

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون

دوره مالی سالانه 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 مطابق با ماده ۵۷ اساسنامه قابل تمدید است. در حال حاضر با استناد به مجمع مورخ ۱۳۹۶/۱۱/۱۵ و تایید سازمان بورس و اوراق بهادار تهران، مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۳۹۹/۱۱/۱۹ 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 دامن، خیابان فخار مقدم، نبش بوستان دوم غربی، پلاک ۲۲ طبقه ۳ واقع شده است 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.

۲.۱. 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 فخر 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 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.

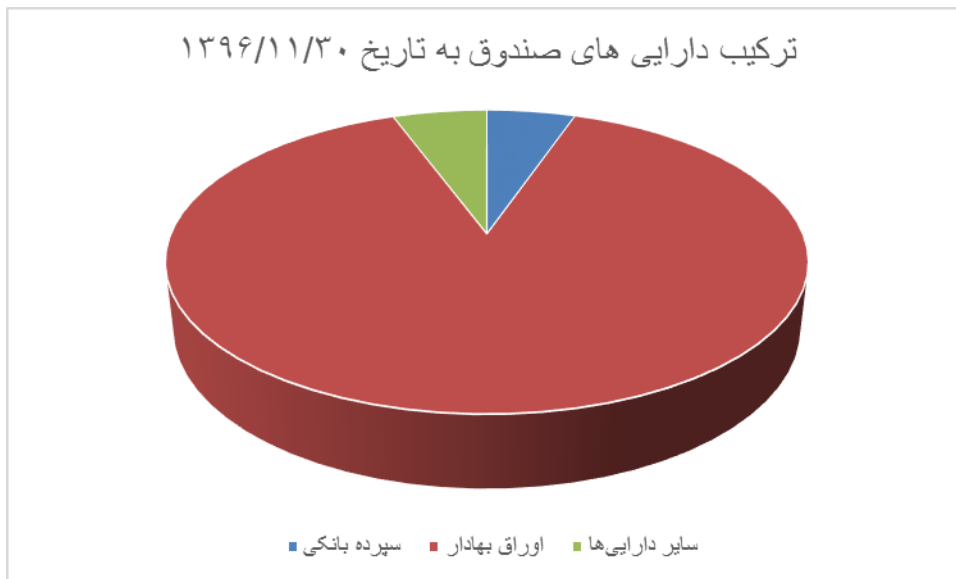
۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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 با درآمد 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،۲۹۶

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



۵- سود اوراق با درآمد ثابت به شرح زیر می باشد:

درصد خالص ارزش فروش به کل دارایی‌ها	سود (زیان) فروش	شرح
۰.۰۰۸۲	۸,۰۰۸,۸۳۳	اوراق مشارکت گلگهر ۳ ماهه ۲۰٪
۰.۰۰۱۵	۱۴۸,۰۰۳,۰۵۵	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۶۱۳
۰.۰۰۲۲	۲۲۰,۴۶۸,۱۲۲	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۷۰۳
۰.۰۰۳۸	۳۷۶,۴۸۰,۰۱۰	جمع

