



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

شرکت سبد گردان آمیتیس

بیانیه سیاست‌ها و خط مشی سرمایه‌گذاری

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی درخشان آمیتیس



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

سهام خاص | شماره ثبت: ۵۳۴۹۰۶

تلفن: ۰۲۱ ۲۲۶۶۰۸۵۰-۳

info@amitispm.com

تهران | جردن | نبش کوچه سعیدی

پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

کمیته سیاست گذاری صندوق سرمایه گذاری سهامی درخشان آمیتیس

فهرست مطالب

۱- کلیات و تعاریف

۲- هدف

۳- وظایف گروه تحلیل گران

۴- وظایف گروه مدیران سرمایه گذاری

۵- حدود اختیارات گروه مدیران سرمایه گذاری

۶- پایش و بازبینی عملکرد صندوق

۷- بررسی و بازبینی بیانیه سیاست و خط مشی سرمایه گذاری



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

سهامی خاص (شماره ثبت: ۵۳۶۱۳۴)

تلفن: ۰۲۱۲۲۶۶۰۸۵۰-۳

info@amitispm.com

تهران | جردن | نیش کوچه سعیدی

پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار
۱- کلیات و تعاریف

صندوق سرمایه‌گذاری مشترک، نهادی مالی است که به جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و تشکیل سبدی از دارایی‌ها و مدیریت این سبد می‌پردازد؛ با توجه به پذیرش ریسک موردقبول تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد. انباشته شدن سرمایه در صندوق، مزیت‌های متعددی مانند:

۱- هزینه به‌کارگیری نیروهای متخصص، گردآوری و تحلیل اطلاعات و گزینش سبد بهینه اوراق بهادار بین همه سرمایه‌گذاران تقسیم می‌شود و سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار کاهش می‌یابد

۲- صندوق از جانب سرمایه‌گذاران، کلیه حقوق اجرایی مربوط به صندوق از قبیل دریافت سود سهام و کوپن اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد

۳- امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم‌شده و در نتیجه ریسک سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد.

کلیه تعاریف بکار گرفته‌شده در این خط‌مشی مطابق تعاریف ارائه‌شده در اساسنامه صندوق سرمایه‌گذاری سهامی درخشان آمیتیس می‌باشد. سایر واژه‌ها به شرح زیر تعریف می‌گردد.

• گروه تحلیل‌گران: کارگروه تحلیل به‌وسیله ۵ نفر عضو اداره می‌شود که اعضای آن به شرح ذیل تعیین می‌گردند:

- گروه ۳ نفره مدیران سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری درخشان آمیتیس؛
- یک کارشناس در امور سرمایه‌گذاری از کارکنان مدیر صندوق به انتخاب مدیرعامل شرکت سبد گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق؛
- یک نفر از فعالان و متخصصان بازار سرمایه به انتخاب مدیرعامل شرکت سبد گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق.

• گروه مدیران سرمایه‌گذاری: حداقل ۳ شخص حقیقی از کارکنان تمام‌وقت شرکت سبد گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق با توجه به قوانین و مقررات و الزامات سازمان بورس می‌باشند.

• مدیر سرمایه‌گذاری: حداقل یک شخص حقیقی از کارکنان تمام‌وقت شرکت سبد گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق با توجه به قوانین و مقررات و الزامات سازمان بورس.



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

هدف از تعیین بیانیه سیاست‌های سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی درخشان آمیتیس، تصمیم‌گیری در مورد خرید و فروش یا حفظ مالکیت دارایی‌های صندوق در حدود مقررات سازمان بورس و اوراق بهادار و اساسنامه و امیدنامه صندوق و ارائه چارچوبی برای مدیران این صندوق به منظور تعیین استراتژی سرمایه‌گذاری، بررسی و نظارت بر فعالیت سرمایه‌گذاری، تعیین سیاست‌ها، رهنمودها و محدود نمودن ریسک در صندوق و رسیدن به هدف اصلی صندوق که همان حداکثر سازی سود سرمایه‌گذاران گردیده، می‌باشد.

