

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری بانک توسعه تعاون

دوره مالی سالیانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

## 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 بازخريد آنها را قبل از سررسيد 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 تأیید 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 دادمان، 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](http://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 فخر 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-پایین تر از پارک ساعی - برج سرو ساعی - طبقه ۱۷ - واحد ۱۷۰۵.

**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 ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ تعداد ۲۷،۱۷۴ واحد بوده که این تعداد شامل ۲۶،۱۷۴ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

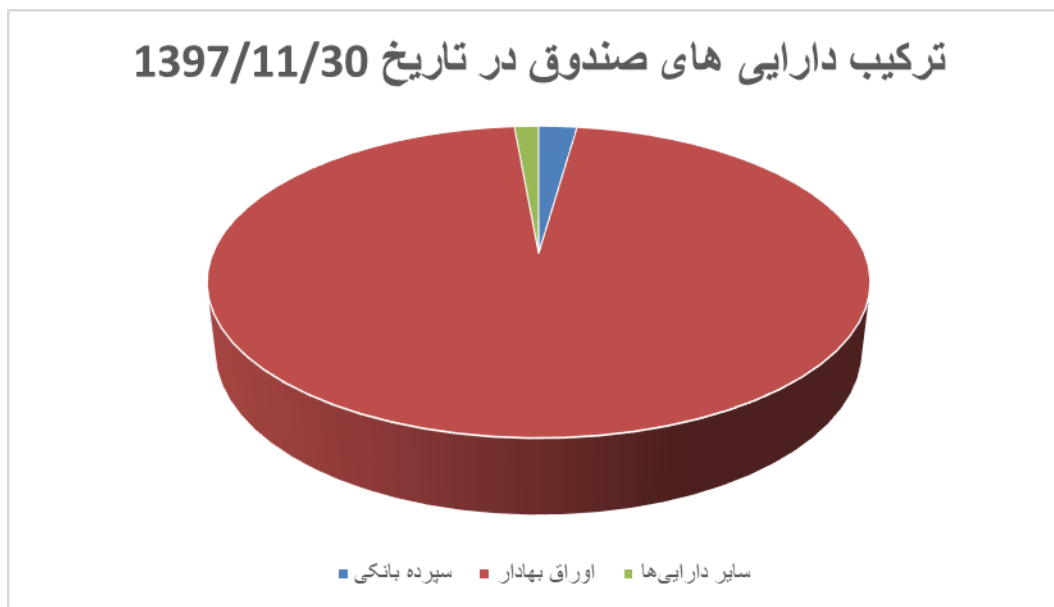
### ۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

#### 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 ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ |                       |
|--------------------------------------------|-----------------------|
| عنوان                                      | خالص ارزش فروش (ریال) |
| سپرده بانکی                                | ۴,۳۴۷,۶۴۱,۸۰۹         |
| اوراق بهادار                               | ۱۸۷,۸۲۷,۲۵۷,۲۶۸       |
| سایر دارایی‌ها                             | ۲,۷۴۷,۲۹۹,۸۸۱         |

