

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون

سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

۱. کلیات

۱-۱. تاریخچه فعالیت

صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون، صندوقی با سرمایه باز در اندازه کوچک محسوب می‌شود، که در تاریخ ۱۳۹۱/۰۲/۱۹ تحت شماره ۱۱۰۵۵ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۱/۰۲/۲۰ تحت شماره ۲۹۱۸۸ نزد اداره ثبت شرکتها به ثبت رسیده است. هدف از تشکیل این صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌های مالی و مدیریت این سبد است. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. برای نیل به این هدف، صندوق در زمینه‌های زیر سرمایه‌گذاری می‌نماید:

- سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار فرابورس؛
- حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران و بازار اول فرابورس
- اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهاداری که تمامی شرایط زیر را داشته باشد:
- الف - مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد؛
- ب- سود حداقلی برای آنها تضمین و مشخص شده باشد؛
- ج- به تشخیص مدیر، یکی از موسسات معتبر بازخرید آنها را قبل از سررسید تعهد کرده باشد یا امکان تبدیل کردن آنها به نقد در بازار ثانویه مطمئن وجود داشته باشد.
- گواهی‌های سپرده منتشر شده توسط بانکها یا موسسات اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.
- هرنوع سپرده گذاری نزد بانکها و موسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

مدت فعالیت صندوق به موجب ماده (۵) اساسنامه، ۲ سال بوده که به استناد مجمع مورخ ۱۳۹۳/۰۱/۲۴ و تایید سازمان بورس اوراق بهادار به مدت سه سال دیگر تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۲/۱۹ تمدید شده است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای اسفند ماه هر سال تا انتهای بهمن ماه سال بعد است، به جز اولین سال مالی صندوق که از تاریخ شروع دوره فعالیت صندوق آغاز شده و تا پایان بهمن ماه همان سال خاتمه می‌یابد. مرکز اصلی صندوق در تهران شهرک غرب، بلوار دادمان، خیابان فخار مقدم، نبش بوستان دوم غربی، پلاک ۲۲ طبقه ۳ واقع شده و صندوق دارای شعبه نمی‌باشد.

۱-۲. اطلاع‌رسانی

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون مطابق با ماده ۵۳ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.ttbfund.com درج گردیده است.

۲. ارکان صندوق سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون که از این به بعد صندوق نامیده می‌شود از ارکان زیر تشکیل شده است:

مجمع صندوق، از اجتماع دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تشکیل می‌شود. دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرطی که حداقل ۵ درصد از کل واحدهای ممتاز را در اختیار داشته باشند، از حق رأی در مجمع برخوردارند. در تاریخ گزارش دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتازی که دارای حق رای بوده‌اند شامل اشخاص ذیل است:

نام دارندگان واحدهای ممتاز	تعداد واحدهای ممتاز تحت تملک	درصد واحدهای تحت تملک
بانک توسعه تعاون	۸۰۰	۸۰
شرکت کارگزاری بانک رفاه کارگران	۲۰۰	۲۰
جمع	۱۰۰۰	۱۰۰

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

مدیر صندوق، شرکت کارگزاری بانک رفاه است که در تاریخ ۱۳۷۳/۰۱/۰۶ با شماره ثبت ۱۰۳۸۴۳ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از تهران شهرک غرب، بلوار دادمان، خیابان فخار مقدم، نبش بوستان دوم غربی، پلاک ۲۲ طبقه ۳.

متولی صندوق، شرکت مشاور سرمایه‌گذاری آرمان آتی است که در تاریخ ۱۳۸۹/۱۲/۰۴ با شماره ثبت ۳۹۷۶۳۲ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران - خیابان ولیعصر - بالاتر از بلوار میرداماد - خیابان قبادیان - پلاک ۳۳ - طبقه همکف .
ضامن صندوق، بانک توسعه تعاون است که در تاریخ ۱۳۸۸/۰۵/۰۲ با شماره ثبت ۳۵۵۳۸۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی ضامن عبارتست از تهران - خیابان ولیعصر - خیابان بزرگمهر - نبش خیابان برادران مظفر - پلاک ۱۶.

حسابرس صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت دایارهیافت است که در تاریخ ۱۳۹۴/۰۵/۱۰ با شماره ثبت ۳۶۵۳۰ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران - سه‌رودی جنوبی - خیابان برادران شهید نوبخت - پلاک ۲۹ واحد ۱ و ۲.

۳. واحدهای سرمایه‌گذاری

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو دسته واحدهای سرمایه‌گذاری عادی و واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز تقسیم می‌شود. واحد سرمایه‌گذاری عادی، فاقد حق رأی بوده و قابل ابطال اما غیرقابل انتقال است. واحد سرمایه‌گذاری ممتاز دارای حق رأی در مجمع بوده قابل انتقال اما غیرقابل ابطال می‌باشد. تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ تعداد ۱۵،۲۵۸ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۴،۲۵۸ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

