

گزارش عملکرد صندوق سرمایه گذاری بانک توسعه تعاون

دوره مالی ۹ ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰

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 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 دادمان، خیابان فخار مقدم، نبش بوستان دوم غربی، پلاک ۲۲ طبقه ۴ 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. 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 دامن، خیابان فخر مقدم، نبش بوستان دوم غربی، پلاک ۲۲ طبقه ۴.

متولی صندوق، موسسه حسابرسی و خدمات مدیریت ارقام نگر آریا است که در تاریخ ۱۳۸۳/۱۱/۱۳ با شماره ثبت ۱۷۷۵۵ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارتست از تهران - میدان توحید - خیابان توحید، پلاک ۶۸

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 فراز مشاور، دیلمی پور است که در تاریخ ۱۳۶۷/۰۹/۱۰ با شماره ثبت ۳۴۹۱ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارتست از تهران - خ استاد مطهری نرسیده به لارستان پلاک ۴۴ 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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ تعداد ۹۸،۴۹۳ واحد بوده که این تعداد شامل ۹۷،۴۹۳ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

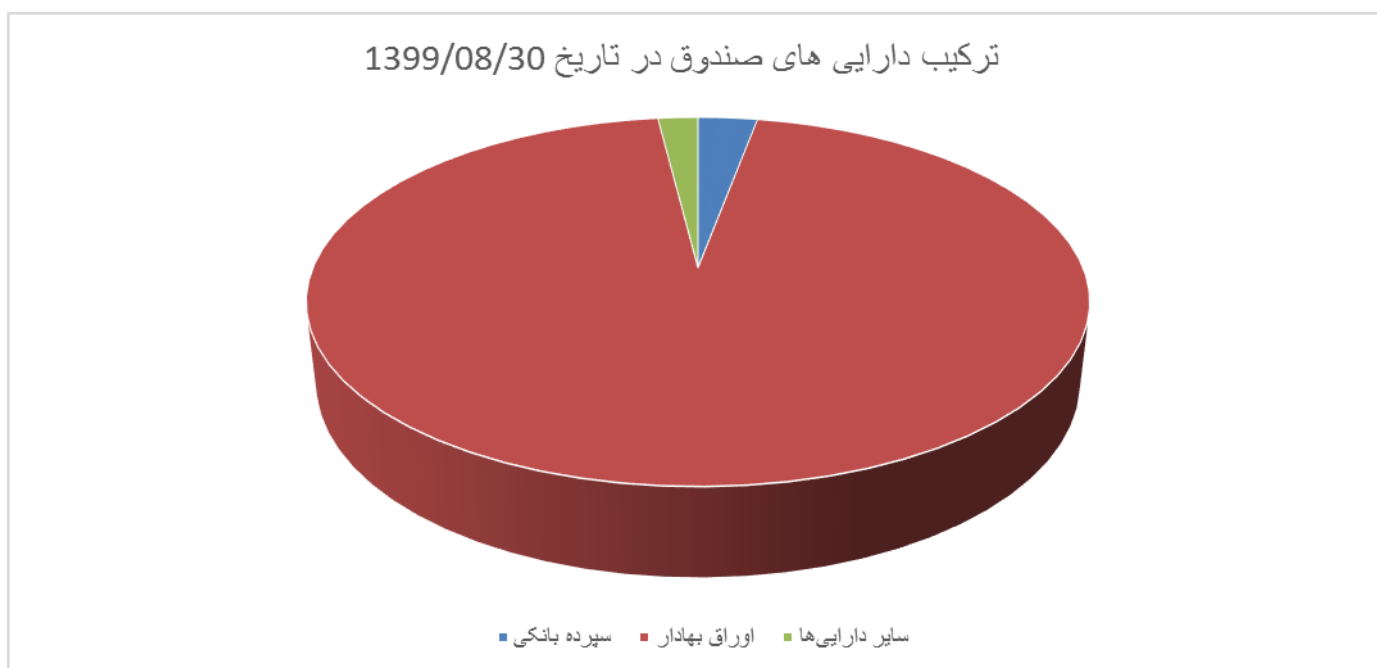
۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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 ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	
عنوان	(ریال)خالص ارزش فروش
سپرده بانکی	۱۶۲,۰۴۱,۸۱۳,۶۰۷
اوراق بهادار	۵,۲۷۲,۹۱۹,۰۹۹,۳۶۸
سایر دارایی‌ها	۱۰۹,۲۵۲,۰۸۴,۸۰۱

