

گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون

دوره مالی ۶ ماهه منتهی به ۱۳۹۶/۰۵/۳۱

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 شش ماه دیگر تا تاریخ ۱۳۹۶/۰۸/۱۹ 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 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 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 ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ تعداد ۱۴،۷۲۴ واحد بوده که این تعداد شامل ۱۳،۷۲۴ واحد سرمایه‌گذاری عادی و ۱،۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری ممتاز می‌باشد.

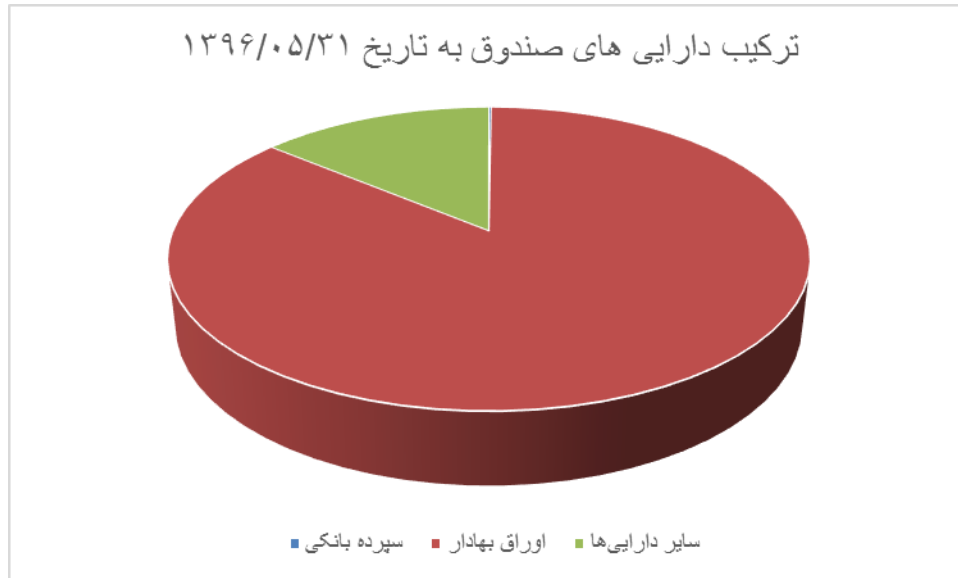
۴- وضعیت سرمایه‌گذاری‌ها در پایان دوره مالی

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 ۱۳۹۶/۰۵/۳۱	
عنوان	خالص ارزش فروش (ریال)
سپرده بانکی	۶۰،۳۳۱،۷۸۹
اوراق بهادار	۳۶،۹۸۷،۶۰۸،۷۲۹
سایر دارایی‌ها	۶،۰۲۵،۲۶۴،۱۷۳

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
۰.۰۲۱٪	۸,۰۰۸,۸۳۶	اوراق مشارکت گلگهر ۳ ماهه ۲۰٪
۰.۳۹٪	۱۴۸,۰۰۳,۰۶۴	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۶۱۳
۰.۳۷٪	۱۴۱,۹۶۸,۱۶۳	اسناد خزانه اسلامی ۹۶۰۷۰۳
۰.۷۸٪	۲۹۷,۹۸۰,۰۶۳	جمع