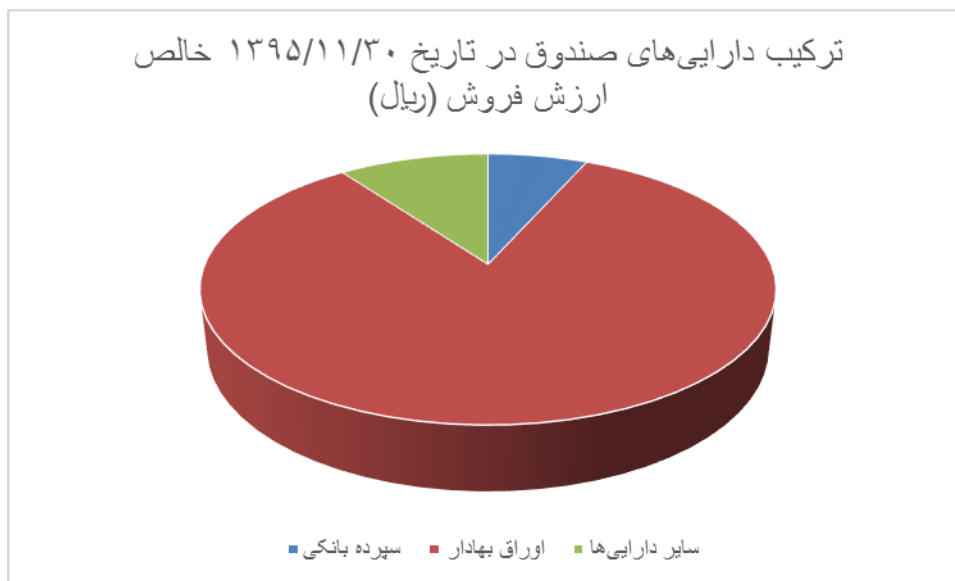
۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

۴-۱. ترکیب دارایی‌های صندوق:

جدول و نمودار زیر، ترکیب سرمایه‌گذاری‌های صندوق در پایان سال مالی مورد گزارش را نشان می‌دهد. صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون براساس ماده ... اساسنامه و نصاب‌های موجود در امیدنامه و به منظور مدیریت مناسب ریسک و کسب بیشترین بازده به نسبت به سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار بادرآمد ثابت اقدام نموده است:

ترکیب دارایی‌های صندوق در تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰	
عنوان	خالص ارزش فروش (ریال)
سپرده بانکی	۲،۹۰۵،۶۰۸،۱۳۴
اوراق بهادار	۳۶،۲۵۱،۶۴۰،۳۱۸
سایر دارایی‌ها	۴،۳۸۳،۰۴۷،۲۰۱

۴-۲. ترکیب دارایی‌های صندوق به تفکیک نوع دارایی:



درصد خالص ارزش فروش به کل دارایی‌ها	سود (زیان) فروش	سود(زیان) ناشی از فروش اوراق مشارکت
۰.۱۱٪	۴۸,۳۱۸,۷۸۱	اجاره رایتل ۲- سه ماهه ۲۲ درصد
۰.۰۱٪	۵,۵۵۳,۲۶۷	اوراق اجاره شرکت مخابرات ایران
۰.۰۰٪	۱۱۰,۹۱۴	اوراق مرابحه بناگستر کرانه
۰.۱۶٪	۶۹,۵۲۸,۸۳۵	گواهی سپرده لیزینگ رایان سایپا
۰.۲۸٪	۱۲۳,۵۱۱,۷۹۷	جمع

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

۵. سود (زیان) فروش اوراق بهادار به شرح ذیل می باشد:

سود (زیان) حاصل از فروش سهام (ریال)	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
آسان پرداخت پرشین	۲۱,۹۸۲	۳۴۲,۹۸۵,۱۴۶	(۲۲۰,۸۶۶,۲۳۶)	(۱,۸۱۴,۳۹۰)	(۱,۷۱۴,۹۲۶)	۱۱۸,۵۸۹,۵۹۴
البرز دارو	۳۰,۲۲۲	۳۵۹,۶۹۴,۱۵۶	(۳۱۲,۴۹۳,۴۱۰)	(۱,۹۰۲,۷۸۲)	(۱,۷۹۸,۴۷۱)	۴۳,۴۹۹,۴۹۳
آهنگری تراکوسازی ایران	۳۳۶,۲۰۷	۷۹۱,۶۷۶,۰۷۰	(۶۶۳,۸۵۷,۴۹۹)	(۴,۱۸۷,۹۶۷)	(۳,۹۵۸,۳۸۰)	۱۱۹,۶۷۲,۲۲۴
ایران خودرو	۱,۴۰۰,۰۰۰	۴,۹۶۹,۰۵۰,۰۰۰	(۵,۲۰۲,۲۳۷,۶۹۹)	(۲۶,۲۸۶,۲۷۲)	(۲۴,۸۴۵,۲۵۲)	(۲۸۴,۳۱۹,۲۲۳)
ایران خودرو بیزل	۶۰۰,۰۰۰	۷۲۴,۹۷۸,۰۰۰	(۷۴۴,۲۹۹,۸۰۴)	(۳,۸۳۵,۱۳۲)	(۳,۶۲۴,۸۹۰)	(۲۶,۷۸۱,۸۲۶)
ایران ارقام	۱۵۰,۰۰۰	۶۰۷,۰۴۴,۲۱۰	(۷۱۲,۸۸۰,۴۸۱)	(۳,۲۱۱,۲۵۹)	(۳,۰۳۵,۲۲۳)	(۱۱۲,۰۸۲,۷۵۳)
باما	۵۵۵,۰۰۰	۳,۲۲۱,۶۷۶,۴۰۱	(۲,۷۲۷,۸۴۴,۹۸۰)	(۱۷,۰۴۲,۶۷۴)	(۱۶,۰۱۸,۳۸۰)	۴۶۰,۶۸۰,۳۶۷
بانک انصار	۴۵۰,۰۰۰	۱,۱۳۴,۹۹۴,۸۴۱	(۱,۱۱۶,۵۷۱,۹۱۴)	(۶,۰۰۴,۱۱۹)	(۵,۶۷۴,۹۷۲)	۶,۷۴۴,۸۳۶
بانک ملت	۱,۴۲۴,۷۹۵	۲,۰۸۵,۹۰۷,۹۱۳	(۲,۷۸۰,۳۷۴,۷۹۳)	(۱۱,۰۳۴,۴۴۷)	(۱۰,۴۲۹,۵۳۷)	(۷۱۵,۹۳۰,۸۶۴)
بهمن دیزل	۱۰,۷۰۰	۴۵,۱۰۹,۹۰۰	(۵۵,۷۹۳,۹۹۹)	(۲۳۰,۵۱۰)	(۲۲۵,۵۵۰)	(۱۱,۱۴۰,۱۵۹)
پالایش نفت بندرعباس	۵۰,۰۰۰	۲۳۴,۹۱۱,۴۸۱	(۲۶۵,۷۸۴,۵۰۸)	(۱,۲۴۲,۶۸۶)	(۱,۱۷۴,۵۵۸)	(۳۳,۲۹۰,۲۷۱)
پالایش نفت تبریز	۱۰۰,۰۰۰	۵۰۳,۲۵۰,۰۰۰	(۵۲۳,۵۸۲,۳۰۳)	(۲,۶۶۲,۱۸۹)	(۲,۵۱۶,۲۵۰)	(۲۵,۵۱۰,۷۴۲)
پتروشیمی فجر	۱۶۰,۰۰۰	۹۳۸,۱۸۰,۰۰۰	(۸۵۶,۱۱۶,۵۷۸)	(۴,۹۶۲,۹۷۱)	(۴,۶۹۰,۹۰۱)	۷۲,۴۰۹,۵۵۰
تجارت الکترونیک پارسبان	۲۰۰,۰۰۰	۹۴۹,۴۵۱,۰۹۳	(۱,۰۲۷,۷۴۶,۹۵۹)	(۵,۰۲۲,۵۹۷)	(۴,۷۴۷,۲۵۶)	(۸۸,۰۶۵,۷۱۹)
تراکوسازی ایران	۱۰۰,۰۰۰	۲۶۸,۰۲۹,۴۵۶	(۲۲۳,۴۷۶,۵۱۸)	(۱,۴۱۷,۸۷۳)	(۱,۳۴۰,۱۴۷)	۴۱,۷۹۴,۹۱۸
توسعه حمل و نقل ریلی پارسبان	۷۴,۸۰۱	۱,۲۷۰,۹۶۷,۰۰۰	(۱,۲۶۹,۹۵۳,۶۶۰)	(۶,۴۹۴,۶۴۲)	(۶,۳۵۴,۸۳۵)	(۱۱,۸۳۶,۱۳۷)
توسعه معادن و فلزات	۲۳۰,۰۵۶	۳۳۶,۳۹۹,۸۸۶	(۶۵,۷۰۰,۲۸۳)	(۱,۷۷۹,۵۵۱)	(۱,۶۸۲,۰۰۰)	۲۶۷,۲۳۸,۰۵۲
تولید برق عسلویه مینا	۱۵۳,۸۹۶	۱,۸۷۴,۸۷۰,۳۵۸	(۲,۱۹۰,۴۹۸,۴۶۲)	(۹,۵۸۰,۵۸۱)	(۹,۳۷۴,۳۵۱)	(۳۳۴,۵۸۳,۰۳۶)
تولید برق ماهتاب کهنوج	۸۹,۰۰۰	۸۴۱,۵۳۲,۰۰۰	(۸۳۱,۶۲۳,۲۹۸)	(۴,۳۰۰,۲۲۸)	(۴,۰۷۶,۶۶۰)	۱,۴۰۰,۸۱۴
داروسازی اسوه	۲۸,۴۱۰	۶۴۴,۱۹۶,۷۵۰	(۵۹۶,۲۹۵,۵۵۱)	(۳,۴۰۷,۸۰۰)	(۳,۲۲۰,۹۸۵)	۴۱,۲۷۲,۴۱۴
