

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون

دوره مالی سالیانه منتهی به ۱۳۹۶/۱۱/۳۰

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 ماه دیگر تا تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۱۹ 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

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 سرمایه گذاری 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 هدف همکاران است که در تاریخ ۱۳۹۰/۰۲/۱۹ با شماره ثبت ۲۷۴۴۲ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران - خیابان سئول - بالاتر از نیایش - خیابان دوم شرقی - شماره ۱ - طبقه دوم.

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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ تعداد ۲۹،۷۸۰ واحد بوده که این تعداد شامل ۲۸،۷۸۰ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

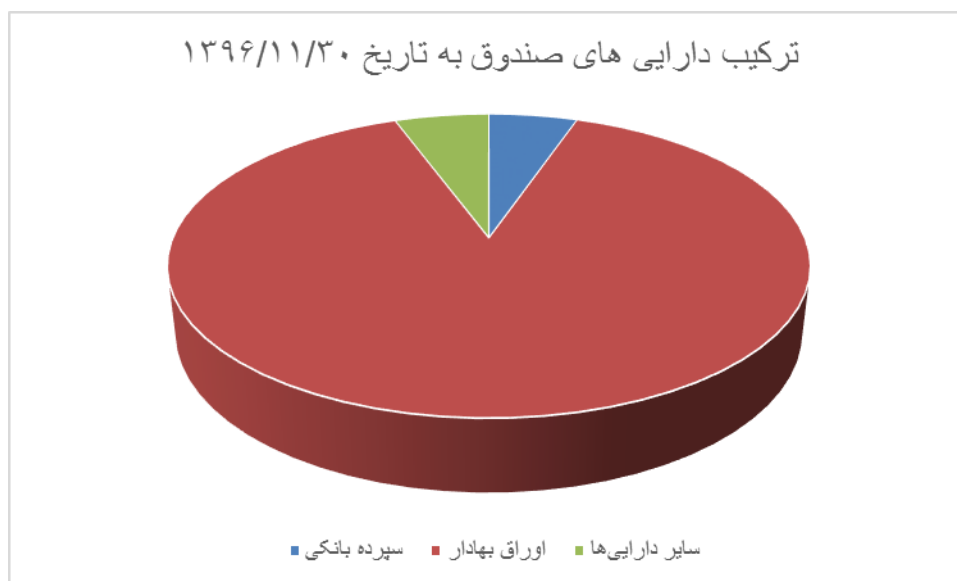
۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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 ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	
عنوان	خالص ارزش فروش (ریال)
سپرده بانکی	۵,۸۳۹,۷۹۶,۲۵۳
اوراق بهادار	۹۷,۹۱۹,۵۲۵,۹۱۰
سایر دارایی‌ها	۶,۲۱۸,۵۹۷,۳۹۶

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
۰.۰۰۸٪	۸,۰۰۸,۸۳۳	اوراق مشارکت گلگهر ۳ ماهه ۲۰٪
۰.۱۵٪	۱۴۸,۰۰۳,۰۵۵	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۶۱۳
۰.۲۲٪	۲۲۰,۴۶۸,۱۲۲	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۷۰۳
۰.۳۸٪	۳۷۶,۴۸۰,۰۱۰	جمع