۳- وظایف گروه تحلیل‌گران

ساختار و وظایف کارگروه تحلیل برحسب مورد توسط گروه مدیران سرمایه‌گذاری پیشنهاد و توسط شرکت سبد گردان آمیتیس به عنوان مدیر صندوق تعیین می‌گردند.

- ۱- تهیه گزارش‌های توجیهی خرید یا فروش سهام، ارائه گزارش‌های مربوط به تحلیل بازارهای مختلف و تدوین سایر گزارش‌های مورد نیاز گروه مدیران سرمایه‌گذاری، از کارکردهای کارگروه تحلیل می‌باشد.
- ۲- کارگروه تحلیل، گزارش‌های خود را به صورت مستند و مکتوب تنظیم نموده و جهت تصمیم‌گیری به گروه مدیران ارائه می‌نماید.

- ۳- نتایج جلسات کارگروه تحلیل به مدیران سرمایه‌گذاری ارجاع داده می‌شود.

۴- سیاست سرمایه‌گذاری و وظایف گروه مدیران سرمایه‌گذاری

جلسات گروه مدیران سرمایه‌گذاری حداقل یک‌بار در هفته تشکیل می‌گردد. ترتیب برگزاری جلسات توسط اعضای گروه مدیران تعیین می‌شود. جلسات گروه مدیران در مواقع ضروری به درخواست حداقل دو نفر از مدیران سرمایه‌گذاری تشکیل خواهد شد.

جلسات گروه مدیران با حضور هر سه عضو رسمیت پیدا می‌کند و مصوبات هر جلسه با نظر موافق حداقل ۲ نفر از اعضاء معتبر خواهد بود.



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

سهام خاص | شماره ثبت: ۵۳۶۹۰۴

تلفن: ۰۲۱۲۲۶۶۰۸۵۰-۳

info@amitispm.com

تهران | جردن | نبش کوچه سعیدی

پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

وظیفه اصلی گروه مدیران سرمایه‌گذاری تخصیص دارایی، متنوع سازی و متوازن سازی دارایی‌های صندوق جهت حفظ حقوق سرمایه‌گذاران و حداکثر سازی منافع ایشان می‌باشد. سایر وظایف گروه مدیران سرمایه‌گذاری به شرح زیر می‌باشد:

- ۱- مطالعه، ارزیابی و تحلیل عوامل کلان اقتصادی و سیاسی ایران و جهان و ارزیابی اثرات آن‌ها بر اقتصاد کشور، بورس اوراق بهادار تهران و وضعیت سوددهی هر یک از بخش‌های اقتصادی؛
 - ۲- پیشنهاد استراتژی‌های کلان جهت مدیریت سبد صندوق؛
 - ۳- شناسایی، تحلیل و اولویت‌بندی فرصت‌های جدید و مناسب سرمایه‌گذاری در سهام شرکت‌ها؛
 - ۴- بررسی وضعیت بازار سرمایه و تصمیم‌گیری در مورد نحوه، میزان و زمان ورود یا خروج از بازار؛
 - ۵- بررسی پیشنهادهای خرید یا فروش سهام و همچنین تصویب محدوده قیمتی خرید یا فروش‌ها؛
 - ۷- تعیین استراتژی‌های مدیریت ریسک ناظر بر سبد صندوق؛
- (انواع ریسک‌های مرتبط شامل: ریسک بازار، ریسک کاهش ارزش دارایی‌های صندوق، ریسک نکال اوراق مشارکت، ریسک نوسان نرخ بازده بدون ریسک، ریسک تغییر قوانین و مقررات، ریسک نقد شوندگی)
- ۸- تعیین ترکیب سبد صندوق بر اساس الزامات و قوانین سازمان بورس و اوراق بهادار و همچنین متنوع سازی آن به منظور حفظ پرتفوی در مقابل نتایج نامطلوب به دلیل تحمل ریسک‌های عمده مدیریت این ریسک‌ها با توجه به شرایط بازار سرمایه و وضعیت اقتصادی و سیاسی داخل و خارج از کشور؛
 - ۹- ارسال گزارش‌های دوره‌ای به کمیته سیاست‌گذاری صندوق و هیئت‌مدیره شرکت سبدگردان آمیتیس به عنوان مدیر صندوق؛
 - ۱۰- ارائه گزارش از عملکرد سبد سرمایه‌گذاری و ارزیابی نتایج حاصله از اجرای تصمیمات اتخاذشده در مورد هر یک از سرمایه‌گذاری‌های صورت گرفته در فواصل؛
 - ۱۱- انجام سایر وظایف و مسئولیت‌هایی که ممکن است در هر زمانی هیئت‌مدیره شرکت سبدگردان آمیتیس برای آن تعیین نماید.