داروسازی سینا	۴۰,۰۰۰	۱,۱۱۱,۹۲۰,۲۴۵	(۱,۰۴۴,۵۵۱,۹۷۶)	(۵,۸۸۲,۰۵۹)	(۵,۵۵۹,۶۰۱)	۵۵,۹۲۶,۶۰۹
ذغال سنگ نگین طیس	۲,۴۷۲,۸۰۰	۹,۲۸۶,۴۹۶,۵۲۱	(۹,۵۸۲,۶۴۲,۴۹۳)	(۴۹,۱۲۵,۵۵۱)	(۴۶,۴۳۲,۴۸۱)	(۳۹۱,۷۰۴,۰۰۴)
رادیاتور ایران	۱۲۵,۸۰۹	۳۹۰,۴۸۸,۶۶۴	(۴۶۸,۹۳۳,۲۴۹)	(۲,۰۶۵,۶۸۳)	(۱,۹۵۲,۴۴۳)	(۸۲,۴۶۲,۷۱۱)
ریل پرداز سیر	۴۲۳,۰۰۰	۵۱۰,۵۱۴,۶۴۵	(۴۶۳,۲۵۵,۴۷۱)	(۲,۶۰۸,۷۲۸)	(۲,۵۵۲,۵۷۳)	۴۲,۰۹۷,۸۷۳
رینگ‌سازی مشهد	۴۰۰,۰۰۰	۵۰۳,۱۵۰,۰۰۰	(۴۹۷,۸۰۳,۶۲۵)	(۲,۶۶۱,۶۶۳)	(۲,۵۱۵,۷۵۰)	۱۶۸,۹۶۲
سایپا	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۱۸۰,۸۰۲,۵۰۰	(۱,۳۹۴,۴۰۲,۹۴۸)	(۶,۲۴۶,۴۵۳)	(۵,۹۰۴,۰۱۳)	(۲۲۵,۷۵۰,۹۱۴)
سرمایه گذاری آتیه دماوند	۵۰۰,۰۰۰	۱,۵۰۳,۶۵۰,۰۰۰	(۱,۴۲۱,۳۳۰,۵۴۳)	(۷,۹۵۴,۳۰۸)	(۷,۵۱۸,۲۵۰)	۶۶,۸۴۶,۸۹۹
سرمایه گذاری البرز (هلدینگ)	۳۶۳,۱۳۱	۱,۵۵۱,۴۹۸,۰۸۲	(۱,۷۴۸,۸۷۸,۷۰۱)	(۸,۲۰۷,۴۲۱)	(۷,۷۵۷,۴۸۸)	(۲۱۳,۳۴۵,۵۲۸)
سرمایه گذاری توسعه گوهران امید	۲۴۰,۰۰۰	۲۶۲,۸۰۰,۰۰۰	(۲۶۰,۴۲۸,۶۰۸)	(۱,۳۴۲,۹۲۰)	(۱,۳۱۴,۰۰۰)	(۲۸۵,۵۲۸)
سرمایه گذاری خوارزمی	۳,۰۰۰,۰۰۰	۴,۴۶۳,۴۰۰,۰۰۰	(۳,۹۰۴,۴۰۵,۹۴۹)	(۲۳,۶۱۱,۳۸۱)	(۲۲,۳۱۶,۹۹۹)	۵۱۳,۰۶۵,۶۷۱
سرمایه گذاری دارویی تامین	۲۲۴,۰۰۰	۱,۳۶۳,۵۴۵,۸۱۱	(۱,۵۰۹,۵۹۸,۲۶۴)	(۷,۲۱۳,۱۵۵)	(۶,۸۱۷,۷۲۹)	(۱۶۰,۰۸۳,۳۳۷)
سرمایه گذاری گروه توسعه ملی	۱,۹۷۷,۴۹۵	۴,۲۸۳,۵۷۶,۳۶۳	(۴,۶۳۰,۶۸۳,۵۴۴)	(۲۲,۶۶۰,۱۱۲)	(۲۱,۴۱۷,۸۸۲)	(۳۹۱,۱۸۵,۱۷۵)
سرمایه گذاری مسکن الوند	۷۳,۰۰۰	۲۰۴,۸۳۸,۰۰۰	(۱۶۱,۳۶۱,۲۴۴)	(۱,۰۴۶,۷۲۳)	(۱,۰۲۴,۱۹۰)	۴۱,۴۰۵,۸۴۳
سرمایه گذاری مسکن تهران	۴۰۰,۰۰۴	۷۶۴,۸۰۷,۶۴۸	(۶۵۰,۱۶۶,۲۵۳)	(۳,۹۰۸,۱۶۹)	(۳,۸۲۴,۰۳۸)	۱۰۶,۹۰۹,۱۸۸
سرمایه گذاری توکافولا (هلدینگ)	۹۰۰,۰۰۰	۱,۵۴۶,۰۰۶,۰۰۰	(۱,۳۹۱,۱۴۷,۷۷۹)	(۸,۱۷۸,۳۷۷)	(۷,۷۳۰,۰۲۹)	۱۳۸,۹۴۹,۸۱۵
سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)	۸۳۹,۷۰۶	۱,۷۵۱,۴۷۲,۰۳۰	(۲,۰۸۸,۴۶۷,۴۱۳)	(۹,۲۶۵,۲۹۷)	(۸,۷۵۷,۳۶۳)	(۳۵۵,۰۱۸,۰۴۳)
شرکت ارتباطات سیار ایران	۸۰,۰۰۰	۲,۶۴۰,۰۴۴,۸۰۳	(۲,۸۳۶,۴۲۹,۶۸۲)	(۱۳,۹۶۵,۸۳۳)	(۱۳,۲۰۰,۲۲۳)	(۲۲۳,۵۵۰,۹۳۵)
شرکت آهن و فولاد ارفع	۴۰۰,۰۰۰	۱,۵۶۹,۷۰۸,۳۱۶	(۱,۰۰۳,۷۹۶,۵۲۳)	(۸,۰۲۱,۲۰۶)	(۷,۸۴۸,۵۴۱)	۵۵۰,۰۴۲,۰۴۶