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

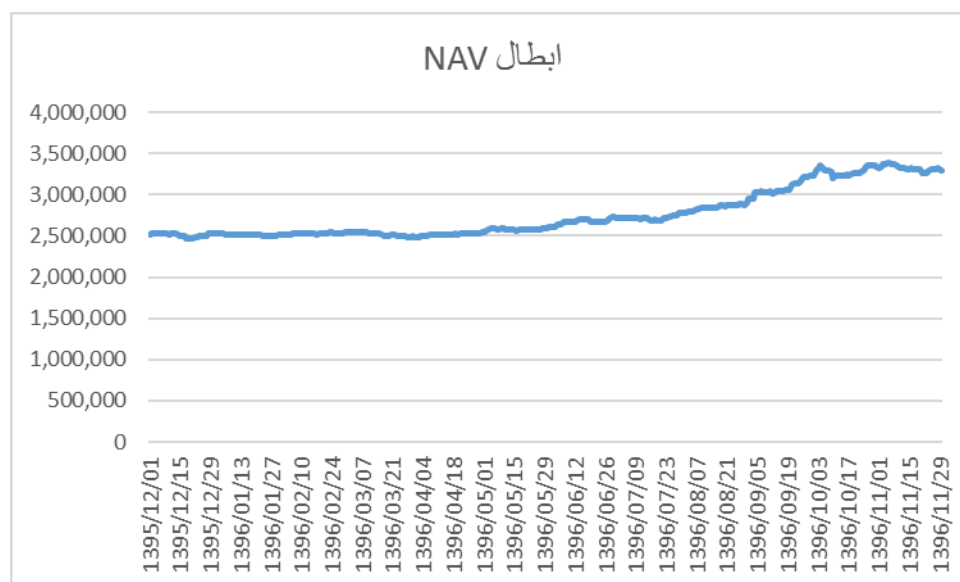
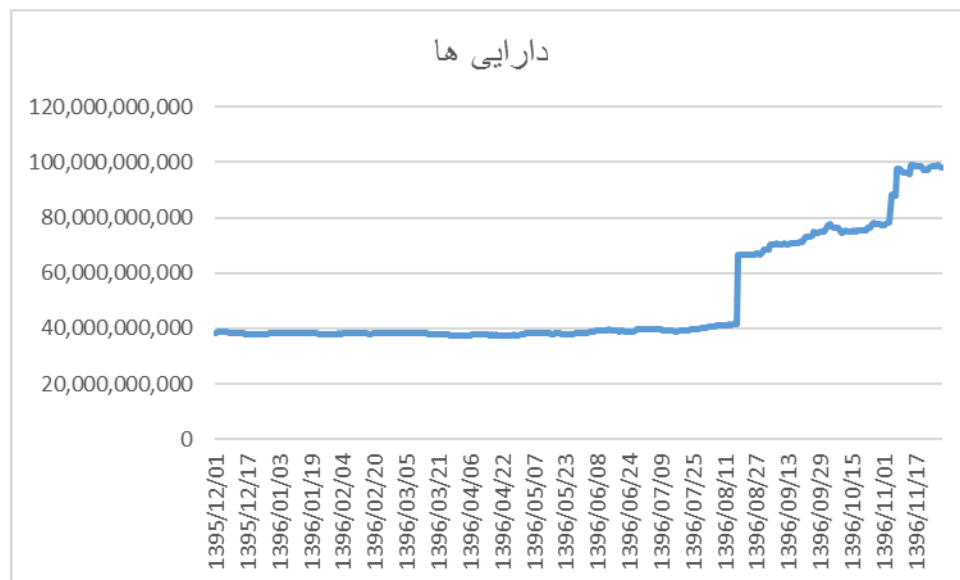
سود (زیان) حاصل از فروش سهام (ریال)	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
بهمن دیزل	۴۹,۳۰۰	۱۷۹,۹۴۵,۰۰۰	(۱۷۶,۸۳۵,۲۸۹)	(۹۱۹,۵۲۰)	(۸۹۹,۷۲۵)	۴,۹۲۸,۹۵۶
پارس خودرو	۲۰۰,۰۰۰	۱۶۶,۶۲۱,۳۷۴	(۲۳۱,۵۰۴,۷۰۶)	(۷۹۱,۴۵۰)	(۸۳۳,۱۰۷)	(۵۳,۲۵۸,۸۷۵)
پاکسان	۸۰,۰۰۰	۵۴۱,۳۳۴,۴۶۸	(۴۶۸,۹۱۴,۸۲۵)	(۲,۸۶۳,۶۰۷)	(۲,۷۰۶,۶۲۲)	۷۷,۹۰۹,۸۷۲
پالایش نفت بندرعباس	۶۰,۰۰۰	۳۲۹,۱۶۶,۵۱۹	(۲۹۸,۳۴۲,۸۱۷)	(۱,۷۴۱,۲۹۱)	(۱,۶۴۵,۸۳۳)	۳۴,۲۱۰,۸۲۶
پتروشیمی جم	۵۶,۸۰۷	۴۸۵,۱۱۸,۲۰۰	(۵۴۸,۷۳۱,۱۸۵)	(۲,۳۲۵,۲۱۴)	(۲,۴۲۵,۵۹۱)	(۵۸,۸۶۲,۱۸۰)
پتروشیمی زاگرس	۷۰,۰۰۰	۱,۲۴۲,۷۹۰,۰۰۰	(۱,۳۴۸,۹۵۰,۷۰۴)	(۶,۳۵۰,۶۵۳)	(۶,۲۱۳,۹۵۰)	(۹۳,۳۹۶,۱۰۱)
پتروشیمی شازند	۴۹۰,۰۰۰	۱,۲۶۵,۹۳۶,۰۵۸	(۱,۳۳۷,۲۱۴,۷۰۵)	(۶,۴۲۵,۸۴۷)	(۶,۳۹۶,۶۷۲)	(۴۸,۵۲۳,۱۲۸)
پتروشیمی فجر	۲۴,۳۸۲	۱۴۶,۶۸۲,۰۰۱	(۱۴۸,۵۵۳,۴۳۱)	(۷۷۵,۹۴۶)	(۷۳۳,۴۱۰)	(۳۶۲,۰۷۴)
پتروشیمی فناوران	۲۱,۰۸۱	۴۴۰,۵۷۰,۵۷۶	(۴۵۷,۹۹۹,۲۶۶)	(۲,۳۳۰,۶۱۷)	(۲,۲۰۲,۸۵۳)	(۱۲,۸۹۵,۲۲۰)
توسعه معادن و فلزات	۷۰۰,۰۰۰	۸۹۹,۶۰۶,۰۰۰	(۱,۰۰۹,۹۰۶,۴۰۳)	(۴,۷۵۸,۹۱۸)	(۴,۴۹۸,۰۳۰)	(۱۰۱,۰۴۳,۴۵۵)