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



## 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 |
|-------------------------------------|-----------|----------------|------------------|---------------|--------------|-----------------|
| ایران یاساتایرورابر                 | ۱۵۰,۰۰۰   | ۳۹۳,۰۵۸,۳۰۰    | (۳۹۴,۲۵۹,۷۶۹)    | (۱,۸۶۷,۰۲۷)   | (۳۹۳,۰۵۸)    | (۳,۴۶۱,۵۵۴)     |
| آسان پرداخت پرشین                   | ۱۲۷,۱۹۳   | ۱,۵۷۳,۴۴۴,۳۲۹  | (۱,۵۴۸,۰۴۴,۵۱۰)  | (۷,۴۳۳,۸۱۳)   | (۱,۵۷۳,۴۴۴)  | ۱۶,۳۵۲,۵۶۲      |
| باما                                | ۱۴۰,۰۰۰   | ۱,۴۲۸,۸۹۲,۳۱۱  | (۱,۰۰۲,۳۷۰,۱۱۳)  | (۶,۷۸۷,۳۳۵)   | (۱,۴۲۸,۸۹۲)  | ۴۱۸,۳۰۵,۹۷۲     |
| بانک تجارت                          | ۶۰۰,۰۰۰   | ۱,۰۲۹,۲۹۲,۳۰۲  | (۸۵۷,۵۵۲,۳۴۷)    | (۴,۸۸۹,۱۳۹)   | (۱,۰۲۹,۲۹۱)  | ۱۶۵,۸۲۱,۵۲۵     |
| بانک صادرات ایران                   | ۱,۸۰۰,۰۰۰ | ۱,۵۳۳,۷۳۹,۵۸۸  | (۱,۷۹۱,۳۶۲,۲۶۲)  | (۷,۳۳۷,۷۶۳)   | (۲,۵۲۵,۰۴۴)  | (۲۷۷,۳۸۵,۴۷۱)   |
| بانک ملت                            | ۱,۸۰۰,۰۰۰ | ۳,۸۴۵,۱۸۱,۳۲۷  | (۳,۴۲۰,۹۷۱,۹۴۳)  | (۱۸,۲۶۴,۶۰۳)  | (۳,۸۴۵,۱۸۳)  | ۴۰۲,۰۹۹,۶۰۸     |
| پارس دارو                           | ۱۰۴,۰۰۰   | ۹۹۱,۱۱۵,۶۰۰    | (۸۲۴,۸۲۱,۰۲۹)    | (۴,۷۰۷,۷۹۸)   | (۹۹۱,۱۱۶)    | ۱۶۰,۵۹۶,۰۱۷     |
| پارس مینو                           | ۴۸,۶۰۶    | ۱۵۰,۶۷۹,۰۱۸    | (۱۳۵,۸۵۰,۲۰۰)    | (۷۱۵,۷۲۶)     | (۱۵۰,۶۷۸)    | ۱۳,۹۶۲,۴۱۴      |
| پالایش نفت اصفهان                   | ۲,۷۸۶,۶۰۰ | ۲۰,۳۳۳,۹۱۵,۸۵۴ | (۱۳,۳۳۵,۱۶۲,۱۷۱) | (۹۶,۵۸۶,۰۷۹)  | (۳۰,۹۴۹,۱۱۵) | ۶,۸۱۱,۲۱۸,۴۸۹   |
| پالایش نفت بندرعباس                 | ۴۴۰,۰۰۰   | ۵,۰۶۸,۰۴۴,۲۳۰  | (۵,۲۸۵,۳۴۸,۲۱۷)  | (۲۴۰,۷۳۲,۰۲۹) | (۷,۸۸۷,۹۳۴)  | (۲۴۹,۱۶۵,۱۲۰)   |
| پالایش نفت تهران                    | ۱,۳۳۵,۰۰۷ | ۷,۹۳۳,۰۸۶,۳۴۱  | (۴,۳۷۰,۴۷۹,۶۰۶)  | (۳۷,۶۸۲,۱۳۹)  | (۷,۹۳۳,۰۹۱)  | ۳,۵۱۶,۹۹۱,۴۹۵   |
| پالایش نفت شیراز                    | ۱۱۰,۰۰۰   | ۳,۲۸۱,۶۹۴,۴۴۳  | (۳,۳۱۸,۵۸۸,۱۰۰)  | (۱۵,۵۸۸,۰۵۰)  | (۳,۲۸۱,۶۹۵)  | (۵۵,۷۶۳,۴۰۳)    |
| پتروشیمی پارس                       | ۱۰,۰۰۰    | ۳۲۸,۶۱۲,۳۳۳    | (۳۰۷,۷۳۱,۲۳۷)    | (۱,۵۶۰,۹۰۸)   | (۳۲۸,۶۱۲)    | ۱۹,۰۰۱,۵۷۶      |
| پتروشیمی پردیس                      | ۲۰۰,۰۰۰   | ۲,۶۳۴,۲۰۷,۷۶۵  | (۱,۶۰۷,۷۶۹,۸۹۸)  | (۱۳,۵۱۲,۴۸۶)  | (۵,۹۴۹,۶۱۹)  | ۱,۰۰۷,۹۷۵,۷۶۲   |
| پتروشیمی جم                         | ۱۴۳,۱۹۳   | ۲,۵۸۲,۰۷۹,۲۰۰  | (۲,۳۷۱,۴۰۹,۱۶۴)  | (۱۳,۲۶۴,۸۷۱)  | (۲,۵۸۲,۰۸۰)  | ۲۹۵,۸۱۳,۰۸۵     |
| پتروشیمی خارک                       | ۱۲۱,۰۰۰   | ۵,۶۳۴,۸۰۰,۵۰۳  | (۲,۹۹۱,۹۱۱,۶۴۲)  | (۲۶,۷۱۷,۸۰۳)  | (۵,۶۳۴,۷۹۷)  | ۲,۶۰۰,۵۴۶,۲۶۱   |
| پتروشیمی فناوران                    | ۱۱۹,۹۹۹   | ۶,۷۵۵,۹۲۵,۱۲۵  | (۵,۰۱۵,۴۹۸,۵۹۹)  | (۳۲,۰۹۰,۶۴۸)  | (۷,۹۹۸,۴۸۵)  | ۱,۷۰۰,۳۳۷,۲۹۳   |
| پتروشیمی مبین                       | ۱۵۰,۰۰۰   | ۱,۲۶۴,۰۸۱,۲۰۲  | (۶۸۶,۶۸۸,۸۶۳)    | (۶,۰۰۴,۳۸۵)   | (۱,۲۶۴,۰۸۰)  | ۵۷۰,۱۲۳,۸۷۵     |
| پخش البرز                           | ۱۸۸,۰۰۰   | ۴۴۹,۶۳۴,۴۰۰    | (۴۱۹,۶۵۶,۶۲۵)    | (۲,۱۳۵,۷۶۸)   | (۴۴۹,۶۳۵)    | ۲۷,۳۹۲,۳۲۲      |
| تراکتورسازی ایران                   | ۲۳۶,۳۰۰   | ۷۹۷,۸۰۱,۸۷۰    | (۶۱۵,۱۷۵,۶۸۲)    | (۳,۷۸۹,۵۵۷)   | (۷۹۷,۸۰۱)    | ۱۷۸,۰۳۸,۸۳۰     |
| توسعه خدمات دریایی و بندری سینا     | ۲۰,۱۹۰    | ۲۴۳,۴۴۶,۱۰۰    | (۲۳۳,۰۱۶,۴۲۴)    | (۱,۱۵۶,۳۷۰)   | (۲۴۳,۴۴۶)    | ۹,۰۲۹,۸۶۰       |
| توکاریل                             | ۲۸۰,۹۴۸   | ۷۳۲,۸۰۴,۵۸۱    | (۶۶۷,۴۷۵,۲۶۸)    | (۳,۵۲۸,۳۱۶)   | (۷۳۲,۸۰۵)    | ۷۱۰,۵۸۱,۴۶۲     |
| تولید و صادرات ریشمک                | ۸۶۴,۷۷۰   | ۱۴,۴۱۱,۲۶۳,۷۵۹ | (۷,۱۴۷,۱۳۸,۹۹۳)  | (۶۸,۴۵۳,۵۰۶)  | (۳۲,۴۹۰,۳۹۱) | ۷,۱۶۳,۱۸۰,۸۶۹   |

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون دوره مالی سالانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