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

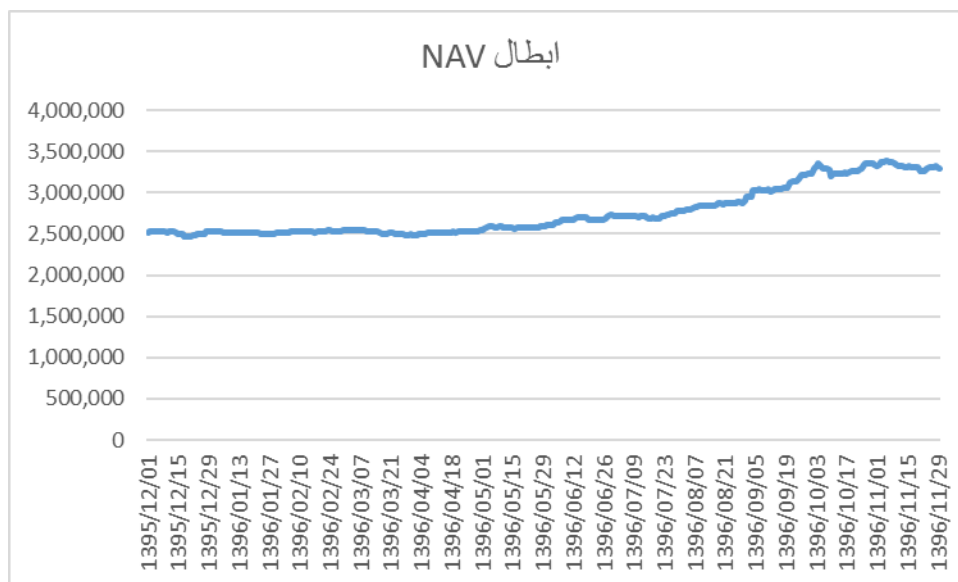
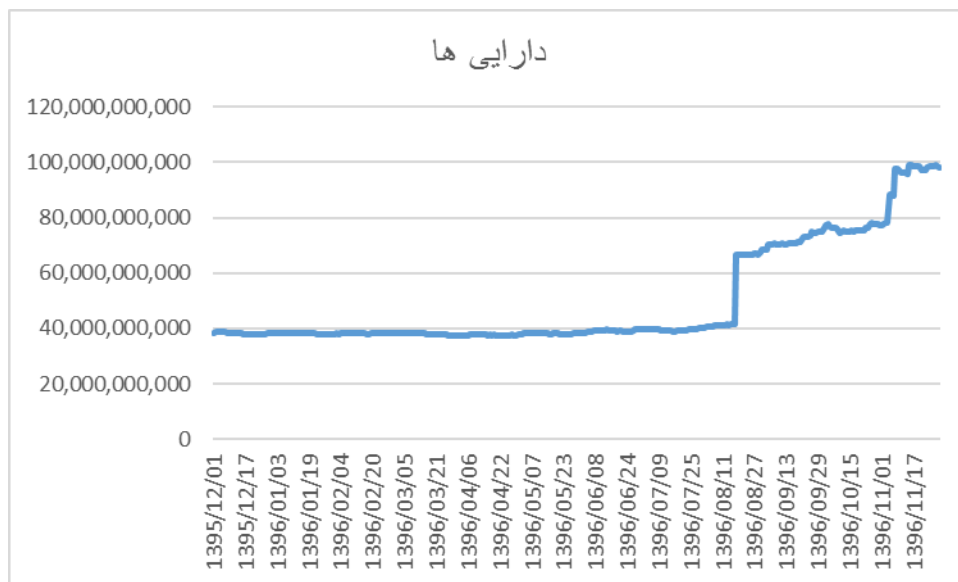
سود (زیان) حاصل از فروش سهام (ریال)	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
بهمن دیزل	۴۹,۳۰۰	۱۷۹,۹۴۵,۰۰۰	(۱۷۳,۱۹۶,۷۹۹)	(۹۱۹,۵۲۰)	(۸۹۹,۷۳۵)	۴,۹۲۸,۹۵۶
پارس خودرو	۲۰۰,۰۰۰	۱۶۶,۶۲۱,۲۳۴	(۲۱۸,۲۵۵,۵۹۲)	(۷۹۱,۴۵۰)	(۸۳۳,۱۰۷)	(۵۳,۲۵۸,۸۷۵)
پاکسان	۸۰,۰۰۰	۵۴۱,۳۳۴,۴۶۸	(۴۵۷,۸۴۴,۳۶۷)	(۲,۸۶۳,۶۰۷)	(۲,۷۰۶,۶۲۲)	۷۷,۹۰۹,۸۷۳
پالایش نفت بندرعباس	۶۰,۰۰۰	۳۳۹,۱۶۶,۵۱۹	(۲۹۱,۵۶۸,۵۶۹)	(۱,۷۴۱,۳۹۱)	(۱,۶۴۵,۸۳۳)	۳۴,۲۱۰,۸۲۶
پتروشیمی جم	۵۶,۸۰۷	۴۸۵,۱۱۸,۲۰۰	(۵۳۹,۳۲۹,۵۷۵)	(۲,۳۲۵,۲۱۴)	(۲,۴۲۵,۵۹۱)	(۵۸,۸۶۲,۱۸۰)
پتروشیمی زاگرس	۷۰,۰۰۰	۱,۳۴۲,۷۹۰,۰۰۰	(۱,۳۳۳,۶۲۱,۴۹۸)	(۶,۳۵۰,۶۵۳)	(۶,۲۱۳,۹۵۰)	(۹۳,۳۹۶,۱۰۱)
پتروشیمی شازند	۴۹۰,۰۰۰	۱,۲۶۵,۹۳۶,۰۵۸	(۱,۳۰۱,۷۰۳,۶۶۷)	(۶,۴۲۵,۸۴۷)	(۶,۳۲۹,۶۷۲)	(۴۸,۵۳۳,۱۲۸)
پتروشیمی فجر	۲۴,۳۸۲	۱۴۶,۶۸۲,۰۰۱	(۱۴۵,۵۳۴,۷۱۹)	(۷۷۵,۹۶۶)	(۷۳۳,۴۱۰)	(۳۶۲,۰۷۴)
پتروشیمی فناوریان	۲۱,۰۸۱	۴۴۸,۵۷۰,۵۷۶	(۴۴۸,۹۳۲,۳۲۶)	(۲,۳۳۰,۶۱۷)	(۲,۲۰۲,۸۵۳)	(۱۲,۸۹۵,۲۳۰)
توسعه معادن و فلزات	۷۰۰,۰۰۰	۸۹۹,۶۰۶,۰۰۰	(۹۹۱,۳۹۲,۵۰۷)	(۴,۷۵۸,۹۱۸)	(۴,۴۹۸,۰۳۰)	(۱۰۱,۰۴۳,۴۵۵)