تولیدی کاشی تکسرام	۶۰,۰۰۰	۱۴۴,۰۳۰,۵۴۶	(۱۳۷,۲۳۳,۵۴۵)	(۷۶۱,۹۲۱)	(۷۲۰,۱۵۳)	۸,۲۷۹,۰۷۵
داروسازی جابر ابن حیان	۵۹,۵۸۸	۴۱۱,۲۳۳,۵۰۰	(۵۳۴,۱۲۷,۱۳۷)	(۲,۰۱۹,۱۳۸)	(۲,۰۵۶,۱۶۷)	(۱۱۸,۸۱۸,۳۳۲)
داروسازی کاسپین تامین	۵,۱۰۰	۸۷,۷۷۹,۸۰۰	(۸۸,۷۷۹,۷۰۷)	(۴۴۸,۵۵۶)	(۴۳۸,۸۹۹)	(۱۱۲,۴۵۲)
سرمایه گذاری دارویی تامین	۱۸۵,۰۰۰	۹۹۷,۸۷۷,۱۵۹	(۱,۰۸۱,۱۲۶,۷۶۶)	(۴,۸۵۷,۸۱۱)	(۴,۹۸۹,۳۸۷)	(۷۳,۴۰۲,۳۳۹)
سرمایه گذاری ملی ایران	۵۳۴,۱۷۷	۷۵۳,۳۳۲,۵۷۰	(۸۲۸,۳۳۷,۰۵۱)	(۳,۵۷۷,۸۵۵)	(۳,۷۶۶,۱۶۳)	(۶۷,۷۵۰,۴۶۳)
شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان	۶۰,۰۰۰	۷۸۰,۷۴۸,۰۷۰	(۸۷۷,۳۴۹,۶۴۳)	(۳,۹۸۹,۶۲۱)	(۳,۹۰۳,۷۳۹)	(۸۸,۶۰۸,۲۱۳)
صنایع خاک چینی ایران	۴۰,۰۰۰	۵۶۱,۴۴۵,۰۰۰	(۴۴۷,۵۴۳,۶۴۸)	(۲,۹۷۰,۵۷۵)	(۲,۸۰۷,۷۲۵)	۱۱۹,۷۷۹,۶۵۲
صنعتی بهشهر	۱	۱	(۲,۵۴۱)			(۲,۵۴۰)
فولاد خوزستان	۲۲۸,۵۸۵	۷۶۲,۱۹۹,۶۲۵	(۸۰۱,۶۱۸,۹۵۹)	(۴,۰۳۲,۰۳۸)	(۳,۸۱۰,۹۹۸)	(۳۱,۵۷۶,۲۹۸)
کارتون ایران	۱۵۵,۰۰۰	۶۰۴,۴۴۵,۲۳۰	(۵۳۷,۸۵۳,۸۳۵)	(۳,۱۹۸,۰۴۲)	(۳,۰۲۲,۷۳۷)	۷۲,۹۱۲,۱۶۴
گروه دارویی سبحان	۱۲۳,۲۵۶	۵۶۵,۸۵۳,۶۴۷	(۷۱۲,۸۹۰,۲۷۳)	(۲,۷۱۴,۷۶۷)	(۲,۸۲۹,۲۶۹)	(۱۴۱,۴۹۲,۵۹۰)
گروه صنعتی بارز	۱۵۱,۲۲۵	۴۹۵,۶۴۵,۵۵۰	(۵۰۲,۰۱۲,۳۸۲)	(۲,۶۲۱,۹۶۷)	(۲,۴۷۸,۲۲۸)	(۱,۲۶۶,۶۳۷)
گروه مپنا	۱۲,۰۰۰	۹۹,۹۳۶,۰۰۰	(۹۹,۶۷۱,۵۶۳)	(۵۲۸,۶۶۰)	(۴۹۹,۶۸۰)	۱,۲۹۲,۷۷۷
