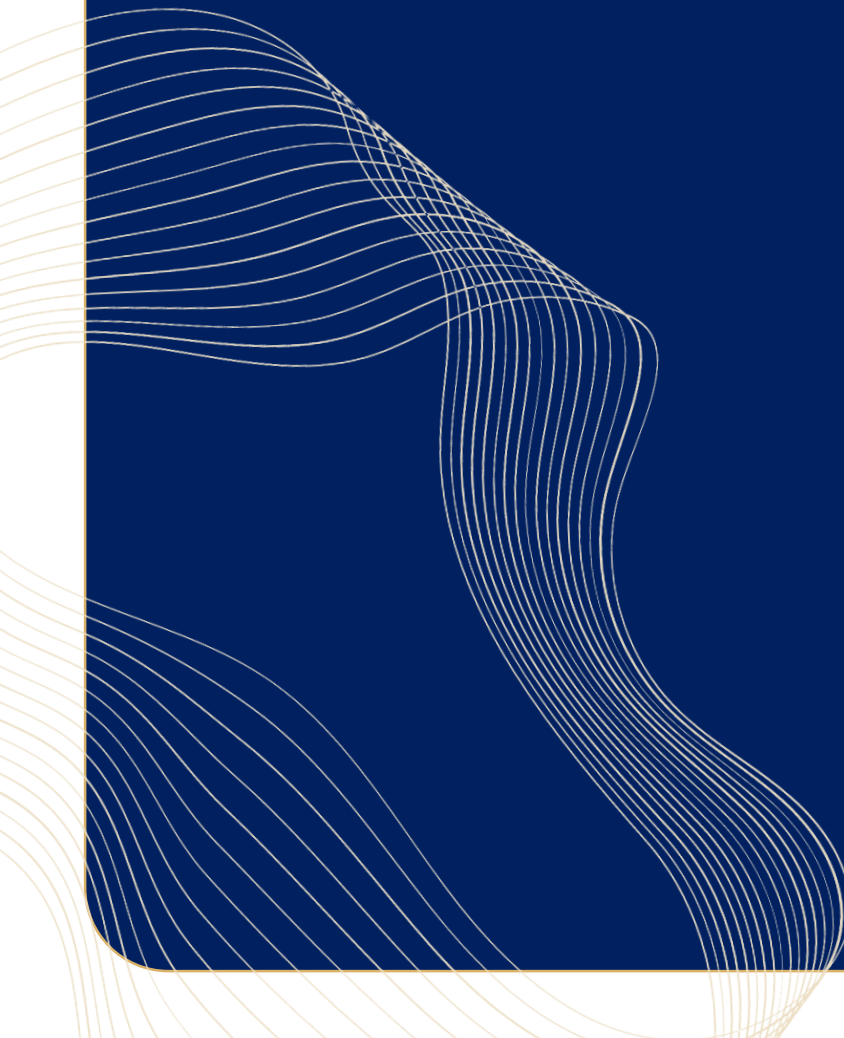


روند سهم معاملات صباگستر از ارزش ماهانه معاملات نمادهای موضوع بازارگردانی



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 ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۱,۵۵۳	۵۰۳	۲,۰۵۶	۷۶%	۲/۷%
سر/ نفت و گاز تامین	تاپیکو	۴۵۸	۱۷۸	۶۳۷	۷۲%	۳%
سر/ صبا تامین	صبا	۷۰۲	۵۳۹	۱,۲۴۰	۵۷%	۱۰%
سر/ صدر تامین	تاصیکو	۱۲۲	۲۳۶	۳۵۸	۳۴%	۲%
سر/ سیمان تامین	سیتا	۶۶	۸۱	۱۴۷	۴۵%	۲%
سر/ دارویی تامین	تیپیکو	۱۲۴	۴۳	۱۶۷	۷۴%	۳%
مجموع		۳,۰۲۴	۱,۵۸۰	۴,۶۰۵		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۱۴۵	۳۹	۱۸۴	۷۹%	۲/۱%
پتروشیمی خراسان	خراسان	۳۹	۳۴	۷۳	۵۴%	۲/۷%
نفت پاسارگاد	شپاس	۵۷	۰	۵۷	۱۰۰%	۳%
پتروشیمی غدیر	شغدیر	۱۷۰	۲۱	۱۹۱	۸۹%	۴%
نفت ایرانول	شرانل	۲۰	۰	۲۰	۱۰۰%	۱%
صنعتی بارز	پکرمان	۷۲	۶۹	۱۴۱	۵۱%	۱%
سرمایه گذاری صنایع پتروشیمی	ویپترو	۱۲۲	۵۸	۱۸۰	۶۸%	۳%
پتروشیمی فارابی	شفارا	۱۶۹	۱۴	۱۸۳	۹۳%	۷%
پتروشیمی آبادان	شپترو	۸۶/۱۷	۱/۲۷	۸۷	۹۹%	۴%
مجموع		۸۸۱	۲۳۶	۱,۱۱۶		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تاسیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۴۹	۱۲	۶۰	۸۱%	۱%
مس باهنر	فباهنر	۴۱	۰	۴۱	۱۰۰%	۰/۱%
معدنی املاح ایران	شاملا	۱۳۰	۳۰	۱۶۰	۸۱%	۲%