تولیدی کاشی تکسرام	۶۰,۰۰۰	۱۴۴,۰۳۰,۵۴۶	(۱۳۴,۲۶۹,۳۹۷)	(۷۶۱,۹۲۱)	(۷۲۰,۱۵۳)	۸,۲۷۹,۰۷۵
داروسازی جابر ابن حیان	۵۹,۵۸۸	۴۱۱,۳۳۳,۵۰۰	(۵۲۵,۹۷۶,۵۲۷)	(۲,۰۱۹,۱۳۸)	(۲,۰۵۶,۱۶۷)	(۱۱۸,۸۱۸,۳۳۲)
داروسازی کاسپین تامین	۵,۱۰۰	۸۷,۷۹۹,۸۰۰	(۸۷,۰۰۴,۹۷۷)	(۴۴۸,۵۵۶)	(۴۳۸,۸۹۹)	(۱۱۲,۴۵۲)
سرمایه گذاری دارویی تامین	۱۸۵,۰۰۰	۹۹۷,۸۷۷,۱۵۹	(۱,۰۶۱,۴۳۲,۳۳۰)	(۴,۸۵۷,۸۱۱)	(۴,۹۱۹,۴۸۷)	(۷۳,۴۰۲,۳۳۹)
سرمایه گذاری ملی ایران	۵۳۴,۱۷۷	۷۵۳,۳۳۲,۵۷۰	(۸۱۳,۶۳۹,۰۱۵)	(۳,۵۷۷,۸۵۵)	(۳,۷۶۶,۱۶۳)	(۶۷,۷۵۰,۴۶۳)
شیر پاستوریزه پگاه گلیپگان	۶۰,۰۰۰	۷۸۰,۷۴۸,۰۷۰	(۸۶۱,۴۶۲,۹۳۳)	(۳,۹۸۹,۶۲۱)	(۳,۹۰۳,۳۳۹)	(۸۸,۶۰۸,۲۱۳)
صنایع خاک چینی ایران	۴۰,۰۰۰	۵۶۱,۵۴۵,۰۰۰	(۴۳۵,۹۱۷,۰۴۸)	(۲,۹۷۰,۵۷۵)	(۲,۸۰۷,۷۳۵)	۱۱۹,۷۷۹,۶۵۲
صنعتی بهشهر	۱	۱	(۲,۵۴۱)			(۲,۵۴۰)
فولاد خوزستان	۲۲۸,۵۸۵	۷۶۲,۱۹۹,۶۲۵	(۷۸۵,۹۳۲,۹۵۶)	(۴,۰۳۲,۰۳۸)	(۳,۸۱۰,۹۹۸)	(۳۱,۵۷۶,۳۶۷)
کارتقن ایران	۱۵۵,۰۰۰	۶۰۴,۵۴۵,۳۳۰	(۵۲۵,۴۱۲,۲۹۷)	(۳,۱۹۸,۰۴۳)	(۳,۰۲۳,۷۳۷)	۷۲,۹۱۲,۱۶۴
گروه دارویی سبحان	۱۲۳,۲۵۶	۵۶۵,۸۵۳,۶۴۷	(۷۰۱,۸۰۲,۲۰۱)	(۲,۷۱۴,۷۶۷)	(۲,۸۲۹,۲۶۹)	(۱۴۱,۴۹۲,۵۹۰)
گروه صنعتی بارز	۱۵۱,۲۲۵	۴۹۵,۶۴۵,۵۵۰	(۴۹۱,۸۱۱,۹۹۲)	(۲,۶۲۱,۹۶۷)	(۲,۴۷۸,۲۲۸)	(۱,۲۶۶,۶۳۷)
گروه مینا	۱۲,۰۰۰	۹۹,۹۳۶,۰۰۰	(۹۷,۶۱۴,۸۱۳)	(۵۲۸,۶۶۰)	(۴۹۹,۶۸۰)	۱,۲۹۲,۷۷۷