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

سود (زیان) حاصل از فروش سهام (ریال)	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
شرکت پتروشیمی خراسان	۱۳۰,۰۰۰	۷۰۴,۹۵۴,۲۶۶	(۸۹۹,۸۴۵,۱۶۹)	(۳,۶۰۲,۳۱۹)	(۳,۵۲۴,۷۷۲)	(۲۰۲,۰۱۷,۹۹۴)
شیشه همدان	۵۰,۰۰۰	۴۳۷,۸۲۷,۶۰۰	(۴۷۱,۹۳۲,۴۹۶)	(۲,۳۱۶,۱۰۶)	(۲,۱۸۹,۱۳۸)	(۳۸,۶۱۰,۱۴۰)
صنایع بهداشتی سائنا	۳۵۳,۰۴۲	۱,۳۴۸,۷۶۳,۰۸۹	(۱,۳۷۴,۶۸۵,۵۹۴)	(۶,۸۹۲,۱۷۵)	(۶,۷۴۳,۸۱۷)	(۳۹,۵۵۸,۴۹۷)
صنعتی بهشهر	۸۷,۹۷۶	۲۱۴,۹۲۳,۱۲۰	(۲۴۷,۰۷۲,۱۶۸)	(۱,۱۳۶,۹۴۶)	(۱,۰۷۴,۶۱۶)	(۳۴,۳۶۰,۶۱۰)
فولاد خوزستان	۱۴۰,۰۰۰	۴۸۸,۴۶۴,۲۳۳	(۴۷۵,۵۷۲,۳۷۰)	(۲,۵۸۳,۹۷۱)	(۲,۴۴۲,۳۲۱)	۷,۸۶۵,۵۷۱
کارت اعتباری ایران کیش	۲۱۰,۰۰۰	۹۱۹,۰۵۰,۰۰۰	(۷۸۶,۷۵۳,۱۲۶)	(۴,۸۶۱,۷۷۵)	(۴,۵۹۵,۲۵۰)	۱۲۲,۸۳۹,۸۴۹
کارتق ایران	۳۰۰,۰۰۰	۱,۰۵۶,۵۶۲,۰۰۰	(۸۱۷,۴۵۲,۲۷۰)	(۵,۵۸۹,۲۲۰)	(۵,۲۸۲,۸۱۰)	۲۲۸,۲۳۲,۷۰۰
کشت و صنعت پیاذر	۵,۸۷۳	۱۷,۱۱۳,۹۲۲	(۱۸,۷۰۷,۸۹۲)	(۹۰,۵۳۴)	(۸۵,۵۷۰)	(۱,۷۷۰,۰۷۴)
گروه دارویی سبحان	۴۹,۱۹۰	۳۷۰,۰۹۴,۲۲۵	(۳۸۰,۶۰۳,۷۸۹)	(۱,۹۵۷,۷۹۳)	(۱,۸۵۰,۴۷۱)	(۱۴,۳۱۷,۸۲۸)
گروه صنعتی بارز	۵۰,۰۰۰	۱۷۴,۴۱۵,۳۱۶	(۱۴۷,۸۴۰,۵۴۴)	(۹۲۲,۶۵۵)	(۸۷۲,۰۷۶)	۲۴,۷۸۰,۰۴۱
گروه مدیریت سرمایه گذاری امید	۵۰۰,۰۰۰	۷۵۶,۶۵۸,۱۶۵	(۱,۰۴۱,۰۳۴,۹۶۰)	(۴,۰۰۲,۷۲۱)	(۳,۷۸۳,۲۹۲)	(۲۹۲,۱۶۲,۸۰۸)
گروه بهمن	۹۵۷,۱۲۰	۲,۴۰۸,۵۳۹,۰۴۰	(۲,۷۷۰,۴۶۴,۶۸۷)	(۱۲,۷۴۱,۱۷۴)	(۱۲,۰۴۲,۶۹۶)	(۳۸۶,۷۰۹,۵۱۷)
گسترش سرمایه گذاری ایران خودرو	۵۰,۰۰۰	۱۹۸,۳۴۰,۰۰۰	(۱۸۴,۶۶۹,۱۳۹)	(۱,۰۴۹,۲۱۶)	(۹۹۱,۷۰۰)	۱۱,۶۲۹,۹۴۵
لینیات پاک	۱۲۳,۸۹۸	۲۴۹,۶۹۸,۲۴۸	(۳۲۱,۳۰۷,۱۶۰)	(۱,۳۲۰,۸۹۷)	(۱,۲۴۸,۴۹۱)	(۷۴,۱۷۸,۳۰۰)
لیزینگ رایان سایبا	۴۰۲,۳۲۲	۵۹۱,۷۶۸,۱۲۲	(۱,۱۱۵,۳۷۸,۲۹۵)	(۳,۱۳۰,۴۴۹)	(۲,۹۵۸,۸۴۲)	(۵۲۹,۶۹۹,۴۶۴)
مخابرات ایران	۸۵۰,۰۰۰	۱,۹۱۲,۵۸۵,۱۱۹	(۲,۰۶۵,۹۳۲,۹۹۱)	(۱۰,۱۱۷,۵۷۲)	(۹,۵۶۲,۹۲۶)	(۱۷۳,۰۲۸,۳۷۰)
معدنی و صنعتی گل گهر	۵۶۲,۵۰۰	۱,۳۶۹,۳۸۷,۵۰۰	(۱,۱۸۱,۷۳۲,۶۰۹)	(۷,۲۴۴,۰۵۸)	(۶,۸۴۶,۹۳۷)	۱۷۳,۵۶۳,۸۹۶
ملی سرب و روی ایران	۱۰۰,۰۰۰	۳۰۲,۵۰۵,۲۳۶	(۳۱۴,۴۶۳,۱۷۵)	(۱,۶۰۰,۲۵۴)	(۱,۵۱۲,۵۲۶)	(۱۵۰,۷۰۰,۷۱۹)
واسپاری ملت	۱۶,۴۷۷	۲۱,۱۸۰,۵۶۳	(۱۷,۵۵۰,۵۰۳)	(۱۱۲,۰۴۴)	(۱۰۵,۹۰۳)	۳,۴۱۲,۱۱۳
تعدیلات ناشی از فروش اوراق بهادار	-	-	-	-	-	(۴,۶۵۱,۱۹۷)
جمع	۲۴,۵۶۲,۴۱۲	۷۰,۵۷۶,۴۵۴,۰۵۳	(۷۲,۰۷۹,۲۸۷,۱۳۷)	(۳۷۱,۶۵۷,۵۸۸)	(۳۵۲,۸۸۲,۲۷۱)	(۲,۲۳۲,۰۲۴,۱۴۰)