|                                    |            |                 |                   |               |               |                |
|------------------------------------|------------|-----------------|-------------------|---------------|---------------|----------------|
| تولیدی چدن سازان                   | ۱۰۰,۰۰۰    | ۴۲۱,۰۰۰,۰۰۰     | (۴۱۲,۳۳۹,۷۴۲)     | (۱,۹۹۹,۷۵۰)   | (۴۲۱,۰۰۰)     | ۶,۳۳۹,۵۰۸      |
| تولیدی و خدمات صنایع نسوز توکا     | ۳۰۹,۰۱۳    | ۲,۱۲۷,۳۲۵,۲۰۴   | (۱,۴۰۶,۰۸۲,۱۲۸)   | (۱۰,۱۰۴,۷۹۵)  | (۲,۱۲۷,۳۲۶)   | ۷۰۹,۰۱۰,۹۴۵    |
| داده گستر عصرنوبین-های وب          | ۱۰۰,۰۰۰    | ۶۱۴,۵۳۶,۱۱۰     | (۶۱۴,۸۴۸,۹۶۰)     | (۲,۹۱۹,۰۱۷)   | (۶۱۴,۵۳۶)     | (۵,۸۴۶,۴۰۳)    |
| داروسازی جابر ابن حیان             | ۳۶,۳۰۰     | ۱۴۰,۸۴۴,۱۱۲     | (۱۷۹,۰۴۷,۲۹۸)     | (۶۶۹,۰۰۹)     | (۷۰۴,۲۲۲)     | (۳۹,۵۷۶,۵۱۷)   |
| داروسازی کاسپین تامین              | ۴۵,۹۰۰     | ۴۹۰,۵۷۹,۲۰۰     | (۷۹۷,۹۱۸,۱۹۸)     | (۲,۳۳۰,۲۵۱)   | (۲,۴۵۲,۸۹۶)   | (۳۱۲,۱۲۲,۱۴۵)  |
| س. صنایع شیمیایی ایران             | ۵۰۰,۰۰۰    | ۱,۶۷۳,۱۱۲,۳۵۵   | (۱,۸۵۸,۷۷۲,۳۳۹)   | (۷,۹۴۷,۲۷۸)   | (۴,۳۴۸,۸۱۷)   | (۱۹۷,۹۵۶,۰۸۹)  |
| س. نفت و گاز و پتروشیمی تامین      | ۱,۴۰۰,۰۰۰  | ۲,۹۴۷,۱۴۶,۰۹۷   | (۲,۹۶۱,۸۲۷,۴۴۶)   | (۱۳,۹۹۸,۹۴۹)  | (۲,۹۴۷,۱۴۴)   | (۳۱,۶۳۷,۴۴۲)   |
| سرمایه گذاری خوارزمی               | ۵۰۰,۰۰۰    | ۳۶۶,۵۷۷,۲۱۸     | (۴۰۵,۵۰۷,۳۷۸)     | (۱,۷۴۱,۳۴۳)   | (۱,۸۱۳,۸۸۶)   | (۴۲,۵۰۴,۲۸۹)   |
| سرمایه گذاری دارویی تامین          | ۲۵۰,۰۰۰    | ۱,۰۵۴,۷۰۸,۵۰۰   | (۱,۱۴۰,۷۶۷,۹۹۶)   | (۵,۰۰۹,۸۶۰)   | (۵,۳۳۳,۵۴۳)   | (۹۶,۳۴۲,۸۹۹)   |
| سیمان داراب                        | ۳۰۰,۰۰۰    | ۴۸۶,۷۰۳,۱۷۰     | (۴۶۵,۱۷۸,۲۵۷)     | (۲,۳۱۱,۸۴۲)   | (۴۸۶,۷۰۴)     | ۱۸,۷۲۶,۳۶۷     |
| سیمان فارس نو                      | ۱۷۰,۰۰۰    | ۱,۰۹۵,۰۰۰,۰۰۰   | (۹۸۹,۵۱۴,۳۳۲)     | (۵,۲۰۱,۲۴۸)   | (۱,۰۹۵,۰۰۰)   | ۹۹,۱۸۹,۴۲۰     |
| شرکت آهن و فولاد ارفع              | ۴۰۰,۰۰۰    | ۲,۰۷۵,۸۵۰,۱۲۱   | (۱,۱۴۴,۸۰۲,۵۹۰)   | (۹,۸۶۰,۲۸۹)   | (۲,۰۷۵,۸۴۹)   | ۹۱۹,۱۱۱,۳۹۳    |
| شیر پاستوریزه پگاه گلیایگان        | ۳۰۰,۰۰۰    | ۳۸۹,۷۶۰,۰۰۰     | (۳۳۷,۶۳۴,۲۰۸)     | (۱,۸۵۱,۳۶۰)   | (۳۸۹,۷۶۰)     | ۵۹,۸۹۴,۶۷۲     |
| صنایع پتروشیمی خلیج فارس           | ۱,۸۶۷,۵۷۴  | ۹,۵۶۲,۸۹۵,۰۶۹   | (۶,۹۶۲,۷۲۲,۴۶۵)   | (۴۵,۴۲۸,۴۹۲)  | (۱,۸۸۴,۸۹۴)   | ۲,۵۳۶,۸۴۹,۲۱۸  |
| صنایع خاک چینی ایران               | ۱۰۰,۰۰۰    | ۱,۲۲۱,۹۰۰,۸۴۰   | (۱,۰۳۰,۳۱۶,۵۴۱)   | (۵,۸۰۴,۰۲۹)   | (۱,۲۲۱,۹۰۲)   | ۱۸۴,۶۵۸,۳۶۸    |
| عمران توسعه فارس                   | ۱۵۰,۰۰۰    | ۲۶۴,۵۰۵,۹۶۸     | (۳۰۸,۴۱۲,۰۵۶)     | (۱,۲۵۶,۴۰۲)   | (۲۶۴,۵۰۶)     | (۴۵,۴۳۶,۹۹۶)   |
| فولاد خوزستان                      | ۲۷۰,۰۰۰    | ۲,۶۸۲,۳۸۰,۷۳۰   | (۲,۶۲۵,۵۰۶,۸۴۳)   | (۱۲,۷۴۶,۰۶۳)  | (۲,۶۸۲,۳۸۰)   | ۴۲,۴۴۴,۴۴۴     |
| فولاد کاوه جنوب کیش                | ۱,۱۵۰,۰۰۰  | ۴,۲۹۲,۹۷۳,۹۰۲   | (۴,۸۳۴,۳۵۸,۵۲۸)   | (۲,۳۹۶,۳۶۷)   | (۸,۵۲۹,۵۷۴)   | ۱,۴۴۰,۶۷۹,۴۳۳  |
| فولاد مبارکه اصفهان                | ۱,۷۰۰,۰۰۰  | ۸,۷۹۰,۱۵۰,۳۰۳   | (۴,۸۹۵,۳۹۹,۸۹۹)   | (۴۱,۷۵۳,۲۰۹)  | (۱۶,۳۲۰,۷۲۹)  | ۳,۸۳۶,۶۷۶,۶۶۶  |