فرآورده های نسوز ایران	کفرا	۱۱۵	۱۰	۱۲۵	۹۲%	۶%
کاشی سعدی	کسعدی	۸۹	۳۴	۱۲۳	۷۲%	۳%
کاشی الوند	کلوند	۶۱	۰	۶۱	۱۰۰%	۲%
زغال پرورده طبس	کزغال	۱۳۷	۱۶۳	۲۹۹	۴۶%	۸%
پشم شیشه ایران	کپشیر	۱۶۱	۱۰۳	۲۶۴	۶۱%	۴%
لعابیران	شلعاب	۹۵	۴۴	۱۳۹	۶۸%	۲%
مجموع		۸۷۸	۳۹۵	۱,۲۷۳		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ تیپیکو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	وپخش	۱۶۵	۰	۱۶۵	۱۰۰%	۷%
پارس دارو	دپارس	۷۵	۱۵	۹۰	۸۳%	۳%
دارو اکسیر	دلر	۳۱	۳۱	۶۳	۵۰%	۳%
دارو فارابی	دفارا	۷۶	۷۳	۱۴۹	۵۱%	۲%
داروسازی قاضی	دقاضی	۲۲	۶	۲۷	۷۹%	۴%
کارخانجات داروپخش	دارو	۴۴	۲۳	۶۷	۶۶%	۴%
دارو زهراوی	دزهراوی	۸۸	۱۲	۱۰۰	۸۸%	۸%
توزیع داروپخش	دتوزیع	۸۰	۴۴	۱۲۴	۶۵%	۴%
دارو رازک	درازک	۱۱۱	۰	۱۱۱	۱۰۰%	۲%
پخش هجرت	هجرت	۴۷	۰	۴۷	۱۰۰%	۱%
مواد داروپخش	دتماد	۸۳	۷۴	۱۵۷	۵۳%	۵%
کلر پارس	کلر	۷۰	۲	۷۱	۹۷%	۱%
دارو ابوریحان	دابور	۳۴	۲	۳۷	۹۳%	۱%
آنتی‌بیوتیک‌سازی ایران	بیوتیک	۴۸۶	۱۴۱	۶۲۷	۷۸%	۱۱%
کاسپین تامین	کاسپین	۴۱	۱۸	۶۰	۷۰%	۳%
شیمی داروپخش	دشیمی	۱۰۰	۸	۱۰۸	۹۳%	۵%
زاگرس فارمد پارس	ددام	۳۹	۵	۴۴	۸۸%	۳%
شیرین دارو	دشیری	۳۶	۵۶	۹۲	۳۹%	۱۶%
تولید ژلاتین کپسول ایران	دکپسول	۴۸	۵	۵۳	۹۱%	۲%
دارویی ره آورد تامین	دره‌آور	۵۹	۹۱	۱۵۰	۳۹%	۴%
مجموع		۱,۷۳۴	۶۰۶	۲,۳۴۰		