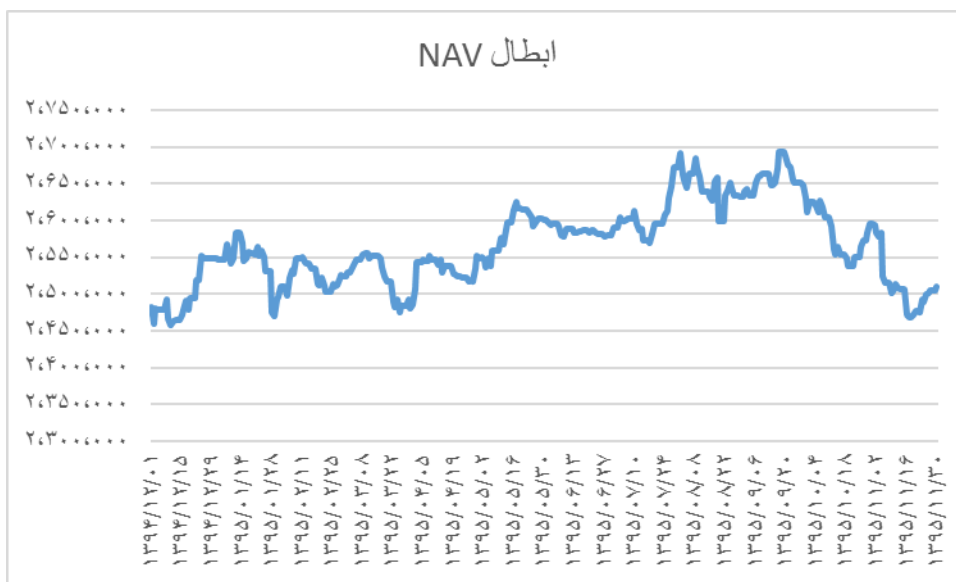
گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

۶. سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار به شرح ذیل می باشد:

شرکت	تعداد	ارزش بازار	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود(زیان) تحقق نیافته نگهداری
باما	۱۵۰,۰۰۰	۱,۱۱۹,۰۰۰,۰۰۰	(۱,۱۸۰,۶۵۹,۷۵۴)	(۵,۹۱۹,۵۱۰)	(۵,۵۹۵,۰۰۰)	(۷۳,۱۷۴,۲۶۴)
بهمن دیزل	۴۹,۳۰۰	۱۷۴,۹۶۵,۷۰۰	(۳۲۸,۸۷۸,۵۶۸)	(۸۹۴,۰۷۵)	(۸۷۴,۸۲۹)	(۵۵,۶۸۱,۷۷۱)
پالایش نفت اصفهان	۳۰۰,۰۰۰	۷۵۷,۲۰۰,۰۰۰	(۹۲۵,۴۷۶,۰۶۱)	(۴,۰۰۵,۵۸۸)	(۳,۷۸۶,۰۰۰)	(۱۷۶,۰۶۷,۶۴۹)
پالایش نفت بندرعباس	۱۵۰,۰۰۰	۷۳۶,۵۰۰,۰۰۰	(۷۹۷,۳۵۳,۵۳۹)	(۳,۸۹۶,۰۸۵)	(۳,۶۸۲,۵۰۰)	(۶۸,۴۳۲,۱۲۴)
پتروشیمی پردیس	۱۲۰,۰۰۰	۹۶۸,۲۸۰,۰۰۰	(۱,۰۳۲,۰۰۱,۲۶۹)	(۵,۱۲۲,۲۰۱)	(۴,۸۴۱,۴۰۰)	(۷۳,۶۸۴,۸۷۰)
پتروشیمی خارک	۱۲۱,۰۰۰	۱,۹۱۸,۵۷۶,۰۰۰	(۱,۷۴۲,۸۹۹,۵۲۷)	(۱۰,۱۴۹,۲۶۷)	(۹,۵۹۲,۸۸۰)	۱۵۵,۹۳۴,۳۲۶
پتروشیمی زاگرس	۷۰,۰۰۰	۱,۳۳۷,۱۴۰,۰۰۰	(۱,۰۹۴,۳۷۹,۳۰۶)	(۶,۸۳۲,۷۸۵)	(۶,۶۸۵,۷۰۰)	۲۲۹,۲۴۴,۲۰۹
پتروشیمی شازند	۲۵۰,۰۰۰	۸۰۰,۰۰۰,۰۰۰	(۷۸۷,۸۱۰,۲۳۸)	(۴,۲۳۲,۰۰۰)	(۴,۰۰۰,۰۰۰)	۳,۹۵۷,۷۶۲
پتروشیمی فجر	۲۴,۳۸۲	۱۴۷,۰۴۷,۸۴۲	(۱۳۱,۳۶۱,۹۲۴)	(۷۷۷,۸۸۳)	(۷۳۵,۲۳۹)	۱۴,۱۷۲,۷۹۶
پتروشیمی فناوریان	۵۱,۰۸۰	۱,۰۹۹,۰۸۸,۳۶۰	(۸۷۷,۷۲۲,۱۷۷)	(۵,۸۱۴,۱۷۷)	(۵,۴۹۵,۴۴۲)	۲۱۰,۰۵۶,۵۶۴
توسعه معادن وفلات	۱,۰۰۰,۰۰۰	۱,۴۳۱,۰۰۰,۰۰۰	(۱,۵۴۹,۶۶۸,۳۲۹)	(۷,۵۶۹,۹۹۰)	(۷,۱۵۵,۰۰۰)	(۱۳۳,۳۹۳,۳۱۹)
داروسازی کاسین تامین	۵۱,۰۰۰	۸۷۸,۹۳۴,۰۰۰	(۱,۰۶۱,۵۸۷,۰۲۱)	(۴,۴۹۱,۳۵۳)	(۴,۳۹۴,۶۷۰)	(۱۹۱,۵۲۹,۰۴۴)
سرمایه گذاری دارویی تامین	۴۱۰,۰۰۰	۲,۳۴۵,۲۹۰,۰۰۰	(۲,۷۰۳,۲۸۶,۴۹۶)	(۱۲,۵۱۲,۳۸۴)	(۱۱,۸۴۲,۴۵۰)	(۳۶۲,۳۳۵,۳۳۰)
سرمایه گذاری ملی ایران	۵۳۴,۱۷۷	۸۲۲,۰۹۸,۴۰۳	(۹۶۰,۹۱۸,۶۴۲)	(۴,۳۴۸,۹۰۱)	(۴,۱۱۰,۴۹۲)	(۱۴۷,۲۷۹,۶۳۲)
سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی	۷۹۰,۰۰۰	۱,۱۴۴,۷۱۰,۰۰۰	(۱,۲۹۳,۹۵۸,۲۲۲)	(۶,۰۵۵,۵۱۶)	(۵,۷۲۳,۵۵۰)	(۱۶۱,۰۲۷,۲۸۸)
سرمایه گذاری غدیر(هلدینگ)	۴۷۱,۸۲۳	۶۰۸,۶۵۱,۶۷۰	(۶۵۹,۶۸۷,۳۱۳)	(۳,۲۱۹,۷۶۷)	(۳,۰۴۳,۲۵۸)	(۵۷,۲۹۸,۶۶۹)
صنایع پتروشیمی خلیج فارس	۱۶۵,۰۰۰	۷۰۸,۳۴۵,۰۰۰	(۷۵۵,۴۵۳,۲۶۱)	(۳,۷۴۷,۱۴۵)	(۳,۵۴۱,۷۲۵)	(۵۴,۲۹۷,۱۳۱)
صنایع خاک چینی ایران	۴۰,۰۰۰	۴۴۰,۵۲۰,۰۰۰	(۴۹۴,۳۷۱,۰۲۴)	۲,۳۳۰,۳۵۱	(۲,۲۰۲,۶۰۰)	(۵۳,۷۲۳,۲۷۳)
صنعتی بهشهر	۱	۲,۵۶۸	(۲,۸۱۰)	(۱۴)	(۱۳)	(۲۶۸)
فولاد خوزستان	۲۲۸,۵۸۵	۷۹۴,۱۰۴,۲۹۰	(۷۷۶,۴۹۰,۷۸۴)	(۴,۲۰۰,۸۱۲)	(۳,۹۷۰,۵۲۱)	۹,۴۴۲,۱۷۳
فولاد مبارکه اصفهان	۱,۶۰۰,۰۰۰	۲,۲۷۰,۴۰۰,۰۰۰	(۲,۱۸۷,۹۱۳,۵۱۶)	(۱۲,۰۱۰,۴۱۶)	(۱۱,۳۵۲,۰۰۰)	۵۹,۱۲۴,۰۶۸
کارتن ایران	۱۵۵,۰۰۰	۵۳۰,۸۷۵,۰۰۰	(۵۴۸,۵۷۶,۰۸۰)	(۲,۸۰۸,۳۲۹)	(۲,۶۵۴,۳۷۵)	(۲۳,۱۶۳,۷۸۴)
کنتورسازی ایران	۱	۴۶,۵۶۷	(۴۶,۹۲۶)	(۲۴۶)	(۲۳۳)	(۸۳۸)
گروه دارویی سبحان	۹۰,۰۰۰	۵۱۰,۲۱۰,۰۰۰	(۵۳۲,۷۸۱,۷۱۵)	(۲,۶۹۹,۰۱۱)	(۲,۵۵۱,۰۵۰)	(۲۷,۸۲۱,۷۷۶)
گروه صنعتی بارز	۱۵۱,۲۲۵	۴۹۶,۹۲۵,۳۵۰	(۴۷۳,۲۸۹,۴۶۴)	(۲,۶۲۸,۷۳۵)	(۲,۴۸۴,۶۲۷)	۱۸,۵۲۲,۵۲۴
گروه بهمن	۱۵۰,۰۰۰	۲۶۴,۱۵۰,۰۰۰	(۴۰۴,۷۶۳,۸۹۲)	(۱,۳۹۹,۳۵۴)	(۱,۳۲۰,۷۵۰)	(۱۴۳,۳۳۱,۹۹۶)
گسترش نفت و گاز پارسیان	۵۳۰,۰۰۰	۹۰۴,۱۸۰,۰۰۰	(۱,۱۶۱,۳۳۹,۳۶۶)	(۴,۷۸۳,۱۱۲)	(۴,۵۲۰,۹۰۰)	(۳۶۶,۴۶۳,۳۷۸)
لیزینگ رایان سایا	۱۴۷,۶۷۸	۲۱۵,۷۵۷,۵۵۸	(۲۶۱,۶۷۳,۶۸۴)	(۱,۱۴۱,۳۵۷)	(۱,۰۷۸,۷۸۸)	(۴۸,۱۳۶,۲۷۱)
مخابرات ایران	۲۶۱,۷۴۸	۵۹۲,۸۵۹,۲۲۰	(۶۰۱,۷۹۰,۱۱۵)	(۳,۱۳۶,۲۲۵)	(۲,۹۶۴,۲۹۶)	(۱۵,۰۳۱,۴۱۶)
معدنی و صنعتی گل گهر	۶۱۰,۰۰۰	۱,۴۹۷,۵۵۰,۰۰۰	(۱,۲۸۱,۵۲۳,۳۶۳)	(۷,۹۲۲,۰۴۰)	(۷,۴۸۷,۷۵۰)	۲۰۰,۶۱۶,۸۴۸
ملی سرب و روی ایران	۴۵۰,۰۰۰	۱,۳۹۱,۴۰۰,۰۰۰	(۱,۴۱۵,۰۸۴,۲۹۶)	(۷,۳۶۰,۵۰۶)	(۶,۹۵۷,۰۰۰)	(۳۸,۰۰۱,۸۰۲)
ملی صنایع مس ایران	۱,۰۰۰,۰۰۰	۲,۱۲۰,۰۰۰,۰۰۰	(۱,۵۹۷,۶۲۶,۹۱۶)	(۱,۲۱۴,۸۰۰)	(۱,۰۶۰,۰۰۰)	۵۰۰,۵۵۸,۲۸۴
بانک صادرات ایران	۱,۸۰۰,۰۰۰	۱,۸۰۹,۰۰۰,۰۰۰	(۳,۰۳۶,۲۲۹,۳۵۴)	(۹,۵۶۹,۶۱۰)	(۹,۰۴۵,۰۰۰)	(۳۴۵,۸۴۳,۹۶۴)
داروسازی جابر ابن حیان	۹۵,۸۸۸	۱,۲۰۲,۲۴۳,۷۴۴	(۱,۱۲۲,۳۰۲,۹۲۱)	(۶,۳۵۹,۸۶۹)	(۶,۰۱۱,۲۱۹)	۶۷,۵۶۹,۳۳۵
پتروشیمی جم	۱۰۰,۰۰۰	۹۵۹,۱۰۰,۰۰۰	(۱,۰۱۹,۹۹۵,۱۲۶)	(۵,۰۷۳,۶۳۹)	(۴,۷۹۵,۵۰۰)	(۷۰,۷۶۴,۲۶۵)
پتروشیمی مبین	۸۴۹,۰۰۰	۳,۲۰۰,۹۱۲,۰۰۰	(۳,۱۲۶,۶۲۱,۵۶۲)	(۱۷,۴۶۱,۸۲۴)	(۱۶,۵۰۴,۵۶۰)	۱۴۰,۳۳۴,۰۵۴
ح. لیزینگ رایان سایا	۴۸۵,۸۳۳	۱۷۴,۸۹۹,۸۸۰	(۳۷۴,۰۹۱,۴۱۰)	(۹۲۵,۲۲۰)	(۸۷۴,۴۹۹)	(۲۰۰,۹۹۱,۲۵۰)
ح. گروه دارویی سبحان	۳۳,۲۵۶	۱۳۶,۱۵۰,۰۶۴	(۱۶۳,۵۸۶,۲۶۴)	(۷۲۰,۲۳۴)	(۶۸۰,۷۵۰)	(۲۸,۸۳۷,۱۸۴)
جمع	۱۳,۴۸۵,۹۷۷	۳۶,۶۲۸,۱۱۳,۲۱۶	(۳۷,۳۶۳,۱۰۲,۳۳۵)	(۱۸۸,۶۷۱,۶۳۰)	(۱۸۳,۱۴۰,۵۶۶)	(۱,۱۰۶,۸۰۱,۲۱۵)