| کمیاب سازی ایران                   | ۵۰۰,۰۰۰    | ۳۳۸,۶۴۳,۷۶۱     | (۴۱۰,۹۵۳,۷۵۱)     | (۱,۶۰۸,۵۵۳)   | (۱,۶۹۳,۳۱۸)   | (۷۵,۶۱۱,۷۷۱)   |
| کوبیر تایر                         | ۸۵۰,۱۱۲    | ۳,۸۸۴,۶۷۸,۲۸۶   | (۳,۳۳۱,۸۸۹,۹۷۳)   | (۱۸,۴۵۲,۲۲۵)  | (۳,۸۸۴,۶۷۹)   | ۵۳۰,۴۵۱,۴۰۹    |
| گروه مینا (سهامی عام)              | ۲۵۰,۰۰۰    | ۱,۴۹۳,۶۴۴,۵۱۲   | (۸۷۳,۰۳۹,۱۶۲)     | (۷,۰۹۴,۹۰۶)   | (۱,۴۹۳,۶۴۴)   | ۶۱۲,۰۴۶,۷۸۰    |
| گروه بهمن                          | ۱          | ۱               | (۱,۰۴۷)           |               |               | (۱,۰۴۶)        |
| گروه صنعتی سپاهان                  | ۴۰,۰۰۰     | ۲۰۸,۴۴۰,۰۰۰     | (۲۰۴,۹۴۶,۵۶۰)     | (۹۹۰,۰۸۹)     | (۲۰۸,۴۴۰)     | ۲,۲۹۴,۹۱۱      |
| گلناتش                             | ۱۳۴,۰۰۰    | ۱,۱۸۳,۷۷۷,۸۵۰   | (۷۴۰,۶۲۰,۲۰۶)     | (۵,۶۲۲,۷۵۳)   | (۱,۱۸۳,۷۳۹)   | ۴۳۶,۳۱۱,۱۵۲    |
| لبنیات پاک                         | ۱۰۰,۰۰۰    | ۱۶۰,۰۰۹,۰۰۰     | (۱۵۶,۳۳۳,۵۷۶)     | (۷۶۰,۰۴۳)     | (۱۶۰,۰۰۹)     | ۲,۷۵۵,۳۷۲      |
| مارگارین                           | ۱۵۰,۰۰۰    | ۳۵۲,۹۵۰,۰۰۰     | (۳۱۸,۷۲۲,۰۴۶)     | (۱,۶۷۶,۵۱۳)   | (۳۵۲,۹۵۰)     | ۳۲,۱۹۸,۴۹۱     |
| مخابرات ایران                      | ۶۰۰,۰۰۰    | ۱,۱۰۹,۷۴۲,۰۹۲   | (۱,۳۴۲,۷۷۹,۰۱۰)   | (۵,۳۷۱,۳۷۱)   | (۳,۲۷۷,۸۳۸)   | (۲۴۱,۵۸۶,۰۳۷)  |
| معدنی املاح ایران                  | ۳۲,۵۰۰     | ۸۱۲,۴۱۲,۵۰۰     | (۷۲۴,۲۸۵,۱۶۲)     | (۳,۹۰۶,۴۶۰)   | (۸۱۲,۴۱۳)     | ۹۳,۳۹۸,۴۶۵     |
| معدنی کیمیای زنجان گستران          | ۱۴۹,۰۲۸    | ۱,۳۶۶,۰۷۵,۵۹۶   | (۱,۰۹۷,۵۱۴,۹۵۲)   | (۶,۴۸۸,۸۵۹)   | (۲,۶۸۱,۹۵۵)   | ۲۵۹,۳۸۹,۸۳۰    |
| معدنی و صنعتی گل گهر               | ۳۵۶,۳۳۹    | ۲,۸۸۲,۰۶۰,۶۵۵   | (۱,۱۷۰,۸۱۳,۹۹۷)   | (۱۳,۶۸۹,۷۹۱)  | (۲,۸۸۲,۰۶۲)   | ۱,۶۹۴,۶۰۴,۸۰۵  |
| ملی سرب‌روی ایران                  | ۲۵۸,۹۳۱    | ۱,۳۷۸,۹۸۲,۴۹۳   | (۸۱۲,۳۹۵,۵۴۸)     | (۶,۵۵۰,۱۶۴)   | (۱,۳۷۸,۹۸۳)   | ۵۵۸,۷۵۷,۷۹۸    |
| ملی صنایع مس ایران                 | ۲۶۵۰,۰۰۰   | ۹,۵۲۱,۲۶۸,۶۴۷   | (۷,۱۳۲,۵۴۲,۲۱۶)   | (۴۵,۲۲۶,۰۲۱)  | (۱۶,۹۸۷,۳۳۲)  | ۲,۳۲۶,۵۱۳,۰۷۸  |
| ملی کشت و صنعت و دامپروری پارس     | ۲۶,۰۰۰     | ۱۹۷,۷۳۳,۲۷۰     | (۲۰۱,۸۹۹,۴۹۳)     | (۹۳۹,۲۳۴)     | (۱۹۷,۷۳۴)     | (۵,۳۰۳,۱۹۱)    |
| نفت سپاهان                         | ۱۶۳,۳۷۷    | ۳,۹۵۳,۴۳۰,۴۲۸   | (۴,۱۶۸,۸۷۳,۰۸۵)   | (۱۸,۷۷۸,۷۹۶)  | (۸,۵۰۶,۷۱۶)   | (۲۴۲,۷۲۸,۱۵۹)  |
| نیروکلر                            | ۵۰,۰۰۰     | ۲۳۰,۵۰۰,۰۰۰     | (۲۴۱,۲۵۸,۰۴۱)     | (۱,۰۴۷,۳۷۳)   | (۱,۱۰۲,۵۰۰)   | (۲۲,۹۰۷,۹۱۴)   |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه       | ۱۵۰,۰۰۰    | ۴۸۰,۰۰۳,۷۴۰     | (۳۳۸,۸۴۰,۶۴۰)     | (۲,۲۸۰,۰۲۰)   | (۴۸۰,۰۰۴)     | ۱۲۸,۴۰۳,۰۷۶    |
| تعدیلات ناشی از سقف کارمزد کارگزار |            |                 |                   |               |               | ۴۴۴,۳۳۷,۸۱۹    |
| جمع                                | ۲۷,۶۱۴,۸۸۱ | ۱۵۳,۶۲۲,۰۸۲,۷۷۱ | (۱۱۲,۸۶۸,۵۸۸,۴۳۹) | (۷۲۹,۷۹۹,۷۴۳) | (۲۴۰,۴۴۹,۱۹۶) | ۴۰,۲۴۷,۵۸۳,۲۱۲ |