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

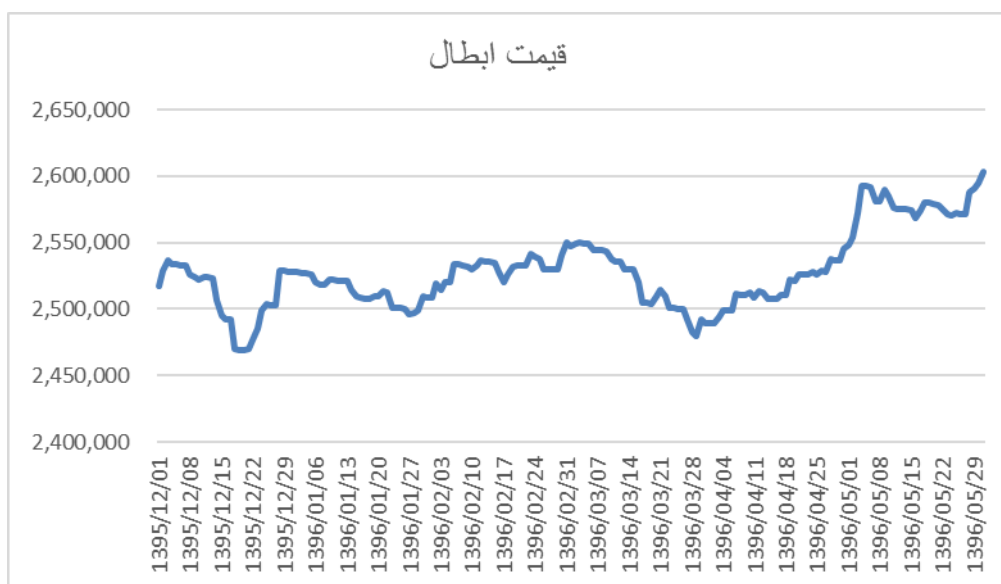
سود (زیان) حاصل از فروش سهام (ریال)	تعداد	بهای فروش	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) فروش
بهمن دیزل	۴۹,۳۰۰	۱۷۹,۹۴۵,۰۰۰	(۱۷۳,۱۹۶,۷۹۶)	(۹۱۹,۵۲۰)	(۸۹۹,۷۲۵)	۴,۹۲۸,۹۵۹
پاکسان	۸۰,۰۰۰	۵۴۱,۳۲۴,۴۶۸	(۴۵۷,۸۴۴,۳۶۷)	(۲,۸۶۳,۶۰۷)	(۲,۷۰۶,۶۲۲)	۷۷,۹۰۹,۸۷۲
پالایش نفت بندرعباس	۶۰,۰۰۰	۳۲۹,۱۶۶,۵۱۹	(۲۹۱,۵۶۸,۵۶۵)	(۱,۷۴۱,۲۹۱)	(۱,۶۴۵,۸۳۳)	۳۴,۲۱۰,۸۳۰
پتروشیمی جم	۴,۹۰۰	۳۸,۷۱۰,۰۰۰	(۴۶,۵۱۲,۳۱۲)	(۲۰۴,۷۷۶)	(۱۹۳,۵۵۰)	(۸,۲۰۰,۶۳۸)
پتروشیمی زاگرس	۷۰,۰۰۰	۱,۲۴۲,۷۹۰,۰۰۰	(۱,۳۳۳,۶۲۱,۵۱۴)	(۶,۳۵۰,۶۵۳)	(۶,۲۱۳,۹۵۰)	(۹۳,۳۹۶,۱۱۷)
پتروشیمی شازند	۲۹۰,۰۰۰	۷۶۴,۱۷۶,۶۱۲	(۸۰۳,۲۸۲,۳۳۶)	(۴,۰۴۲,۴۹۱)	(۳,۸۲۰,۸۷۶)	(۴۶,۹۶۸,۹۹۱)
پتروشیمی فجر	۲۴,۳۸۲	۱۴۶,۶۸۲,۰۰۱	(۱۴۵,۵۳۴,۷۱۹)	(۷۷۵,۹۴۶)	(۷۳۳,۴۱۰)	(۳۶۲,۰۷۴)
توسعه معادن و فلزات	۷۰۰,۰۰۰	۸۹۹,۶۰۶,۰۰۰	(۹۹۱,۳۹۲,۵۰۵)	(۴,۷۵۸,۹۱۸)	(۴,۴۹۸,۰۳۰)	(۱۰۱,۰۴۳,۴۵۳)
تولیدی کاشی تکسرام	۶۰,۰۰۰	۱۴۴,۰۳۰,۵۴۶	(۱۳۴,۲۶۹,۳۹۷)	(۷۶۱,۹۲۱)	(۷۲۰,۱۵۳)	۸,۲۷۹,۰۷۵
داروسازی جابر ابن حیان	۹,۵۸۸	۱۲۱,۸۱۱,۵۰۰	(۱۱۸,۹۷۷,۳۳۹)	(۶۴۴,۳۸۰)	(۶۰۹,۰۵۷)	۱,۵۸۰,۷۲۴