لیزینگ ایرانیان	۱۰۰,۰۰۰	۱۴۳,۵۵۸,۳۷۹	(۲۰۰,۴۳۸,۶۲۱)	(۶۸۱,۹۰۰)	(۷۱۷,۷۹۳)	(۵۸,۲۷۹,۹۳۵)
لیزینگ رایان سایبا	۴۵,۰۱۷۸	۶۸۱,۷۳۱,۵۸۴	(۷۴۸,۹۶۲,۴۱۳)	(۳,۵۶۸,۵۰۰)	(۳,۴۰۸,۶۵۷)	(۷۴,۲۰۷,۹۸۶)
مخابرات ایران	۱۰۰,۰۰۰	۱۹۱,۰۵۰,۷۴۴	(۲۳۴,۱۶۹,۳۱۵)	(۱,۰۱۰,۶۵۴)	(۹۵۵,۲۵۳)	(۳۵,۰۸۴,۴۷۸)
معدنی و صنعتی گل گهر	۳۱۰,۰۰۰	۷۳۹,۵۱۷,۵۴۴	(۷۵۳,۲۱۸,۷۸۳)	(۳,۹۱۲,۰۴۴)	(۳,۶۹۷,۵۸۸)	(۲۱,۳۱۰,۸۷۱)
گروه بهمن	۲۹۵,۸۵۷	۳۳۹,۳۳۹,۰۶۳	(۲۶۱,۴۳۱,۰۲۰)	(۱,۵۶۴,۳۶۱)	(۱,۶۴۶,۶۹۶)	۶۴,۶۹۶,۹۸۶
فولاد کاوه جنوب کیش	۱۷۰,۰۰۰	۴۵۵,۶۰۳,۱۵۷	(۳۶۹,۴۳۷,۸۱۱)	(۲,۱۶۴,۱۱۷)	(۲,۲۷۸,۰۱۶)	۸۱,۷۳۳,۲۱۳
ملی صنایع مس ایران	۲۰۰,۰۰۰	۵۲۹,۵۳۰,۰۰۰	(۴۱۵,۴۰۳,۰۲۵)	(۲,۵۱۵,۲۶۵)	(۲,۶۴۷,۶۵۰)	۱۰۸,۹۶۴,۰۶۰
شرکت آهن و فولاد ارفع	۳۵۰,۰۰۰	۱,۶۲۷,۵۰۰,۰۰۰	(۱,۱۹۲,۳۳۳,۲۵۱)	(۷,۷۳۰,۶۳۴)	(۸,۱۳۷,۵۰۰)	۴۱۹,۳۰۸,۶۲۵
سرمایه گذاری خوارزمی	۵۰۰,۰۰۰	۴۵۱,۰۸۵,۵۳۰	(۴۱۲,۱۵۵,۵۰۷)	(۲,۱۴۴,۶۵۶)	(۲,۲۵۵,۴۲۸)	۳۴,۵۳۱,۹۳۹
سرمایه گذاری مسکن الوند	۱۰۰,۰۰۰	۲۸۹,۰۰۰,۰۰۰	(۳۰۲,۵۳۳,۹۶۳)	(۱,۳۷۲,۷۵۲)	(۱,۴۴۵,۰۰۰)	(۱۶,۳۵۱,۷۱۵)
باما	۳۰,۰۰۰	۲۷۰,۰۰۲,۲۲۰	(۲۲۴,۳۹۵,۱۶۵)	(۱,۲۸۲,۵۱۰)	(۱,۳۵۰,۰۱۱)	۴۳,۰۷۴,۵۳۴
جمع	۵,۹۷۱,۵۳۷	۱۷,۶۷۰,۳۰۵,۰۱۵	(۱۷,۵۱۷,۹۹۷,۳۰۰)	(۸۸,۹۴۹,۴۲۷)	(۸۸,۳۵۱,۵۲۰)	(۲۴,۹۹۳,۳۷۲)