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون دوره مالی سالانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

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

| سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری (ریال) | تعداد     | ارزش بازار     | ارزش دفتری       | کارمزد        | مالیات       | سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری |
|---------------------------------------|-----------|----------------|------------------|---------------|--------------|--------------------------------|
| ایران ترانسفو                         | ۱۹۷,۴۰۰   | ۱,۱۶۳,۳۷۸,۲۰۰  | (۱,۵۹۴,۵۲۶,۴۳۲)  | (۵,۵۲۵,۵۷۱)   | (۱,۱۶۳,۳۷۸)  | (۳۳۷,۳۳۷,۰۸۱)                  |
| ایران یاساتایرورابر                   | ۱۸۴,۱۰۹   | ۵۵۸,۹۵۴,۹۳۴    | (۵۳۱,۰۸۹,۶۰۱)    | (۲,۶۵۵,۰۳۶)   | (۵۵۸,۹۵۵)    | ۲۴,۶۵۱,۳۳۲                     |
| آسان پرداخت پرشین                     | ۴۳۰,۰۰۰   | ۴,۹۰۰,۷۱۰,۰۰۰  | (۴,۸۹۳,۴۴۶,۹۶۶)  | (۲۳,۳۷۸,۳۷۳)  | (۴,۹۰۰,۷۱۰)  | (۲۰,۹۱۶,۰۴۹)                   |
| باما                                  | ۲۶۰,۰۰۰   | ۲,۳۹۱,۷۴۰,۰۰۰  | (۱,۸۶۱,۵۴۴,۴۸۸)  | (۱۱,۳۶۰,۷۶۵)  | (۲,۳۹۱,۷۴۰)  | ۵۱۶,۴۴۳,۰۰۷                    |
| بانک تجارت                            | ۲,۵۴۴,۰۲۱ | ۴,۳۳۲,۲۵۰,۹۴۴  | (۳,۶۸۷,۲۶۱,۰۸۹)  | (۲۰,۱۰۷,۹۴۲)  | (۴,۳۳۲,۲۵۱)  | ۵۲۱,۶۴۸,۶۶۲                    |
| بانک ملت                              | ۳۰۰,۰۰۰   | ۷۰۲,۰۰۰,۰۰۰    | (۷۵۸,۱۸۶,۲۱۸)    | (۳,۳۳۴,۵۰۰)   | (۷۰۲,۰۰۰)    | (۶۰,۳۳۲,۷۱۸)                   |
| پارس دارو                             | ۱۰۳,۰۰۰   | ۷۹۶,۶۰۳,۰۰۰    | (۵۲۳,۰۲۴,۹۴۱)    | (۳,۷۸۳,۸۶۰)   | (۷۹۶,۶۰۳)    | ۲۶۹,۹۹۶,۵۹۷                    |
| پارس مینو                             | ۱۵۱,۳۹۴   | ۴۲۵,۷۱۱,۹۳۲    | (۴۲۳,۱۳۵,۱۱۲)    | (۲,۰۶۹,۶۳۲)   | (۴۲۵,۷۱۲)    | ۱۰,۰۷۱,۴۷۶                     |
| پالایش نفت اصفهان                     | ۱۶۲,۱۶۹   | ۱,۳۱۶,۹۷۴,۴۴۹  | (۷۹۶,۶۰۵,۹۶۱)    | (۶,۲۵۵,۶۲۹)   | (۱,۳۱۶,۹۷۴)  | ۵۱۲,۷۹۵,۸۸۵                    |
| پالایش نفت بندرعباس                   | ۵۰,۰۰۰    | ۵۴۸,۱۰۰,۰۰۰    | (۶۶۲,۳۶۰,۷۹۱)    | (۲۶۰,۳۰۴,۷۵۵) | (۵۴۸,۱۰۰)    | (۱۱۷,۴۱۳,۳۶۶)                  |
| پالایش نفت تبریز                      | ۲۰,۰۰۰    | ۳۱۴,۲۴۰,۰۰۰    | (۳۲۶,۴۸۷,۹۱۰)    | (۱,۴۹۲,۶۴۰)   | (۳۱۴,۲۴۰)    | (۱۴۰,۵۴۰,۱۹۰)                  |
| پالایش نفت تهران                      | ۴۰۰,۱۸۳   | ۲,۰۵۸,۱۴۱,۱۶۹  | (۱,۳۱۰,۰۹۹,۳۳۸)  | (۹,۷۷۶,۱۷۱)   | (۲,۰۵۸,۱۴۱)  | ۷۳۶,۲۰۷۶۱۹                     |
| پالایش نفت شیراز                      | ۷۰,۰۰۰    | ۱,۷۷۱,۹۸۰,۰۰۰  | (۲,۱۱۱,۸۲۸,۷۹۱)  | (۸,۴۱۶,۹۰۵)   | (۱,۷۷۱,۹۸۰)  | (۲۵۰,۰۳۷,۶۷۶)                  |
| پتروشیمی پارس                         | ۱۹۰,۰۰۰   | ۵,۹۲۴,۲۰۰,۰۰۰  | (۵,۸۴۶,۷۰۳,۵۰۷)  | (۲۸,۱۳۹,۹۵۰)  | (۵,۹۲۴,۲۰۰)  | ۴۳,۴۳۲,۳۳۳                     |
| پتروشیمی پردیس                        | ۵۵,۴۵۳    | ۶۵۳,۸۴۶,۳۳۳    | (۴۴۵,۷۷۸,۳۳۳)    | (۳,۱۰۵,۷۷۰)   | (۶۵۳,۸۴۶)    | ۲۰۴,۴۰۸,۳۸۴                    |
| پتروشیمی غدیر                         | ۵۵,۰۰۰    | ۳۷۹,۴۰۰,۰۰۰    | (۳۳۱,۳۵۵,۷۹۵)    | (۱,۳۳۷,۱۵۰)   | (۳۷۹,۴۰۰)    | (۴۳,۵۷۲,۳۳۵)                   |
| پتروشیمی مبین                         | ۹۰۰,۰۰۰   | ۵,۹۴۶,۳۰۰,۰۰۰  | (۴,۱۲۰,۱۳۳,۱۷۵)  | (۲۸,۲۴۴,۹۲۵)  | (۵,۹۴۶,۳۰۰)  | ۱,۷۹۱,۹۷۵,۶۰۰                  |
| تراکتورسازی ایران                     | ۱,۳۱۳,۱۹۷ | ۴,۷۸۳,۹۷۶,۶۷۱  | (۳,۴۱۸,۷۳۴,۰۶۱)  | (۲۲,۷۳۳,۸۱۹)  | (۴,۷۸۳,۹۷۷)  | ۱,۳۳۷,۷۳۴,۷۴۴                  |
| توسعه خدمات دریایی و بندری سینا       | ۳۰۷,۴۵۹   | ۲,۷۴۷,۲۰۲,۵۵۷  | (۳,۵۹۴,۴۴۳,۰۸۰)  | (۱۳,۱۷۷,۴۶۲)  | (۲,۷۴۷,۲۰۳)  | (۸۳۶,۱۹۲,۱۸۸)                  |
| توسعه معدنی و صنعتی صابون             | ۱۵۰,۰۰۰   | ۶۶۰,۳۰۰,۰۰۰    | (۶۵۲,۷۸۹,۹۲۸)    | (۳,۱۳۶,۴۲۵)   | (۶۶۰,۳۰۰)    | ۳,۷۱۳,۳۴۷                      |
| توسعه معادن و فلزات                   | ۳۶۶,۳۷۵   | ۱,۴۵۷,۴۰۱,۹۵۰  | (۶۲۰,۷۱۹,۶۳۷)    | (۶,۹۲۰,۹۴۹)   | (۱,۴۵۷,۴۰۲)  | ۸۳۷,۹۴۴,۳۳۲                    |
