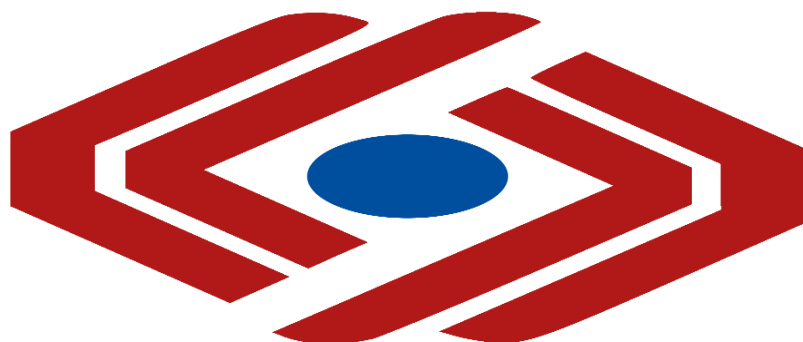




**صندوق سرمایه‌گذاری
بانک توسعه تعاون**

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون

سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

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 ۵۲ اساسنامه قابل تمدید است. در حال حاضر با استناد به مجمع مورخ ۱۴۰۰/۰۳/۰۱ و تایید سازمان بورس و اوراق بهادار تهران، مدت فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۱/۰۲/۳۱ 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 ۴ واقع شده است و صندوق دارای شعبه نمی‌باشد.

۲-۱. اطلاع‌رسانی

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

۲-۲. 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	۸۰,۰۰۰	۸۰
شرکت کارگزاری بانک رفاه کارگران	۲۰,۰۰۰	۲۰
جمع	۱۰۰,۰۰۰	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 ۴.

متولی صندوق: شرکت مشاور سرمایه‌گذاری ایرانیان تحلیل فارابی (سهامی خاص) است شرکت مذکور بر اساس تصمیم مجمع مورخ ۱۴۰۰/۰۲/۲۰ و مجوز شماره ۱۲۲/۸۴۸۲۶ مورخ ۱۴۰۰/۰۳/۳۰ سازمان بورس و اوراق بهادار انتخاب گردیده است، نشانی متولی عبارت است از: تهران، خیابان یوسف آباد- خیابان ابن سینا- خیابان نهم- پلاک ۶- طبقه سوم- واحد ۶.

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 نوین نگر 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 - خ شریعتی- خ وحید دستگردی- بعد از شمس تبریزی پلاک ۱۴۸- طبقه سوم- واحد 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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ تعداد ۵,۰۰۶,۵۲۱ واحد بوده که این تعداد شامل ۴,۹۰۶,۵۲۱ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱۰۰,۰۰۰ 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 دوره 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 ۱۴۰۰/۱۱/۳۰	
عنوان	خالص ارزش فروش (ریال)
سپرده بانکی	۳,۳۷۱,۶۹۹,۱۷۰
اوراق بهادار	۲,۲۴۲,۶۲۶,۰۴۷,۰۹۶
سایر دارایی‌ها	۵۵,۱۱۸,۶۴۲,۷۹۱