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار
سهام خاص | شماره ثبت: ۵۳۴۹۴

تلفن: ۰۲۱۲۲۶۶۰۸۵۰-۳
info@amitisp.m.com

تهران | جردن | نبش کوچه سعیدی
پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

تصمیمات و مصوبات جلسات گروه مدیران باید منطبق با ضوابط و مقررات موضوعه سازمان بورس و اوراق بهادار، اساسنامه و امید نامه صندوق باشد و به اطلاع کمیته سیاست گذاری و هیئت مدیره شرکت سبد گردان آمیتیس به عنوان مدیر صندوق برسد.

نتایج جلسات گروه مدیران سرمایه گذاری به کمیته سیاست گذاری ارجاع داده می شود.

مدت فعالیت گروه مدیران از تاریخ تشکیل مطابق مقررات تبصره سه ماده ۳۹ صندوق خواهد بود.

۵- حدود اختیارات گروه مدیران سرمایه گذاری

نماینده گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق می تواند رأساً نسبت به خرید و یا فروش روزانه اوراق بهادار تا سقف ۱۰ درصد خالص ارزش روز دارایی های صندوق اقدام نماید.

گروه مدیران سرمایه گذاری با هماهنگی فی مابین می تواند نسبت به خرید و یا فروش روزانه اوراق بهادار تا سقف ۲۰ درصد از خالص ارزش روز دارایی های صندوق اقدام نماید.

۶- پایش و بازبینی عملکرد صندوق

بازبینی و نظارت بر عملکرد سبد سرمایه گذاری صندوق یکی از مهم ترین مراحل سرمایه گذاری می باشد و تیم سرمایه گذاری عملکرد صندوق را در دوره های ماهانه، سه ماهه، شش ماهه و سالانه با شاخص های مورد نظر می سنجند و سپس ارزیابی می نمایند و در صورت لزوم تغییرات لازم را اعمال می نمایند. در این مرحله ترکیب دارایی های صندوق نیز مورد بازبینی قرار می گیرد و گزارش ها تهیه شده برای کمیته سیاست گذاری ارسال می گردد؛ همچنین مدیران سرمایه گذاری به منظور کنترل و مصون سازی صندوق در شرایط بحران و ارزیابی میزان تأثیرات آن در دوره های زمانی تعیین شده اقدام به بررسی وقوع شرایط بحرانی احتمالی، سناریوسازی می نمایند و برحسب نیاز از پارامترهای زیر به منظور آمادگی در شرایط بحران استفاده می کنند:



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

سهام خاص | شمولیت ۵۳۴۹۴

تلفن: ۰۲۱۲۲۶۶۰۸۵۰-۳

info@amitisp.com

تهران | جردن | نبش کوچه سعیدی

پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار

۱- تغییر در سیاست سرمایه‌گذاری و تخصیص دارایی‌ها

۲- استفاده از ابزارهای پوشش ریسک

۷- بررسی و بازبینی بیانیه سیاست و خط‌مشی سرمایه‌گذاری

مدیران سرمایه‌گذاری در موارد لزوم و حداقل یک‌بار در هر سال به‌منظور بهبود عملکرد و دستیابی به اهداف

تعیین‌شده، اقدام به ارزیابی و بازنگری بیانیه سیاست‌ها و خط‌مشی سرمایه‌گذاری می‌نمایند.



سبد گردان آمیتیس

AMITIS Portfolio Management

تحت نظارت سازمان بورس و اوراق بهادار
سهامی خاص (شماره ثبت: ۵۳۶۸۴۴)

تلفن: ۰۲۱۲۲۶۶۰۸۵۰-۳

info@amitispm.com

تهران | جردن | نبش کوچه سعیدی

پلاک ۱۵۸ | طبقه چهارم