| توکاریل                               | ۶۰۰,۰۰۰   | ۱,۶۷۹,۴۰۰,۰۰۰  | (۱,۴۵۳,۰۶۶,۲۷۸)  | (۷,۹۷۷,۱۵۰)   | (۱,۶۷۹,۴۰۰)  | ۲۱۶,۶۷۷,۱۷۲                    |
| تولیدی چدن سازان                      | ۴۹۰,۰۰۰   | ۲,۱۹۶,۱۸۰,۰۰۰  | (۲,۰۳۴,۵۶۲,۷۹۸)  | (۱۰,۴۳۱,۸۵۵)  | (۲,۱۹۶,۱۸۰)  | ۱۴۸,۹۸۹,۱۶۷                    |
| تولیدی و خدمات صنایع نسوز توکا        | ۱,۱۹۴,۴۸۷ | ۹,۳۴۵,۶۶۶,۲۸۸  | (۵,۶۴۶,۱۰۳,۸۰۴)  | (۴۴,۳۹۱,۹۱۵)  | (۹,۳۴۵,۶۶۶)  | ۳,۶۵۵,۸۲۴,۹۰۳                  |
| داده گستر عصر نوین-های وب             | ۱,۹۰۰,۰۰۰ | ۱۱,۶۲۰,۴۰۰,۰۰۰ | (۱۱,۷۲۰,۱۳۰,۲۴۰) | (۵۵,۱۹۶,۹۰۰)  | (۱۱,۶۲۰,۴۰۰) | (۱۶۶,۵۴۷,۵۴۰)                  |
| داروسازی فارابی                       | ۱۵۹,۰۰۰   | ۱,۱۳۱,۲۸۵,۰۰۰  | (۱,۱۳۲,۹۱۲,۴۴۶)  | (۵,۳۷۳,۶۰۴)   | (۱,۱۳۱,۲۸۵)  | (۸,۱۳۲,۳۲۵)                    |
| داروسازی کاسپین تامین                 | ۲۰,۰۰۰    | ۳۶۵,۲۶۰,۰۰۰    | (۳۵۱,۱۵۶,۱۴۵)    | (۱,۷۳۴,۹۸۵)   | (۳۶۵,۲۶۰)    | ۱۲,۰۰۳,۶۱۰                     |
| دارویی رازک                           | ۶۰,۰۰۰    | ۶۷۰,۰۸۰,۰۰۰    | (۶۹۷,۶۱۹,۰۰۴)    | (۳,۱۸۲,۸۸۰)   | (۶۷۰,۰۸۰)    | (۳۱,۳۹۱,۹۶۴)                   |
| ریل پرداز سیر                         | ۱۰۰,۰۰۰   | ۱۳۶,۲۰۰,۰۰۰    | (۱۱۶,۸۲۲,۷۳۴)    | (۵۹۹,۴۵۰)     | (۱۲۶,۲۰۰)    | ۸,۶۵۱,۶۱۶                      |
| س. نفت و گاز و پتروشیمی تأمین         | ۶۰۰,۰۰۰   | ۱,۱۴۴,۸۰۰,۰۰۰  | (۱,۳۳۶,۰۹۹,۶۹۰)  | (۵,۴۳۷,۸۰۰)   | (۱,۱۴۴,۸۰۰)  | (۱۹۷,۸۸۲,۳۹۰)                  |
| سرمایه گذاری مسکن الوند               | ۲۰۰,۰۰۰   | ۳۹۹,۸۰۰,۰۰۰    | (۲۸۲,۷۵۵,۹۸۸)    | (۱,۸۹۹,۰۵۰)   | (۳۹۹,۸۰۰)    | ۱۱۴,۷۴۵,۱۶۲                    |
| سرمایه گذاری مسکن تهران               | ۳۰۰,۰۰۰   | ۳,۵۰۱,۰۰۰,۰۰۰  | (۳,۳۷۸,۵۴۸,۷۸۶)  | (۱۶,۶۲۹,۷۵۰)  | (۳,۵۰۱,۰۰۰)  | ۱۰۲,۳۲۰,۴۶۴                    |
| سرمایه گذاری صندوق بازنشستگی          | ۱,۴۹۰,۰۰۰ | ۳,۰۴۵,۵۶۰,۰۰۰  | (۲,۶۳۸,۳۳۷,۶۹۱)  | (۱۴,۴۶۶,۴۱۰)  | (۳,۰۴۵,۵۶۰)  | ۳۸۹,۷۱۰,۳۳۹                    |
| سرمایه گذاری غدیر (هلدینگ)            | ۴۷۱,۸۲۳   | ۸۰۶,۳۴۵,۵۰۷    | (۶۳۸,۶۹۳,۴۶۶)    | (۳,۸۱۳,۰۱۴۱)  | (۸۰۶,۳۴۶)    | ۱۶۳,۰۱۵,۵۵۴                    |
| سیمان داراب                           | ۱,۵۵۰,۰۰۰ | ۲,۴۰۴,۰۵۰,۰۰۰  | (۲,۴۳۰,۹۵۷,۶۳۰)  | (۱۱,۴۱۹,۱۳۸)  | (۲,۴۰۴,۰۵۰)  | (۴۰,۷۳۰,۹۰۸)                   |
| سیمان فارس نو                         | ۱۰,۷۹,۲۴۰ | ۸,۶۱۸,۸۱۰,۶۴۰  | (۶,۳۰۷,۳۱۲,۶۰۲)  | (۴۰,۹۳۹,۳۵۱)  | (۸,۶۱۸,۸۱۱)  | ۲,۲۶۲,۰۳۹,۸۷۶                  |
| سیمان کردستان                         | ۹۲۲,۹۹۹   | ۱۰,۲۰۸,۳۶۸,۹۴۴ | (۱,۱۸۴,۶۹۵,۹۵۳)  | (۴,۸۴۸,۹۷۵)   | (۱۰,۲۰۸,۳۶۷) | (۱۶۹,۷۲۸,۸۷۱)                  |
| سیمان هرمزگان                         | ۳۰۳,۴۵۲   | ۲,۰۶۴,۰۸۰,۵۰۴  | (۲,۷۰۰,۷۶۶,۰۷۶)  | (۹,۸۰۴,۳۸۲)   | (۲,۰۶۴,۰۸۱)  | (۶۴۸,۵۵۴,۰۳۵)                  |
| شرکت آهن و فولاد ارفع                 | ۴۰۲,۷۴۰   | ۳,۷۷۳,۶۷۰,۳۸۰  | (۱,۱۵۲,۶۴۴,۴۸۶)  | (۱۳,۱۷۴,۹۳۴)  | (۳,۷۷۳,۶۷۰)  | ۱,۶۰۵,۰۷۷,۷۹۰                  |
| شیر پاسنوریزه پگاه گلپایگان           | ۱۰۰,۰۰۰   | ۱,۱۴۰,۷۰۰,۰۰۰  | (۱,۰۹۲,۰۸۰,۶۹۴)  | (۵,۴۱۸,۳۲۵)   | (۱,۱۴۰,۷۰۰)  | ۴۲,۰۶۰,۲۸۱                     |
| شیمی دارویی داروپخش                   | ۲۰۰,۰۰۰   | ۷۶۵,۴۰۰,۰۰۰    | (۸۱۹,۶۰۸,۷۱۹)    | (۳,۶۲۵,۶۵۰)   | (۷۶۵,۴۰۰)    | (۱۲۸,۶۰۹,۷۶۹)                  |
| صنایع بهداشتی ساین                    | ۱۰۰,۰۰۰   | ۷۶۸,۰۰۰,۰۰۰    | (۷۳۴,۷۶۹,۱۰۴)    | (۳,۶۵۲,۳۷۵)   | (۷۶۸,۰۰۰)    | ۳۹,۷۰۹,۷۲۱                     |
| صنایع پتروشیمی خلیج فارس              | ۶۱۸,۹۲۶   | ۲,۳۴۲,۰۱۵,۹۸۴  | (۱,۸۴۴,۳۶۷,۹۳۶)  | (۱۱,۱۲۴,۵۷۶)  | (۲,۳۴۲,۰۱۶)  | ۴۸۴,۱۸۱,۴۵۶                    |
| صنایع خاک چینی ایران                  | ۶۵۱,۹۰۰   | ۱۰,۲۶۱,۵۵۷,۹۰۰ | (۹,۰۱۱,۴۶۹,۷۰۹)  | (۴۸,۱۴۴,۴۰۰)  | (۱۰,۲۶۱,۵۵۸) | ۱,۱۹۱,۰۸۴,۳۳۳                  |
| صنعتی بهشهر                           | ۱,۵۹۰,۰۰۰ | ۵,۰۱۰,۰۹۰,۰۰۰  | (۴,۷۸۲,۱۹۳,۳۷۹)  | (۲۳,۷۹۷,۹۲۸)  | (۵,۰۱۰,۰۹۰)  | ۱۹۹,۰۸۸,۶۰۳                    |