لیزینگ ایرانیان	۱۰۰,۰۰۰	۱۴۳,۵۵۸,۳۷۹	(۲۰۳,۲۳۸,۰۰۷)	(۶۸۱,۹۰۰)	(۷۱۷,۷۹۳)	(۵۸,۲۷۹,۹۳۵)
لیزینگ رایان سایا	۴۵۰,۱۷۸	۶۸۱,۷۳۱,۵۸۴	(۷۶۲,۹۱۶,۷۲۷)	(۳,۵۶۸,۵۰۰)	(۳,۴۰۸,۶۵۷)	(۷۴,۲۰۷,۹۰۶)
مخابرات ایران	۱۰۰,۰۰۰	۱۹۱,۰۵۰,۷۴۴	(۲۲۸,۱۰۱,۱۲۹)	(۱,۰۱۰,۶۵۴)	(۹۵۵,۲۵۳)	(۲۵۰,۰۸۴,۴۷۸)
معذنی و صنعتی گل گهر	۳۱۰,۰۰۰	۷۳۹,۵۱۷,۵۴۴	(۷۶۸,۴۳۸,۰۴۷)	(۳,۹۱۲,۰۴۴)	(۳,۶۹۷,۵۸۸)	(۲۱,۳۱۰,۸۷۱)
گروه بهمن	۲۹۵,۸۵۷	۳۲۹,۳۳۹,۰۶۳	(۲۶۷,۸۵۳,۱۳۴)	(۱,۵۶۴,۳۶۱)	(۱,۶۴۶,۶۹۶)	۶۴,۶۹۶,۹۸۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۱۷۰,۰۰۰	۴۵۵,۶۰۳,۱۵۷	(۳۷۸,۳۳۲,۰۷۷)	(۲,۱۶۴,۱۱۷)	(۲,۳۷۸,۰۱۶)	۸۱,۷۲۳,۲۱۳
ملی صنایع مس ایران	۲۰۰,۰۰۰	۵۲۹,۵۳۰,۰۰۰	(۴۲۵,۷۲۸,۸۵۵)	(۲,۵۱۵,۲۶۵)	(۲,۶۴۷,۶۵۰)	۱۰۸,۹۶۴,۰۶۰
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳۵۰,۰۰۰	۱,۶۳۷,۵۰۰,۰۰۰	(۱,۲۲۴,۰۵۹,۴۹۹)	(۷,۷۳۰,۶۳۴)	(۸,۱۳۷,۵۰۰)	۴۱۹,۳۰۸,۶۲۵
سرمایه گذاری خوارزمی	۵۰۰,۰۰۰	۴۵۱,۰۸۵,۵۳۰	(۴۲۰,۹۵۱,۶۷۵)	(۲,۱۴۲,۶۵۶)	(۲,۲۵۵,۴۲۸)	۳۴,۵۳۱,۹۳۹
سرمایه گذاری مسکن الوند	۱۰۰,۰۰۰	۲۸۹,۰۰۰,۰۰۰	(۳۰۸,۱۶۹,۴۶۷)	(۱,۳۷۲,۷۵۲)	(۱,۴۴۵,۰۰۰)	(۱۶,۳۵۱,۷۱۵)
پاما	۳۰,۰۰۰	۲۷۰,۰۰۲,۲۲۰	(۲۲۹,۵۶۰,۲۰۷)	(۱,۲۸۲,۵۱۰)	(۱,۳۵۰,۰۱۱)	۴۳,۰۷۴,۵۳۴
جمع	۵,۹۷۱,۵۳۷	۱۷,۲۷۰,۳۰۵,۰۱۵	(۱۷,۸۷۲,۵۹۹,۲۰۵)	(۸۸,۹۴۹,۴۶۷)	(۸۸,۳۵۱,۵۲۰)	(۲۴,۹۹۳,۲۰۳)