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



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

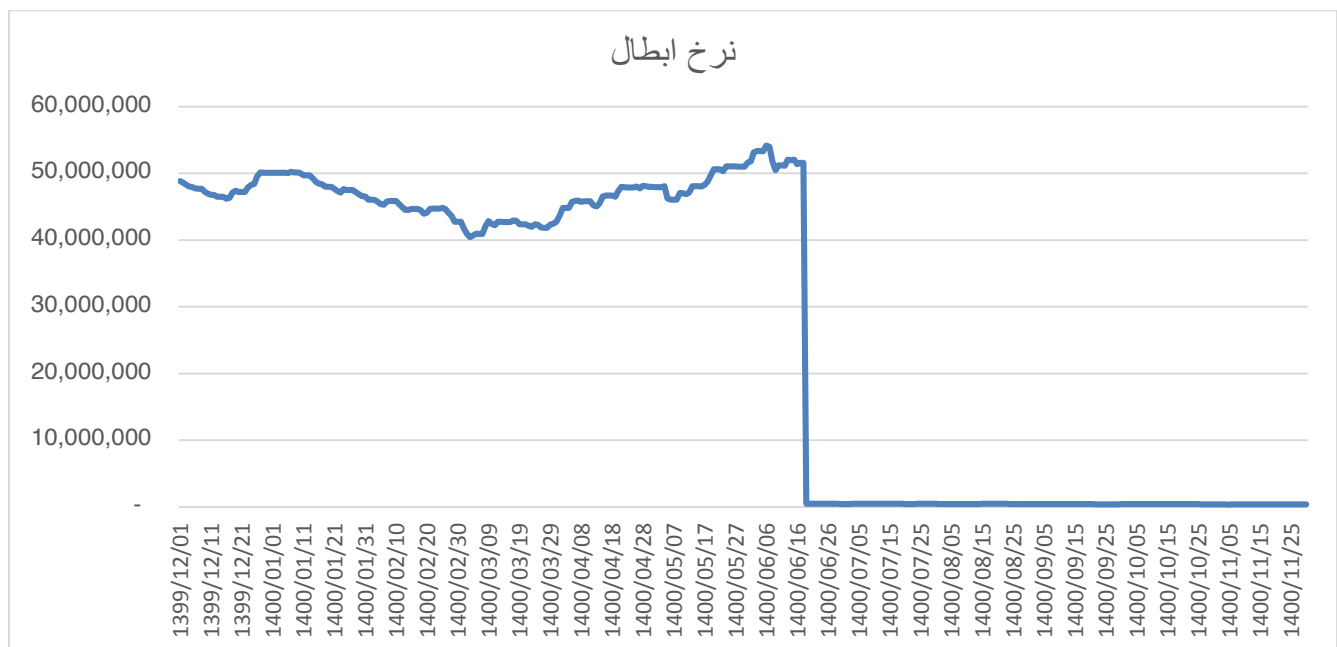
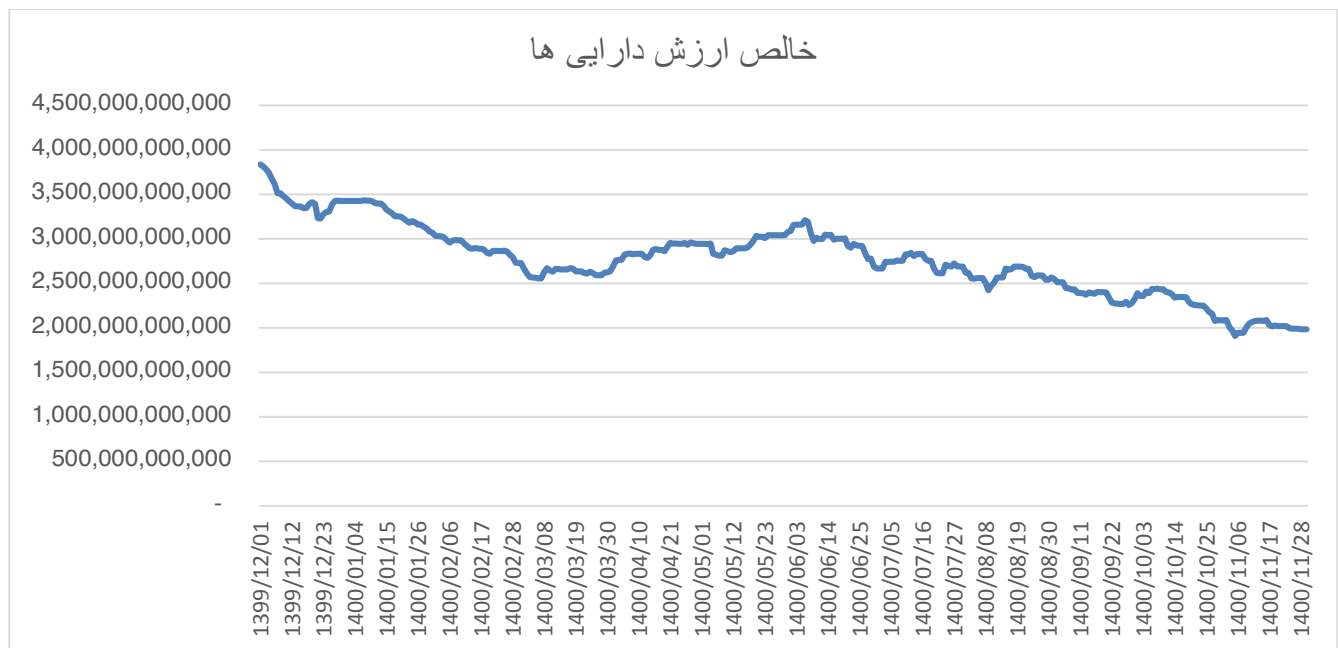
سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰	سود (زیان) حاصل از فروش اوراق بهادار
۳,۸۴۲,۳۶۶,۵۱۰,۱۸۸	(۲۳۳,۷۵۷,۶۴۹,۲۸۷)	سود (زیان) حاصل از فروش سهام
۳,۸۹۸,۲۸۱,۳۸۸	(۲۹,۷۶۴,۹۵۶,۵۳۲)	سود (زیان) حاصل از فروش حق تقدم
-	۵۴,۳۷۵	زیان حاصل از فروش اوراق مشارکت فرابورسی
۳,۸۴۶,۲۶۴,۷۹۱,۵۷۶	(۲۶۳,۵۲۲,۵۵۱,۴۴۴)	جمع

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

سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۱/۳۰	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰	سود تحقق نیافته نگهداری اوراق بهادار
۵۳۵,۷۸۲,۲۷۲,۱۵۵	(۲۶۲,۱۳۷,۲۶۰,۸۸۷)	سود (زیان) تحقق نیافته سهام بورسی یا فرابورسی
۳۵,۴۳۶,۶۴۶,۷۲۲	(۲۳,۶۲۵,۹۷۷,۴۸۶)	سود (زیان) تحقق نیافته حق تقدم سهام بورسی یا فرابورسی
۱۸,۱۵۰,۰۷۵	-	سود (زیان) تحقق نیافته اوراق مشارکت
۵۷۱,۲۳۷,۰۶۸,۹۵۲	(۲۸۵,۷۶۳,۲۳۸,۳۷۳)	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 سال مالی منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ مبلغ ۱،۹۸۴،۲۳۴،۵۰۱،۵۰۷ ریال بوده است.



گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون برای سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۱۱/۳۰

۸. بازدهی صندوق:

مقایسه بازدهی صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون از زمان ابتدا دوره ۱۳۹۹/۱۲/۰۱ تا پایان سال مالی منتهی به تاریخ ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

شرح	مقدار در ۱۳۹۹/۱۲/۰۱	مقدار در ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ تجزیه شده	مقدار در ۱۴۰۰/۱۱/۳۰ تجزیه نشده	درصد بازدهی
NAV صندوق سرمایه‌گذاری توسعه تعاون	۴۹,۲۰۰,۹۶۱	۳۹۶,۳۳۰	۳۹,۶۳۳,۰۰۰	(۱۹,۴۵)
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۱,۲۳۸,۳۵۷	—	۱,۲۸۲,۱۹۰	۴٪

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 می‌باشد.