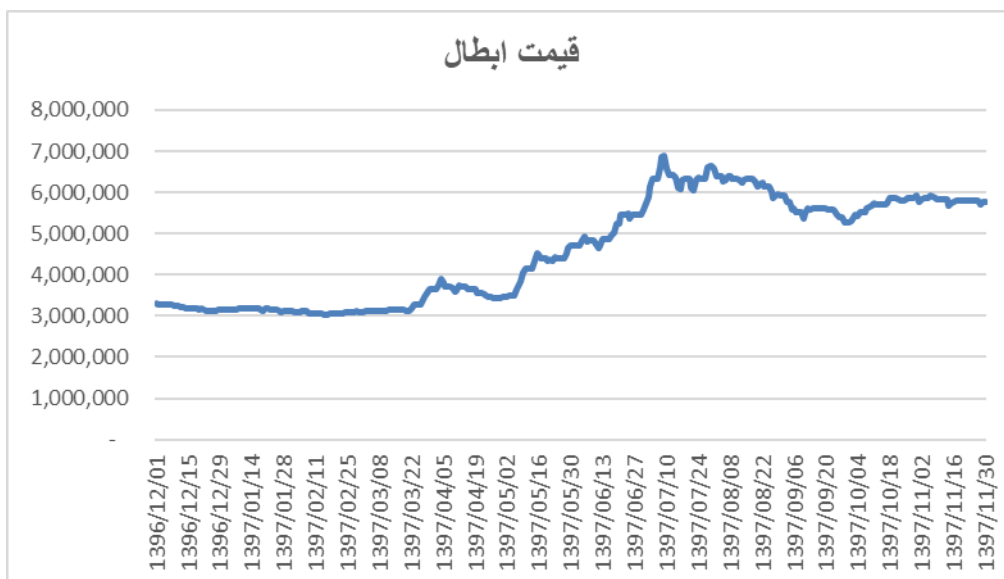
## گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون دوره مالی سالیانه منتهی به ۱۳۹۷/۱۱/۳۰