۷. خالص ارزش دارایی‌های صندوق:

شاخص ارزیابی صندوق‌های سرمایه‌گذاری، خالص ارزش دارایی‌های صندوق (NAV) می‌باشد، همان‌گونه که در نمودار زیر مشاهده می‌گردد، خالص ارزش دارایی‌های صندوق تا پایان سال مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ مبلغ ۳۸،۴۳۳،۳۰۰،۸۹۶ ریال بوده است.



گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون سال مالی منتهی به ۱۳۹۵/۱۱/۳۰

۸. بازدهی صندوق:

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون از زمان ابتدا دوره ۱۳۹۴/۱۲/۰۱ تا پایان سال مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۵/۱۱/۳۰ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

شرح	مقدار در ۱۳۹۴/۱۲/۰۱	مقدار در ۱۳۹۵/۱۱/۳۰	درصد بازدهی
NAV صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون	۲,۴۸۲,۴۰۰	۲,۵۱۰,۱۷۶	۲,۰۵
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۷۷,۵۶۰	۷۷,۵۹۹	۲,۲۲

۹. استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق

استراتژی‌های سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون عبارت است از: خرید انواع اوراق بهادار در بورس و فرابورس، حق تقدم خرید سهام پذیرفته شده در بورس و فرابورس، اوراق مشارکت، اوراق صکوک و اوراق بهادار رهنی به منظور کاهش ریسک سرمایه‌گذاری می باشد.