داروسازی کاسپین تامین	۵,۱۰۰	۸۷,۷۷۹,۸۰۰	(۸۷,۰۰۴,۷۹۸)	(۴۴۸,۵۵۶)	(۴۳۸,۸۹۹)	(۱۱۲,۴۵۳)
سرمایه گذاری دارویی تامین	۱۰,۱۶۰	۲۱۸,۴۵۱,۶۵۹	(۲۲۲,۰۲۷,۳۴۲)	(۱,۱۵۵,۶۱۲)	(۱,۰۹۲,۲۵۹)	(۵,۸۱۳,۵۵۴)
شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان	۲۹,۵۰۸	۳۹۵,۴۷۰,۷۰۶	(۴۲۳,۶۶۷,۴۶۷)	(۲,۰۲۰,۸۵۶)	(۱,۹۷۷,۳۵۲)	(۳۲,۱۹۴,۹۶۹)
صنایع خاک چینی ایران	۴۰,۰۰۰	۵۶۱,۵۴۵,۰۰۰	(۴۳۵,۹۸۷,۰۴۹)	(۲,۹۷۰,۵۷۵)	(۲,۸۰۷,۷۲۵)	۱۱۹,۷۷۹,۶۵۱
صنعتی بهشهر	۱	۲,۶۸۹	(۲,۵۴۱)	(۱۴)	(۱۳)	۱۲۰
فولاد خوزستان	۲۲۸,۵۸۵	۷۶۲,۱۹۹,۶۲۵	(۷۸۵,۹۳۲,۹۵۶)	(۴,۰۳۲,۰۳۸)	(۳,۸۱۰,۹۹۸)	(۳۱,۵۷۶,۳۶۷)
کارتن ایران	۱۵۵,۰۰۰	۶۰۴,۵۴۵,۳۳۰	(۵۲۵,۴۱۲,۲۹۷)	(۳,۱۹۸,۰۴۲)	(۳,۰۲۲,۷۲۷)	۷۲,۹۱۲,۱۶۴
گروه دارویی سبحان	۹,۰۰۰	۴۹,۹۴۱,۰۰۰	(۵۰,۴۹۵,۹۹۴)	(۲۶۴,۱۸۸)	(۲۴۹,۷۰۵)	(۱,۰۶۸,۸۷۷)
گروه مینا	۱۲,۰۰۰	۹۹,۹۳۶,۰۰۰	(۹۷,۶۱۴,۸۱۳)	(۵۲۸,۶۶۰)	(۴۹۹,۶۸۰)	۱,۲۹۲,۷۷۷
لیزینگ رایان سایپا	۲۳۰,۱۷۸	۳۹۳,۵۳۱,۵۸۴	(۳۳۵,۳۱۳,۴۶۶)	(۲,۰۸۱,۷۸۱)	(۱,۹۶۷,۶۵۷)	۶۴,۱۶۸,۶۸۰
مخابرات ایران	۱۰۰,۰۰۰	۱۹۱,۰۵۰,۷۴۴	(۲۲۴,۱۶۹,۳۱۳)	(۱,۰۱۰,۶۵۴)	(۹۵۵,۲۵۳)	(۳۵,۰۸۴,۴۷۶)
معدنی و صنعتی گل گهر	۱۱۰,۰۰۰	۷۳۹,۵۱۷,۵۴۴	(۶۸۷,۴۴۲,۷۸۲)	(۳,۹۱۲,۰۴۴)	(۳,۶۹۷,۵۸۸)	۴۴,۴۶۵,۱۳۰
جمع	۲,۲۷۷,۷۰۲	۸,۵۱۲,۲۱۴,۲۲۷	(۸,۳۵۱,۲۸۰,۶۳۸)	(۴۴,۶۸۶,۵۲۳)	(۴۲,۵۶۱,۰۶۲)	۷۳,۶۸۶,۰۰۳