|                               |                   |                        |                          |                      |                      |                       |
|-------------------------------|-------------------|------------------------|--------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| عمران و توسعه فارس            | ۱۶۰۵۰۷۷           | ۲,۵۵۲,۰۷۲,۴۳۰          | (۳,۳۰۰,۱۶۷,۳۴۶)          | (۱۲,۱۲۲,۳۴۴)         | (۲,۵۵۲,۰۷۲)          | (۷۶۲,۷۶۹,۳۱۲)         |
| فولاد خوزستان                 | ۲۷۰,۰۰۰           | ۲,۴۳۸,۶۴۰,۰۰۰          | (۲,۴۹۸,۳۸۶,۱۰۷)          | (۱۱,۵۸۳,۵۴۰)         | (۲,۴۳۸,۶۴۰)          | (۷۳,۷۶۸,۲۸۷)          |
| فولاد کاوه جنوب کیش           | ۷۵۰,۷۴۵           | ۲,۲۸۰,۷۶۳,۳۱۰          | (۱,۵۳۴,۴۱۹,۲۲۵)          | (۱۰,۸۳۳,۶۲۶)         | (۲,۲۸۰,۷۶۳)          | ۷۴۳,۲۲۹,۶۹۶           |
| فولاد مبارکه اصفهان           | ۱,۲۱۳,۳۳۳         | ۳,۴۲۱,۵۹۹,۰۶۰          | (۲,۰۱۵,۷۵۲,۹۰۱)          | (۱۶,۲۵۳,۵۹۶)         | (۳,۴۲۱,۵۹۹)          | ۱,۳۸۶,۱۷۱,۹۶۴         |
| کارخانجات تولیدی شهید قندی    | ۱,۱۸۰,۰۰۰         | ۳,۷۶۸,۹۲۰,۰۰۰          | (۴,۲۸۹,۰۵۳,۷۱۹)          | (۱۷,۹۰۲,۳۷۰)         | (۳,۷۶۸,۹۲۰)          | (۵۴۱,۸۰۵,۰۰۹)         |
| کاشی پارس                     | ۱۸۵,۳۳۱           | ۹۷۱,۳۱۹,۷۷۱            | (۹۳۶,۳۱۲,۳۵۳)            | (۴,۶۱۳,۷۶۹)          | (۹۷۱,۳۳۰)            | ۲۹,۵۱۲,۳۳۹            |
| کمیابین سازی ایران            | ۶۸۶,۶۷۲           | ۶۹۸,۳۴۵,۴۲۴            | (۵۶۴,۳۸۰,۸۶۵)            | (۳,۳۱۷,۱۴۱)          | (۶۹۸,۳۴۵)            | ۱۲۹,۹۴۹,۰۷۳           |
| کنترسازای ایران               | ۱                 | ۴۶,۵۶۷                 | (۴۶,۱۱۲)                 | (۲۲۱)                | (۴۷)                 | ۱۸۷                   |
| کویر تایر                     | ۱,۵۶۰,۷۳۸         | ۷,۸۱۷,۷۳۶,۶۴۲          | (۶۶۰۲۰,۶۵,۳۴۹)           | (۳۷,۱۳۴,۲۴۹)         | (۷,۸۱۷,۷۳۷)          | ۱,۱۷۰,۷۱۹,۴۰۷         |
| گروه صنایع کاغذ پارس          | ۵۰۴,۴۲۸           | ۳,۱۷۱,۲۱۵,۵۸۰          | (۳,۲۰۷,۶۸۵,۳۳۸)          | (۱۵,۵۳۸,۳۷۴)         | (۳,۲۷۱,۲۱۶)          | ۴۴,۷۲۰,۸۵۲            |
| گروه مینا (سهامی عام)         | ۱,۳۵۹,۳۱۰         | ۶,۹۸۵,۴۹۴,۰۹۰          | (۴,۷۴۶,۸۶۹,۰۴۳)          | (۳۳,۱۸۱,۰۹۷)         | (۶,۹۸۵,۴۹۴)          | ۲,۱۹۸,۴۵۸,۴۵۶         |
| گسترش نفت و گاز پارسیان       | ۶۴۴,۷۷۳           | ۲,۱۷۶,۰۸۸,۸۷۵          | (۱,۵۵۳,۴۲۷,۵۶۵)          | (۱۰,۳۳۶,۵۱۷)         | (۲,۱۷۶,۱۰۹)          | ۶۱۰,۱۵۸,۶۸۴           |
| گلنکاش                        | ۳۳۸,۷۲۴           | ۳,۱۸۱,۷۵۷,۷۷۶          | (۱,۹۳۳,۵۴۳,۵۱۳)          | (۱۵,۱۱۳,۳۴۹)         | (۳,۱۸۱,۷۵۸)          | ۱,۲۲۹,۹۱۹,۱۵۶         |
| لبنیات پاک                    | ۱,۳۵۶,۰۱۱         | ۲,۴۸۱,۵۰۰,۱۳۰          | (۲,۱۹۲,۷۵۶,۰۱۳)          | (۱۱,۷۸۷,۱۲۶)         | (۲,۴۸۱,۵۰۰)          | ۳۷۴,۴۷۵,۴۹۱           |
| مارگارین                      | ۱,۱۰۹,۶۷۳         | ۳,۵۶۶,۴۸۹,۰۲۲          | (۳,۳۰۳,۱۹۵,۸۳۴)          | (۱۶,۹۴۰,۸۳۳)         | (۳,۵۶۶,۴۸۹)          | ۲۴۲,۷۸۵,۸۷۶           |
| مخابرات ایران                 | ۴۸۵,۲۱۷           | ۱,۰۹۴,۱۶۴,۳۳۵          | (۱,۰۸۵,۸۹۸,۶۵۳)          | (۵,۱۹۷,۲۸۱)          | (۱,۰۹۴,۱۶۴)          | ۱,۹۷۴,۲۲۷             |
| معدنی کیمیای زنجان گستران     | ۴۵۱,۸۱۴           | ۴,۱۰۲,۹۲۲,۹۲۴          | (۳,۳۲۷,۱۵۵,۶۴۵)          | (۱۹,۴۸۸,۸۱۴)         | (۴,۱۰۲,۹۲۳)          | ۷۵۲,۱۷۵,۴۸۲           |
| معدنی و صنعتی گل گهر          | ۸۴۳,۶۷۱           | ۵,۵۸۵,۹۴۵,۶۹۱          | (۴,۴۷۷,۱۴۰,۵۴۴)          | (۲۶,۵۳۳,۲۴۲)         | (۵,۵۸۵,۹۴۶)          | ۱,۰۷۶,۶۸۵,۹۵۹         |
| ملی سرب‌وروی ایران            | ۱۹۱,۰۶۹           | ۱,۰۷۲,۲۷۹,۲۲۸          | (۵۹۹,۴۰۴,۸۵۲)            | (۵,۰۹۳,۳۲۶)          | (۱,۰۷۲,۲۷۹)          | ۴۶۶,۷۰۸,۷۷۱           |
| ملی صنایع مس ایران            | ۱,۲۶۰,۰۰۰         | ۳,۷۲۳,۳۰۰,۰۰۰          | (۳,۰۵۶,۹۲۲,۵۰۵)          | (۱۷,۶۸۵,۶۷۵)         | (۳,۷۲۳,۳۰۰)          | ۶۴۴,۹۶۸,۵۲۰           |
| ملی کشت و صنعت و دامپروی پارس | ۵۰۰,۰۰۰           | ۳,۹۱۳,۰۰۰,۰۰۰          | (۳,۸۱۲,۶۸۲,۵۶۷)          | (۱۸,۵۸۶,۷۵۰)         | (۳,۹۱۳,۰۰۰)          | ۷,۸۱۷,۶۸۳             |
| موتورزن                       | ۷۰,۰۰۰            | ۴۶۸,۷۲۰,۰۰۰            | (۴۵۴,۸۰۰,۵۲۸)            | (۲,۲۳۶,۴۲۰)          | (۴۶۸,۷۲۰)            | ۱۱,۲۳۴,۳۳۲            |
| نفت سپاهان                    | ۳۶,۶۳۳            | ۱,۰۰۰,۶۰۷,۴۳۳          | (۱,۱۹۱,۰۶۰,۷۵۷)          | (۴,۷۷۸,۸۳۵)          | (۱,۰۰۰,۶۰۷)          | (۱۹۰,۷۷۵,۳۳۹)         |
| هلدینگ صنایع معدنی خاورمیانه  | ۸۵۰,۰۰۰           | ۲,۸۹۴,۲۵۰,۰۰۰          | (۱,۹۷۶,۷۶۳,۶۳۳)          | (۱۳,۷۷۶,۶۸۸)         | (۲,۸۹۴,۲۵۰)          | ۹۰۰,۸۴۴,۴۳۹           |
| ح.هلدینگ صنایع معدن خاورمیانه | ۲۲۰,۵۳۸           | ۴۱۲,۴۰۶,۰۶۰            | (۳۹۱,۹۹۲,۳۱۲)            | (۱,۹۵۸,۹۲۹)          | (۴۱۲,۴۰۶)            | ۱۱۸,۰۴۲,۴۱۳           |
| ح. پارس دارو                  | ۲۲۹,۵۰۰           | ۱,۰۲۲,۴۲۲,۵۰۰          | (۹۳۳,۳۷۶,۵۰۰)            | (۴,۸۵۶,۵۰۷)          | (۱,۰۲۲,۴۲۳)          | ۸۳,۱۶۷,۰۷۰            |
| ح. فولاد کاوه جنوب کیش        | ۴۲۸,۹۹۷           | ۸۷۴,۲۹۵,۸۸۶            | (۳۴۹,۲۰۳,۵۵۸)            | (۴,۱۵۲,۹۰۵)          | (۸۷۴,۲۹۶)            | ۵۲۰,۰۶۵,۱۲۷           |
| ح. کاشی پارس                  | ۶۰,۹۹۶            | ۲۵۸,۶۸۴,۰۳۶            | (۲۴۷,۰۳۳,۸۰۰)            | (۱,۱۲۸,۷۴۹)          | (۲۵۸,۶۸۴)            | ۱۰,۱۶۲,۸۰۳            |
| <b>جمع</b>                    | <b>۴۴,۴۱۷,۴۶۸</b> | <b>۱۸۸,۹۱۳,۵۰۹,۹۹۶</b> | <b>(۱۶۲,۵۷۸,۲۴۷,۲۸۹)</b> | <b>(۸۹۷,۳۳۹,۱۷۶)</b> | <b>(۱۸۸,۹۱۳,۵۱۱)</b> | <b>۲۵,۲۴۹,۰۱۰,۰۲۰</b> |

## 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 سالیانه منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ مبلغ ۱۵۶,۹۳۲,۲۷۹,۳۰۴ ریال بوده است.





#### ۸. بازدهی صندوق:

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون از زمان ابتدا دوره ۱۳۹۶/۱۲/۰۱ تا پایان دوره مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

| شرح                                     | ۱۳۹۶/۱۲/۰۱ | ۱۳۹۷/۱۱/۳۰ | درصد بازدهی |
|-----------------------------------------|------------|------------|-------------|
| NAV صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون | ۳,۲۹۶,۸۴۵  | ۵,۷۷۵,۰۸۹  | ۷۵.۱۷٪      |
| شاخص کل بورس اوراق بهادار               | ۹۸,۱۵۷     | ۱۵۷,۳۸۷    | ۶۰.۳۴٪      |

#### 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.