گزارش فعالیت مدیر صندوق بازارگردانی صباگستر - نه ماهه منتهی به ۱۴۰۳/۰۹/۳۰

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سیتا

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۱۴۷	۵۵	۲۰۳	۷۳%	۲%
سیمان صوفیان	سصوفی	۱۳۳	۲۶	۱۶۰	۸۳%	۲%
سیمان ارومیه	ساروم	۴۴	۵	۴۹	۹۰%	۱%
سیمان قائن	سقاین	۶۹	۹	۷۸	۸۸%	۴%
سیمان شاهرود	سرود	۱	۰	۱	۱۰۰%	۰%
سیمان ساوه	ساوه	۱۳۱	۸۶	۲۱۶	۶۰%	۵%
سیمان خوزستان	سخوز	۳۵	۰	۳۵	۱۰۰%	۱%
سیمان فارس	سفار	۲۹۳	۴۹	۳۴۲	۸۶%	۱۱%
سیمان خزر	سخزر	۳۹	۱۷	۵۶	۷۰%	۲%
سیمان فارس نو	سفانو	۶۲	۵	۶۷	۹۳%	۴%
سیمان بجنورد	سبجنو	۵۲	۴	۵۶	۹۳%	۲/۹%
سیمان بهبهان	سبهان	۹۲	۴۵	۱۳۷	۶۷%	۴%
سیمان غرب	سغرب	۱۶	۵	۲۱	۷۷%	۱%
سیمان خاش	سخاش	۵۰	۴۰	۹۰	۵۵%	۲%
سیمان سفید نی ریز	سنیر	۱۳۹	۵۱	۱۹۰	۷۳%	۹%
سیمان دورود	سدور	۵۲	۸	۶۱	۸۶%	۴%
سیمان آبیک	سآبیک	۱۱۴	۹۳	۲۰۷	۵۵%	۴%
مجموع		۶۲۵	۸۶	۷۱۱		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ صنایع عمومی



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۲۰	۲۲	۴۱	۴۷%	۱%
کشت و دامداری فکا	زفکا	۱۴۳	۲۳	۱۶۶	۸۶%	۳%
کشاورزی و دامپروری ملارد شیر	زملارد	۲۵۳	۱۱۸	۳۷۱	۶۸%	۵%
کشت و دام گلدهشت نمونه اصفهان	زگلدهشت	۵۴	۶۱	۱۱۶	۴۷%	۶%
لوازم خانگی پارس	لخانه	۰	۰	۰	۰%	۰%
مجموع		۴۷۰	۲۲۴	۶۹۴		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ وپترو

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۳۷	۷۳	۱۱۰	۳۴%	۶%
کربن ایران	شکرین	۱۹۷	۶۵	۲۶۳	۷۵%	۲%
لوله و گاز	پلوله	۳۱	۷	۳۸	۸۲%	۵%
دوده صنعتی پارس	شدوص	۱۷۴	۸	۱۸۳	۹۵%	۲%
سرمایه‌گذاری ساختمان ایران	وساخت	۱۴۱	۹۸	۲۳۹	۵۹%	۳%
مجموع		۵۸۰	۲۵۱	۸۳۱		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ سلولزی



گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۴۸	۵	۵۳	۹۱%	۲%
صنایع چوب خزر کاسپین	چخزر	۱۷۱	۴۴	۲۱۵	۷۹%	۱۰%
محصولات کاغذی لطیف	لطیف	۱۰۴	۴	۱۰۸	۹۷%	۸%
مجموع		۳۲۳	۵۳	۳۷۶		