۷. 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	(۱۲,۲۶۹,۶۴۳)	(۱۲,۹۸۱,۲۸۲)	(۲,۲۲۱,۰۵۷,۲۶۹)	۲,۴۵۳,۹۲۸,۵۸۸	۱,۰۸۵,۲۱۷	مخابرات ایران
۳۴,۶۱۷,۹۰۶	(۷,۱۳۳,۰۰۰)	(۷,۵۴۶,۷۱۴)	(۱,۳۷۷,۳۰۲,۳۸۰)	۱,۴۲۶,۶۰۰,۰۰۰	۴۵۰,۰۰۰	ملی سرب و روی ایران
(۵۲۶,۳۰۴,۳۸۱)	(۲۸,۳۹۱,۶۴۲)	(۳۰,۰۳۸,۳۵۷)	(۶,۱۴۶,۲۰۲,۷۸۴)	۵,۶۷۸,۳۲۸,۴۰۲	۸۰۴,۶۵۵	گروه مینا
۱۷۳,۳۹۴,۷۶۸	(۱۰,۱۳۷,۹۱۰)	(۱۰,۷۲۵,۹۰۹)	(۱,۸۱۳,۳۳۳,۴۱۳)	۲,۰۲۷,۵۸۲,۰۰۰	۱,۱۹۰,۰۰۰	سرمایه گذاری بازنشستگی کشوری
۳۶,۳۰۴,۸۳۲	(۳,۲۲۶,۶۷۰)	(۳,۴۱۳,۸۱۷)	(۶۰۲,۳۸۸,۶۴۴)	۶۴۵,۳۳۳,۹۵۲	۴۷۱,۸۳۳	سرمایه گذاری غدیر
(۵۵,۲۰۸,۲۹۳)	(۴,۹۲۷,۳۷۶)	(۵,۲۱۳,۱۶۴)	(۱,۰۳۰,۵۴۲,۹۰۹)	۹۸۵,۴۷۵,۱۵۵	۱,۱۸۶,۶۷۲	کمیابین سازی ایران
۲,۰۸۰,۴۲۶,۱۷۵	(۴۴,۰۶۴,۰۰۰)	(۴۱,۸۶۰,۸۰۰)	(۶,۶۴۶,۴۴۸,۴۲۵)	۸,۸۱۲,۸۰۰,۰۰۰	۳,۲۰۰,۰۰۰	ملی صنایع مس ایران
(۲,۹۱۹,۲۱۹)	(۲۰,۳۹۹,۲۵۱)	(۲۱,۵۶۱,۳۴۸)	(۴,۰۳۶,۸۲۸,۹۶۲)	۴,۰۷۵,۸۵۰,۲۴۲	۱,۵۴۹,۴۹۷	تراکتورسازی ایران
۱۴۸,۰۳۹,۱۳۴	(۳,۰۵۸,۴۳۳)	(۲,۹۰۵,۵۰۲)	(۴۵۷,۶۸۱,۵۰۵)	۶۱۱,۶۸۴,۵۶۳	۳۳۲,۷۹۹	توسعه معادن و فلزات
۱,۴۹۷,۶۷۹,۸۰۹	(۶۶,۸۲۵,۸۳۰)	(۷۰,۷۰۱,۷۳۹)	(۱۱,۷۳۹,۹۵۸,۷۳۳)	۱۳,۳۶۵,۱۶۶,۰۹۱	۲,۸۴۸,۷۶۹	پالایش نفت اصفهان
۶۱۸,۴۶۵,۲۷۸	(۱۲,۵۱۰,۵۰۰)	(۱۳,۳۳۶,۱۰۹)	(۱,۸۵۷,۸۸۸,۱۱۳)	۲,۵۰۲,۱۰۰,۰۰۰	۷۰۰,۰۰۰	معدنی و صنعتی گل گهر
۲۹۰,۷۸۹,۱۰۲	(۴,۶۹۶,۵۰۵)	(۴,۹۶۸,۹۰۲)	(۶۳۸,۸۴۶,۴۱۴)	۹۳۹,۳۰۰,۹۲۲	۲۹,۹۹۹	پتروشیمی فنوران