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

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری	مالیات	کارمزد	ارزش دفتری	ارزش بازار	تعداد	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام و حق تقدم (ریال)
۲۰۷,۶۲۰,۳۹۴	(۱۲,۲۶۲,۹۵۲)	(۱۱,۶۴۹,۸۰۴)	(۲,۲۶۸,۸۱۲,۷۸۲)	۲,۴۵۲,۵۹۰,۴۲۰	۱,۰۸۵,۲۱۷	مخابرات ایران
۳۴,۶۱۷,۹۰۶	(۷,۱۲۸,۰۰۰)	(۶,۷۷۱,۶۰۰)	(۱,۴۰۴,۸۱۱,۶۹۴)	۱,۳۲۵,۶۰۰,۰۰۰	۴۵۰,۰۰۰	ملی سرب و روی ایران
(۵۲۶,۳۰۴,۳۸۱)	(۲۸,۳۷۶,۱۵۹)	(۲۶,۹۵۷,۳۵۱)	(۶,۲۵۶,۸۶۹,۶۰۶)	۵,۶۷۵,۲۳۱,۷۱۵	۸۰۴,۶۵۵	گروه مینا
۱۷۳,۳۹۴,۷۶۸	(۱۰,۱۳۲,۸۵۰)	(۹,۶۲۶,۲۰۸)	(۱,۸۷۲,۹۳۴,۲۹۰)	۲,۰۲۶,۵۷۰,۰۰۰	۱,۱۹۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بازنستگی کشوری
۳۶,۳۰۴,۸۱۲	(۳,۳۲۴,۹۱۰)	(۳,۰۶۳,۶۶۵)	(۶۱۴,۹۶۵,۷۹۴)	۶۴۴,۹۸۲,۰۴۱	۴۷۱,۸۱۳	سرمایه گذاری غدیر
(۵۵,۲۰۸,۲۹۳)	(۴,۹۳۴,۶۸۹)	(۴,۶۷۸,۴۵۴)	(۱,۰۴۹,۷۹۹,۱۹۶)	۹۸۴,۹۳۷,۷۶۰	۱,۱۸۶,۶۷۲	کمیابین سازی ایران
۲,۰۸۰,۴۲۶,۷۷۵	(۴۴,۰۶۴,۰۰۰)	(۴۱,۸۶۰,۸۰۰)	(۶,۸۱۸,۲۹۸,۰۲۵)	۸,۸۱۲,۸۰۰,۰۰۰	۳,۲۰۰,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
(۲,۹۱۹,۳۱۹)	(۲۰,۳۶۸,۱۳۸)	(۱۹,۳۴۹,۳۳۱)	(۴,۱۱۶,۲۶۴,۷۰۱)	۴,۰۷۳,۶۲۷,۶۱۳	۱,۵۴۹,۴۹۷	تراکتورسازی ایران
۱۴۸,۰۲۹,۱۳۴	(۳,۰۵۸,۴۳۳)	(۲,۹۰۵,۵۰۲)	(۴۶۹,۶۰۹,۳۵۳)	۶۱۱,۶۸۴,۵۶۲	۳۳۲,۷۹۹	توسعه معادن و فلزات
۱,۴۹۷,۶۷۹,۸۰۹	(۶۶,۷۸۹,۳۸۹)	(۶۳,۴۴۹,۹۲۰)	(۱۱,۹۹۰,۴۳۷,۳۴۱)	۱۳,۳۵۷,۸۷۷,۸۴۱	۲,۸۴۸,۷۶۹	پالایش نفت اصفهان
۶۱۸,۴۶۵,۳۷۸	(۱۲,۵۰۵,۵۰۰)	(۱۱,۸۸۰,۲۲۵)	(۱,۹۰۷,۰۲۰,۴۴۷)	۲,۵۰۱,۱۰۰,۰۰۰	۷۰۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر
۲۹۰,۷۸۹,۱۰۲	(۴,۶۹۳,۹۴۴)	(۴,۴۵۹,۲۴۶)	(۴۵۷,۱۵۲,۷۹۴)	۹۳۸,۷۸۸,۷۰۶	۲۹,۹۹۹	پتروشیمی فناوری