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

سود (زیان) تحقق نیافته	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام و حق تقدم (ریال)	تعداد	ارزش بازار	ارزش دفتری	کارمزد	مالیات	سود (زیان) تحقق نیافته
۱۵۸,۷۹۷,۰۵۲		۲۳۰,۰۰۰	۱,۸۰۴,۸۱۰,۰۰۰	(۱,۶۲۷,۴۴۱,۴۵۳)	(۹,۵۴۷,۴۴۵)	(۹,۰۲۴,۰۵۰)	باما
-		۱,۸۰۰,۰۰۰	۱,۸۰۹,۰۰۰,۰۰۰	(۱,۷۹۰,۳۸۵,۳۹۰)	(۹,۵۶۹,۶۱۰)	(۹,۰۴۵,۰۰۰)	بانک صادرات ایران
(۴۰,۵۰۳,۶۷۶)		۲۰۰,۰۰۰	۱۷۹,۶۰۰,۰۰۰	(۲۱۸,۲۵۵,۵۹۲)	(۹۵۰,۰۸۴)	(۸۹۸,۰۰۰)	پارس خودرو
۸۰,۳۸۸,۲۶۰		۴۰۰,۰۰۰	۱,۱۵۵,۲۰۰,۰۰۰	(۱,۰۶۲,۹۲۴,۷۳۲)	(۶,۱۱۱,۰۰۸)	(۵,۷۷۶,۰۰۰)	پالایش نفت اصفهان
(۱۸,۱۷۱,۰۷۷)		۹۰,۰۰۰	۴۲۷,۵۴۰,۰۰۰	(۴۲۷,۳۵۲,۸۵۰)	(۲,۲۴۰,۵۲۷)	(۲,۱۱۷,۷۰۰)	پالایش نفت بندرعباس
(۳۳۴,۱۱۰,۳۰)		۱۲۰,۰۰۰	۶۴۰,۸۰۰,۰۰۰	(۹۵۸,۳۱۶,۳۹۸)	(۳,۳۸۹,۸۳۲)	(۳,۲۰۴,۰۰۰)	پتروشیمی پردیس
(۱۷۰,۹۲۴,۵۰۱)		۹۵,۱۰۰	۷۳۹,۴۰۲,۵۰۰	(۹۰۲,۷۱۸,۵۴۹)	(۳,۹۱۱,۴۳۹)	(۳,۶۹۷,۰۱۳)	پتروشیمی جم
(۳۷۵,۹۱۰,۶۶۲)		۱۲۱,۰۰۰	۱,۵۳۸,۷۵۷,۰۰۰	(۱,۸۹۸,۸۳۳,۸۵۲)	(۸,۱۴۰,۰۲۵)	(۷,۶۹۳,۷۸۵)	پتروشیمی خارک
(۶۸,۲۹۳,۴۷۰)		۲۰۰,۰۰۰	۴۳۴,۶۰۰,۰۰۰	(۴۹۸,۴۲۱,۴۳۶)	(۲,۲۹۹,۰۳۴)	(۲,۱۷۳,۰۰۰)	پتروشیمی شازند
(۱۶۹,۶۶۰,۵۲۱)		۵۱,۰۸۰	۹۲۷,۶۶۳,۸۰۰	(۱,۰۸۷,۷۷۸,۷۴۰)	(۴,۹۰۷,۳۴۲)	(۴,۶۳۸,۳۱۹)	پتروشیمی فناوران
(۳۸۶,۴۷۰,۱۸۷)		۱,۰۵۰,۰۰۰	۳,۷۳۶,۹۵۰,۰۰۰	(۴,۰۸۴,۹۶۶,۹۷۱)	(۱۹,۷۶۸,۴۶۶)	(۱۸,۶۸۴,۷۵۰)	پتروشیمی مبین
(۳۳۲,۴۰۷,۳۰۷)		۱,۰۱۶,۴۹۷	۲,۳۰۴,۳۹۸,۶۹۹	(۲,۶۱۳,۰۹۳,۷۴۳)	(۱۲,۱۹۰,۲۶۹)	(۱۱,۵۲۱,۹۹۳)	تراکتورسازی ایران
۱۱,۱۸۷,۹۸۲		۳۰۰,۰۰۰	۴۲۴,۲۰۰,۰۰۰	(۴۰۸,۶۴۷,۰۰۰)	(۲,۲۴۴,۰۱۸)	(۲,۱۲۱,۰۰۰)	توسعه معادن و فلزات