۱,۲۰۲,۵۱۲,۳۸۰	(۲۱,۱۸۲,۰۰۰)	(۲۲,۴۱۰,۵۵۶)	(۲,۹۹۰,۳۹۵,۰۶۴)	۴,۳۳۶,۴۰۰,۰۰۰	۴۰۰,۰۰۰	باما
۲,۸۵۶,۳۰,۹۲۰	(۳۴,۹۱۶,۰۰۰)	(۳۶,۹۴۱,۱۲۸)	(۴,۰۵۵,۰۲۱,۹۵۲)	۶,۹۸۳,۲۰۰,۰۰۰	۲,۴۰۰,۰۰۰	فولاد مبارکه اصفهان
۱,۰۹۳,۰۷۷,۷۹۰	(۱۵,۱۱۶,۸۵۰)	(۱۵,۹۹۳,۶۲۷)	(۱,۸۹۹,۸۸۱,۷۳۳)	۳,۰۳۳,۳۷۰,۰۰۰	۱۲۱,۰۰۰	پتروشیمی خارک
(۱۱۶,۴۴۴,۰۲۹)	(۹۰۴,۰۵۳)	(۸۵۸,۸۵۰)	(۲۹۵,۴۸۱,۷۲۶)	۱۸۰,۸۱۰,۶۰۰	۳۶,۳۰۰	داروسازی جابر ابن حیان
۹۷۶,۸۳۸	(۹,۰۵۰,۰۰۰)	(۹,۵۷۴,۹۰۰)	(۱,۷۹۰,۳۹۸,۲۶۲)	۱,۸۱۰,۰۰۰,۰۰۰	۱,۸۰۰,۰۰۰	بانک صادرات ایران
۲۱۱,۳۶۹,۸۳۱	(۳,۳۷۵,۵۵۰)	(۳,۴۶۵,۵۳۲)	(۴۳۶,۹۹۹,۰۸۷)	۶۵۵,۱۱۰,۰۰۰	۹۰,۰۰۰	پالایش نفت بندرعباس
۴۰۸,۶۲۳,۴۵۷	(۷,۸۱۷,۴۹۳)	(۸,۳۰۳,۱۳۴)	(۱,۱۴۴,۸۱۴,۱۰۸)	۱,۵۶۹,۵۸۸,۶۳۲	۶۴۴,۷۷۳	گسترش نفت و گاز پارسیان
۱۶۷,۹۷۹,۰۷۱	(۱۰,۳۷۴,۴۹۵)	(۱۰,۹۷۶,۲۱۵)	(۱,۸۸۵,۵۶۹,۱۵۰)	۲,۰۷۴,۹۸۸,۹۳۱	۲۵۵,۴۵۳	پتروشیمی پردیس
(۶,۶۴۸,۱۳۳)	(۲,۰۴۸,۵۰۰)	(۲,۱۶۷,۳۱۳)	(۴۱۲,۱۳۳,۳۲۰)	۴۰۹,۷۰۰,۰۰۰	۵۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری خوارزمی
(۲۹۳,۳۹۸,۶۶۰)	(۴۴,۴۹۴,۰۲۵)	(۴۷,۰۷۴,۶۷۸)	(۹,۱۰۰,۶۳۴,۹۵۷)	۸,۹۸۸,۸۰۵,۰۰۰	۱,۶۱۵,۰۰۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس
(۲۹۳,۵۹۹,۸۶۱)	(۵,۷۶۵,۰۰۰)	(۶,۰۹۹,۳۷۰)	(۱,۴۳۴,۷۳۵,۴۹۱)	۱,۱۵۳,۰۰۰,۰۰۰	۲۵۰,۰۰۰	سرمایه گذاری دارویی تامین
۵۳۰,۰۶۴,۳۹۱	(۱۶,۴۸۴,۲۶۶)	(۱۵,۶۶۰,۰۵۳)	(۲,۷۳۴,۶۴۴,۴۷۰)	۳,۲۹۶,۸۵۳,۱۸۰	۸۰۲,۷۴۰	شرکت آهن و فولاد ارفع
۱۴,۸۷۵,۰۱۸	(۴,۰۲۸,۸۱۳)	(۳,۸۱۷,۴۲۹)	(۷۸۳,۰۴۳,۸۸۱)	۸۰۵,۷۴۴,۵۰۰	۴۵,۹۰۰	داروسازی کاسپین تامین