۱,۲۰۲,۵۱۲,۳۸۰	(۲۱,۱۷۲,۰۰۰)	(۲۰,۱۱۳,۴۰۰)	(۳,۰۷۳,۱۷۳,۰۲۰)	۴,۳۳۴,۴۰۰,۰۰۰	۴۰۰,۰۰۰	باما
۲,۸۵۶,۳۲۰,۹۲۰	(۳۴,۸۹۶,۰۰۰)	(۳۳,۱۵۱,۲۰۰)	(۴,۱۹۰,۹۲۶,۲۸۰)	۶,۹۷۹,۲۰۰,۰۰۰	۲,۴۰۰,۰۰۰	فولاد مبارکه اصفهان
۱,۰۹۳,۰۷۷,۷۹۰	(۱۵,۱۰۶,۸۵۰)	(۱۴,۳۵۱,۵۰۸)	(۱,۹۵۷,۷۵۰,۵۶۸)	۳,۰۲۱,۳۷۰,۰۰۰	۱۲۱,۰۰۰	پتروشیمی خارک
(۱۱۶,۴۳۴,۰۲۹)	(۹۰۴,۰۵۲)	(۸۵۸,۸۴۹)	(۲۹۹,۰۰۷,۳۳۰)	۱۸۰,۸۱۰,۳۰۰	۳۶,۳۰۰	داروسازی جابر ابن حیان
۹۷۶,۸۶۰	(۹۰۴۵,۰۰۰)	(۸,۵۹۲,۷۵۰)	(۱,۸۲۵,۶۶۰,۸۹۰)	۱,۸۰۹,۰۰۰,۰۰۰	۱,۸۰۰,۰۰۰	بانک صادرات ایران
۲۱۱,۳۶۹,۸۳۱	(۳,۳۷۵,۵۵۰)	(۳,۱۱۱,۷۷۳)	(۴۵۰,۱۲۷,۴۹۲)	۶۵۵,۱۱۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	پالایش نفت بندرعباس
۴۰۸,۶۳۳,۴۵۷	(۷,۸۴۳,۶۶۴)	(۷,۴۵۱,۴۸۰)	(۱,۱۷۵,۴۰۴,۳۹۶)	۱,۵۶۸,۷۳۲,۷۰۹	۶۴۴,۷۷۳	گسترش نفت و گاز پارسیان
۱۶۷,۹۷۹,۰۷۱	(۱۰,۳۶۸,۸۳۷)	(۹,۸۵۰,۳۹۵)	(۱,۹۲۶,۰۰۷,۶۱۵)	۲,۰۷۳,۷۶۷,۴۵۴	۲۵۵,۴۵۳	پتروشیمی پردیس
(۶۶۴۸,۱۳۳)	(۲۰,۴۷۵,۰۰۰)	(۱,۹۴۵,۱۲۵)	(۴۲۰,۱۴۰,۷۵۸)	۴۰۹,۵۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری خوارزمی
(۲۹۳,۳۹۸,۶۶۰)	(۴۴,۴۶۹,۰۲۵)	(۴۲,۳۴۵,۵۷۴)	(۹,۳۳۳,۹۱۸,۲۵۹)	۸,۸۳۲,۸۰۵,۰۰۰	۱,۶۱۵,۰۰۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس
(۲۹۳,۵۹۹,۸۶۱)	(۵,۷۶۰,۰۰۰)	(۵,۴۷۲,۰۰۰)	(۱,۴۵۶,۸۳۱,۸۶۱)	۱,۱۵۲,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۰,۰۰۰	سرمایه گذاری دارویی تامین
۵۳۰,۰۶۴,۳۹۱	(۱۶,۴۸۴,۲۶۶)	(۱۵,۶۶۰,۰۵۳)	(۲,۷۹۸,۹۳۳,۱۰۸)	۳,۲۹۶,۸۵۳,۱۸۰	۸۰۲,۷۴۰	شرکت آهن و فولاد ارفع
۱۴,۸۷۵,۰۱۸	(۴,۰۲۸,۸۷۳)	(۳,۸۲۷,۴۲۹)	(۷۹۸,۷۵۵,۷۸۴)	۸۰۵,۷۷۴,۵۰۰	۴۵,۹۰۰	داروسازی کاسپین تامین
۴۱۶,۲۶۶,۳۶۱	(۲۱,۸۶۱,۰۴۴)	(۲۰,۷۶۷,۹۹۲)	(۳,۹۹۸,۵۷۱,۵۳۵)	۴,۳۷۲,۲۰۸,۸۶۰	۱,۸۰۰,۷۴۵	فولاد کاوه جنوب کیش