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



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

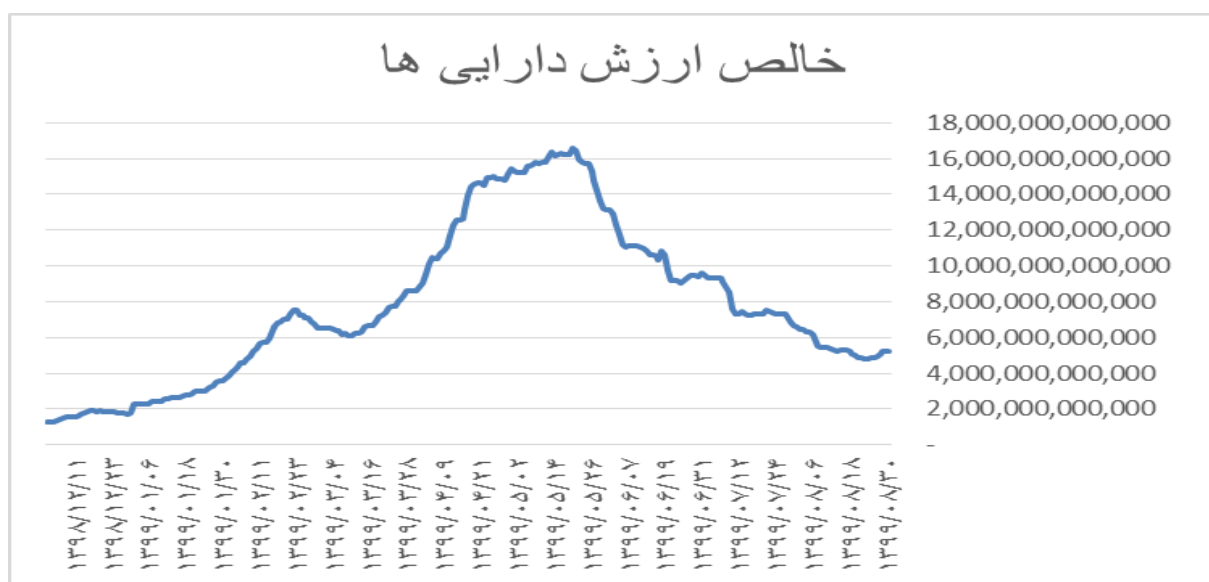
عنوان	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰
سود (زیان) حاصل از فروش سهام	۳,۵۳۴,۲۱۱,۳۴۴,۹۱۲	۵۲,۹۶۴,۹۵۰,۶۷۵	۱۰۶,۰۹۵,۹۱۰,۹۴۲
سود (زیان) حاصل از فروش حق تقدم	(۳,۵۴۶,۲۹۹,۹۵۰)	۱,۳۵۳,۷۲۸,۱۰۷	۷,۴۷۳,۰۶۲,۷۱۲
سود (زیان) ناشی از فروش اوراق مشارکت	-	(۹۱۰,۸۰۳)	(۹۱۰,۸۰۳)
سود (زیان) ناشی از اعمال اختیار معامله سهام	(۱,۸۹۷,۳۸۳,۱۴۴)	-	-
جمع	۳,۵۲۸,۷۶۷,۶۶۱,۸۱۸	۵۴,۳۱۷,۷۶۷,۹۷۹	۱۱۳,۵۶۸,۰۶۲,۸۵۱

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

عنوان	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	دوره مالی نه ماهه منتهی به ۱۳۹۸/۰۸/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۱/۳۰
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام و حق تقدم خرید سهام	۱,۲۴۱,۳۹۹,۵۶۴,۶۹۰	۱۳۸,۹۱۱,۸۱۶,۳۴۲	۴۶۴,۸۵۸,۱۷۱,۲۵۳
سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت	۱۷,۶۵۰,۰۶۶	۳,۲۸۴,۸۱۵	۱۲,۲۷۷,۹۹۱
جمع	۱,۲۴۱,۴۱۷,۲۱۴,۷۵۶	۱۳۸,۹۱۵,۱۰۱,۱۵۷	۴۶۴,۸۷۰,۴۴۹,۲۴۴

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 ۹ ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ مبلغ ۵,۲۴۳,۷۱۴,۱۵۰,۷۳۶ ریال بوده است.



۸. بازدهی صندوق:

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون از زمان ابتدا دوره ۱۳۹۸/۱۲/۰۱ تا پایان دوره مالی منتهی به تاریخ ۱۳۹۹/۰۸/۳۰ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

شرح	مقدار در ۱۳۹۸/۱۲/۰۱	مقدار در ۱۳۹۹/۰۸/۳۰	درصد بازدهی
NAV صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون	۲۱,۷۵۴,۹۵۵	۵۳,۲۳۹,۴۶۰	۱۲۷.۸۰٪
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۴۷۸,۷۵۶	۱,۳۶۶,۵۳۵	۹۱.۲۳٪

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.