۴۱۶,۲۶۶,۳۶۱	(۲۱,۸۱۳,۹۷۳)	(۲۳,۱۴۱,۶۰۴)	(۳,۹۱۳,۳۱۳,۴۶۲)	۴,۲۷۴,۹۲۴,۳۹۹	۱,۸۰۰,۷۴۵	فولاد کاوه جنوب کیش
۷۳۱,۸۵۵,۰۶۶	(۳۴,۲۸۳,۲۵۰)	(۳۵,۶۹۱,۶۷۹)	(۴,۰۸۴,۸۲۰,۰۰۶)	۴,۸۵۶,۶۵۰,۰۰۰	۱,۰۵۰,۰۰۰	پتروشیمی مبین
(۳۱۱,۵۵۷,۳۸۴)	(۲۲,۳۴۱,۱۷۹)	(۲۱,۳۲۴,۱۲۱)	(۴,۷۳۶,۳۲۷,۹۸۲)	۴,۴۶۸,۱۳۵,۸۹۸	۳۰۰,۴۲۶	معدنی کیمیای زنجان گستران
۳۲,۲۵۹,۸۳۱	(۲,۳۳۴,۲۹۶)	(۲,۳۶۳,۸۸۶)	(۴۱۰,۰۰۱,۲۸۶)	۴۴۶,۸۵۹,۲۹۹	۴۳,۱۹۳	پتروشیمی جم
(۱۶۰,۴۴۵,۶۷۷)	(۲,۳۴۵,۰۰۰)	(۲,۱۳۲,۷۵۰)	(۶۰۵,۰۶۷,۹۲۷)	۴۴۹,۰۰۰,۰۰۰	۲۰۰,۰۰۰	سرمایه گذاری مسکن الوند
(۱۱,۰۲۷,۱۹۳)	(۱۷,۷۳۴,۶۴۷)	(۱۸,۷۶۳,۳۵۷)	(۳,۵۲۱,۴۵۸,۷۸۸)	۳,۵۴۶,۹۲۵,۵۰۰	۸۲۳,۴۶۰	پالایش نفت تهران
۴۴,۶۲۷,۷۳۳	(۱۰,۸۱۱,۳۷۳)	(۱۰,۲۷۰,۸۰۳)	(۲,۰۹۶,۵۶۴,۴۴۱)	۲,۱۶۲,۲۷۴,۳۴۸	۱۵۹,۶۰۱	تولید و صادرات ریشمک
۲۵	(۳۳۳)	(۳۴۶)	(۴۶,۰۸۷)	۴۶,۵۹۱	۱	کنترل سازی ایران
۱۷۱	(۵)	(۶)	(۸۷۶)	۱,۰۵۸	۱	گروه بهمن
۱۱,۰۱۰,۶۰۴,۰۴۰	(۴۹۴,۶۳۱,۲۵۹)	(۵۱۲,۰۹۴,۶۵۹)	(۸۶,۹۰۸,۹۲۱,۸۹۵)	۹۸,۹۲۶,۲۵۱,۸۵۳	۲۷,۱۸۸,۰۲۴	جمع

۸. 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 سالیانه منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۳۰ مبلغ ۹۸،۱۹۳،۱۳۱،۳۰۴ ریال بوده است.



۹. 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	۱۳۹۵/۱۲/۰۱	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

۱۰. 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.