(۱۴۱,۳۷۱,۴۰۲)		۸۶,۳۰۰	۹۳۹,۲۸۹,۲۰۰	(۱,۰۷۰,۸۹۵,۳۱۶)	(۴,۹۶۸,۸۴۰)	(۴,۶۹۶,۴۴۶)	داروسازی جابر ابن حیان
۸۶,۳۳۷,۴۳۶		۴۵,۹۰۰	۸۷۸,۱۵۸,۸۰۰	(۷۸۳,۰۴۳,۱۷۹)	(۴,۴۸۷,۳۹۱)	(۴,۳۹۰,۷۹۴)	داروسازی کاسپین تامین
۱۸۷,۲۵۵,۰۴۶		۳۹۹,۸۴۰	۲,۴۸۶,۶۰۴,۹۶۰	(۲,۲۷۳,۷۶۲,۷۴۹)	(۱۳,۱۵۴,۱۴۰)	(۱۲,۴۳۳,۰۲۵)	سرمایه گذاری دارویی تامین
(۷۱,۹۰۰,۵۲۳)		۵۳۴,۱۷۷	۷۴۹,۴۵۰,۳۳۱	(۸۱۳,۶۳۹,۰۱۰)	(۳,۹۶۴,۵۹۲)	(۳,۱۴۷,۲۵۲)	سرمایه گذاری ملی ایران
(۱۳۲,۹۱۸,۰۵۳)		۷۹۰,۰۰۰	۱,۰۱۰,۴۱۰,۰۰۰	(۱,۱۳۲,۹۳۰,۹۳۴)	(۵,۳۴۵,۰۶۹)	(۵,۰۵۲,۰۵۰)	سرمایه گذاری بازنشستگی کشوری
(۱۱۱,۶۰۵,۳۳۸)		۴۷۱,۸۲۳	۴۹۵,۸۸۵,۹۷۳	(۶۰۲,۳۸۸,۶۴۴)	(۲,۶۲۳,۳۳۷)	(۲,۴۷۹,۴۳۰)	سرمایه گذاری غدیر
(۳۷,۳۷۸,۱۴۸)		۳۰,۴۹۲	۴۰۴,۵۰۶,۸۷۲	(۴۲۷,۷۹۵,۴۵۶)	(۲,۰۶۷,۰۳۰)	(۲,۰۲۲,۵۳۴)	شیر پاستوریزه پگاه گلپایگان
۲۶,۰۸۹,۷۷۶		۱۶۵,۰۰۰	۷۴۴,۸۱۰,۰۰۰	(۷۰۱,۰۵۶,۱۲۹)	(۳,۹۴۰,۰۴۵)	(۳,۷۳۴,۰۵۰)	صنایع پتروشیمی خلیج فارس
۶۷۶,۱۲۷,۲۶۳		۱,۷۰۰,۰۰۰	۳,۰۹۵,۷۰۰,۰۰۰	(۲,۳۸۷,۷۱۷,۹۸۴)	(۱۶,۳۷۶,۲۵۳)	(۱۵,۴۷۸,۵۰۰)	فولاد مبارکه اصفهان
۱	۱	۴۶,۵۶۷	۴۶,۵۶۷	(۴۶,۰۸۷)	(۲۴۶)	(۲۳۳)	کنتور سازی ایران
(۸۹,۷۰۶,۳۳۵)		۸۱,۰۰۰	۳۶۸,۵۵۰,۰۰۰	(۴۵۴,۴۶۳,۹۴۵)	(۱,۹۴۹,۶۳۰)	(۱,۸۴۲,۷۵۰)	گروه دارویی سبحان
(۲۰,۸۰۳,۹۷۶)		۱۵۱,۲۲۵	۴۷۵,۹۰۵,۰۷۵	(۴۹۱,۸۱۱,۹۸۸)	(۲,۵۱۷,۵۳۸)	(۲,۳۷۹,۵۲۵)	گروه صنعتی بارز
(۷۲,۰۵۸,۶۲۰)		۶۶,۰۰۰	۴۶۹,۶۵۶,۰۰۰	(۵۲۶,۸۱۱,۸۶۰)	(۲,۴۸۴,۴۸۰)	(۲,۳۴۸,۲۸۰)	گروه مینا
۳۱,۶۷۴,۵۳۹		۲۹۵,۸۵۸	۲۹۶,۱۵۳,۸۵۸	(۲۶۱,۴۳۱,۸۹۶)	(۱,۵۶۶,۶۵۴)	(۱,۴۸۰,۷۶۹)	گروه بهمن
۹۶,۵۱۶,۵۲۰		۵۳۰,۰۰۰	۱,۰۰۱,۷۰۰,۰۰۰	(۸۹۴,۸۷۵,۹۸۷)	(۵,۲۹۸,۹۹۳)	(۵,۰۰۸,۵۰۰)	گسترش نفت و گاز پارسیان