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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
پالایش نفت لاوان	شاوان	۳۶۵	۲۶۶	۶۳۱	۵۸%	۷%
سرمایه‌گذاری هامون صبا	وهامون	۱۸۰	۲۷	۲۰۷	۸۷%	۵%
ذوب آهن اصفهان	ذوب	۹۵۳	۷۱۰	۱,۶۶۳	۵۷%	۲%
توریستی و رفاهی آبادگران ایران	آباد	۴۸	۳۹	۸۷	۵۵%	۲%
پالایشگاه نفت اصفهان	شپنا	۶۹۰	۵۸۸	۱,۲۷۸	۵۴%	۲%
ساختمان نوین	وثنو	۱۰۳	۱۰۷	۲۱۰	۴۹%	۴%
مجموع		۲,۳۳۹	۱,۷۳۷	۴,۰۷۶		

خرید و فروش بازارگردان در هلدینگ کشتیرانی

گزارش عملیات صندوق بازارگردانی صباگستر از ۱۴۰۳/۰۱/۰۱ الی ۱۴۰۳/۰۹/۳۰ (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	۱,۷۲۸	۹۵۰	۲,۶۷۸	۶۵%	۷%
کشتیرانی دریای خزر	حخر	۱۹۶	۷۰	۲۶۶	۷۴%	۶%
مجموع		۱,۹۲۳	۱,۰۲۰	۲,۹۴۳		

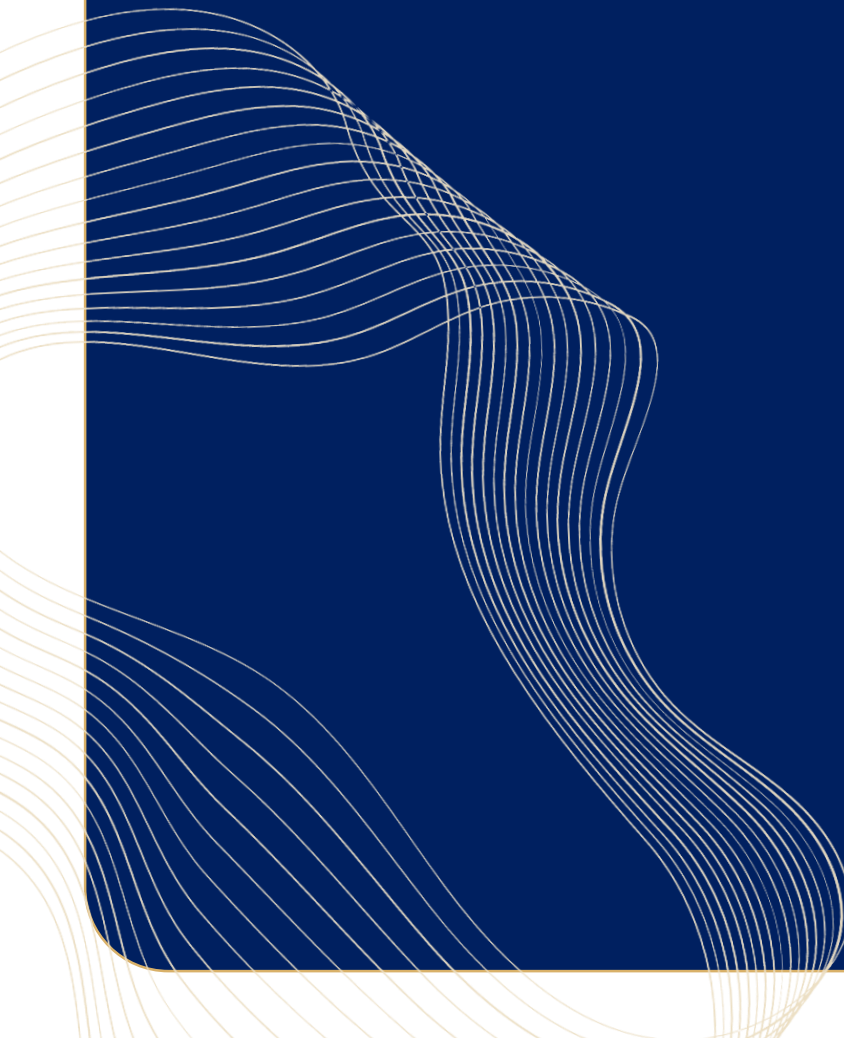
۱۲/۹۲ درصد میانگین بازدهی شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق

صباگستر در ۹ ماهه نخست سال ۱۴۰۳

درحالیکه در ۹ ماهه نخست سال ۱۴۰۳ بازده شاخص کل ۱۹/۸٪ بوده است، ۳۶ نماد (۳۷ درصد) از شرکت‌های موضوع بازارگردانی صندوق صباگستر عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل را ثبت نمودند

بازدهی قیمتی در ۹ ماهه نخست سال ۱۴۰۳

نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی	نماد	بازدهی
شدرص	۸۹/۸۰	سخزر	۴۲/۹۶	شستا	۳۰/۵۸	شپاس	۱۶/۹۷	دقاضی	۲/۶۶	وهامون	-۱۴/۲۸	سدور	-۲۸/۲۴
شکربن	۷۱/۷۸	حکشتی	۴۱/۲۸	شاملا	۳۰/۳۹	لطیف	۱۶/۷۷	زگلدشت	۲/۱۵	وساخت	-۱۴/۷۰	شفارا	-۳۴/۱۱
سصوفی	۷۰/۱۱	پکرمان	۴۰/۶۸	دتماد	۲۹/۷۵	دتوزیع	۱۵/۱۲	سقاین	-۰/۹۷	آباد	-۱۶/۵۳	وثنو	-۴۲/۶۲
ساروم	۶۳/۳۳	زفکا	۴۰/۴۳	سفانو	۲۷/۵۱	شفن	۱۱/۴۱	شپنا	-۵/۰۰	چکاو	-۱۷/۱۳	حخرز	-۴۷/۱۶
سفارس	۶۰/۹۳	سبجنو	۳۹/۵۲	کپشیر	۲۶/۵۷	دلر	۱۱/۰۰	کسعدی	-۵/۶۸	لپارس	-۱۸/۷۴		
فباهر	۵۵/۷۳	شاوان	۳۷/۱۰	دشیری	۲۶/۳۳	ذوب	۱۰/۷۲	دزهرای	-۸/۰۵	شپترو	-۱۸/۸۱		
ساوه	۵۵/۰۱	کخاک	۳۶/۶۱	کمر	۲۳/۳۷	سرود	۱۰/۶۵	کفرا	-۸/۶۰	دارو	-۲۰/۸۷		
سیتا	۵۳/۲۵	تاپیکو	۳۶/۰۴	کلوند	۲۳/۱۷	دکپسول	۱۰/۶۵	شغدیر	-۹/۲۷	پلوله	-۲۰/۹۵		
سخاص	۵۲/۹۸	صبا	۳۴/۶۸	دابور	۲۱/۱۳	دفارا	۸/۹۷	چخرز	-۱۱/۴۰	شلعاب	-۲۲/۵۴		
سآبیک	۵۲/۰۱	سغرب	۳۳/۹۹	بیوتیک	۲۰/۵۹	دپارس	۷/۴۳	سنیر	-۱۲/۰۴	دشیمی	-۲۳/۶۰		
تاصیکو	۴۷/۶۰	کاسپین	۳۳/۶۳	سبهان	۱۸/۹۱	سخوز	۶/۹۵	ددام	-۱۲/۶۰	سفار	-۲۴/۰۳		
پسهند	۴۴/۲۷	شرانل	۳۱/۸۷	دره‌آور	۱۸/۱۸	تیپیکو	۳/۸۳	درازک	-۱۳/۸۹	کزغال	-۲۵/۲۸		
وپترو	۴۳/۷۱	خراسان	۳۰/۷۴	هجرت	۱۷/۵۶	زملارد	۳/۲۰	وپخش	-۱۴/۰۴	لخانه	-۲۷/۳۰		



بخش دهم:

اهم اقدامات انجام شده و

برنامه‌های آتی صندوق

برنامه‌های آتی صندوق

✓ بهبود عملکرد و بهینه‌سازی ایفای تعهدات فعلی بازارگردانی

✓ تکمیل و بهبود سامانه زیرک

✓ افزایش تعداد نمادهای موضوعی بازارگردانی

✓ انجام بازارگردانی صندوق‌های کالایی