۷۳۱,۸۵۵,۰۶۶	(۲۴,۲۷۰,۷۵۰)	(۲۳,۰۵۷,۲۱۳)	(۴,۱۷۹,۶۲۲,۸۹۷)	۴,۸۵۴,۱۵۰,۰۰۰	۱,۰۵۰,۰۰۰	پتروشیمی مبین
(۳۱۱,۵۵۷,۲۸۴)	(۲۲,۳۴۱,۱۷۹)	(۲۱,۲۲۴,۱۲۱)	(۴,۸۱۳,۳۵۸,۵۸۲)	۴,۴۶۸,۲۳۵,۸۹۸	۳۰۰,۴۲۶	معدنی کیمیای زنجان گستران
۳۲,۲۵۹,۸۳۱	(۲,۳۳۳,۰۷۸)	(۲,۱۲۱,۴۲۴)	(۴۱۸,۷۱۰,۲۹۱)	۴۴۶,۶۱۵,۶۲۰	۴۳,۱۹۳	پتروشیمی جم
(۱۶۰,۴۴۵,۶۷۷)	(۲,۲۴۵,۰۰۰)	(۲,۱۳۲,۷۵۰)	(۶۱۳,۸۳۳,۴۳۷)	۴۴۹,۰۰۰,۰۰۰	۲۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری مسکن الوند
(۱۱,۰۲۷,۱۹۳)	(۱۷,۷۳۴,۹۷۷)	(۱۶,۸۳۸,۷۲۸)	(۳,۵۹۰,۵۸۶,۱۹۸)	۳,۵۴۴,۹۹۵,۳۰۰	۸۲۳,۴۶۰	پالایش نفت تهران
۴۴,۶۳۷,۷۰۸	(۱۰,۸۱۱,۳۷۳)	(۱۰,۲۷۰,۸۰۳)	(۲,۱۳۸,۷۲۸,۸۱۵)	۲,۱۶۲,۲۷۴,۳۴۸	۱۵۹,۶۰۱	تولید و صادرات ریشمک
۲۶	(۲۳۳)	(۲۲۱)	(۴۶,۹۹۵)	۴۶,۵۶۷	۱	کنتور سازی ایران
۱۷۲	(۵)	(۵)	(۸۹۶)	۱,۰۵۸	۱	گروه بهمن
۱۱,۰۱۰,۶۰۴,۰۴۰	(۴۹۴,۴۱۸,۲۰۹)	(۴۶۹,۶۹۷,۲۹۹)	(۸۸,۸۳۷,۱۰۲,۹۲۰)	۹۸,۸۸۳,۶۱۱,۴۵۲	۲۷,۱۸۸,۰۲۴	جمع

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 دوره مالی سالانه منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ مبلغ ۹۸،۱۹۳،۱۳۱،۳۰۴ ریال بوده است.



۸. بازدهی صندوق:

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون از زمان ابتدا دوره ۱۳۹۵/۱۲/۰۱ تا پایان دوره مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

شرح	مقدار در ۱۳۹۵/۱۲/۰۱	مقدار در ۱۳۹۶/۱۱/۳۰	درصد بازدهی
NAV صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون	۲,۵۱۶,۸۷۹	۳,۲۹۷,۲۸۴	۳۱,۰۱٪
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۷۷,۶۵۸	۹۸,۱۴۸	۲۶,۳۸٪

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.