(۲۶,۰۵۱,۷۱۹)		۱۰۰,۰۰۰	۱۷۶,۲۰۰,۰۰۰	(۲۰۰,۴۳۸,۶۲۱)	(۹۳۲,۰۹۸)	(۸۱۰,۰۰۰)	لیزینگ ایرانیان
(۱۷,۴۰۵,۹۳۱)		۲۲۰,۰۰۰	۲۸۴,۰۲۰,۰۰۰	(۲۹۸,۵۰۳,۳۶۵)	(۱,۵۰۲,۴۶۶)	(۱,۴۲۰,۱۰۰)	لیزینگ رایان سایپا
(۹۴,۷۴۰,۳۵۳)		۷۸۵,۲۱۷	۱,۴۸۸,۷۷۱,۴۳۲	(۱,۵۶۸,۱۹۲,۳۳۷)	(۷,۸۷۵,۶۰۱)	(۷,۴۴۳,۸۵۷)	مخابرات ایران
(۴۵,۶۵۹,۰۶۳)		۵۰۰,۰۰۰	۱,۲۴۵,۵۰۰,۰۰۰	(۱,۲۷۸,۳۴۲,۸۶۸)	(۶,۵۸۸,۶۹۵)	(۶,۲۲۷,۵۰۰)	معدنی و صنعتی گل گهر
(۱۲۷,۸۲۱,۰۴۷)		۴۵۰,۰۰۰	۱,۲۶۴,۲۵۰,۰۰۰	(۱,۳۷۷,۰۸۲,۴۹۴)	(۶,۶۷۷,۳۰۳)	(۶,۳۱۱,۲۵۰)	ملی سرب و روی ایران
(۷۸,۱۱۲,۶۲۰)		۱,۳۰۰,۰۰۰	۲,۶۰۶,۵۰۰,۰۰۰	(۲,۶۵۷,۷۹۱,۷۳۵)	(۱۳,۷۸۸,۳۸۵)	(۱۳,۰۳۲,۵۰۰)	ملی صنایع مس ایران
(۲,۷۹۶,۴۴۵)		۴۱۲,۸۵۵	۱۳,۵۷۸,۷۸۶	(۱۶,۲۳۵,۵۰۵)	(۷۱,۸۳۲)	(۶۷,۸۹۴)	ح. توسعه معادن و فلزات
۵۴۴,۳۴۰		۱۸۲,۳۳۳	۶۶,۵۴۹,۸۷۹	(۶۵,۳۲۰,۷۴۱)	(۳۵۲,۰۴۹)	(۳۳۲,۷۴۹)	ح. لیزینگ رایان سایپا
(۱۷,۸۱۹,۸۸۳)		۳۳,۲۵۶	۱۱۸,۰۵۸,۸۰۰	(۱۱۴,۷۴۹,۰۷۹)	(۶۲۴,۵۳۱)	(۵۶۵,۰۷۳)	ح. گروه دارویی سبحان
(۱,۶۰۹,۷۴۲,۸۶۰)	(۱۸۳,۹۶۰,۶۷۲)	۱۵,۰۰۵,۹۵۴	۳۶,۷۹۷,۱۷۸,۶۱۲	(۳۸,۰۲۸,۵۳۴,۶۰۵)	(۱۹۴,۴۲۶,۱۹۵)	(۱۸۳,۹۶۰,۶۷۲)	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 ۶ ماهه منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ مبلغ ۳۸،۳۲۷،۵۷۷،۴۱۱ 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 ۱۳۹۶/۰۵/۳۱ با بازدهی شاخص کل بورس در جدول زیر آمده است:

شرح	مقدار در ۱۳۹۵/۱۲/۰۱	مقدار در ۱۳۹۶/۰۵/۳۱	درصد بازدهی
NAV صندوق سرمایه‌گذاری بانک توسعه تعاون	۲,۵۱۶,۸۷۹	۲,۶۰۳,۰۶۸	۳,۴۲٪
شاخص کل بورس اوراق بهادار	۷۷,۶۵۸	۸۲,۳۷۲	۶,۰۷٪

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.