

شرکت سبد گردان آمیتیس

بیانیه سیاست‌ها و خط‌مشی سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی درخشان آمیتیس

(نماد آمیتیس)

کمیته سیاست‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی درخشان آمیتیس

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۰۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضاء هیئت مدیره					
مهیار دشتی بقائی مدیر عامل	محمد آشتی پور عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	حسین کدخدا نائب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدالهی رئیس هیئت مدیره

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

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۰۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضاء هیئت مدیره					
مهیار دشتی بقالی مدیر عامل	محمد آشفته پور عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	حسن کدخدا نائب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدالهی رئیس هیئت مدیره

۱- کلیات و تعاریف

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی، 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 کوبین اوراق بهادار را انجام می‌دهد و در نتیجه سرانه هزینه هر سرمایه‌گذار برای انجام سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد؛
 - ۳- امکان سرمایه‌گذاری مناسب و متنوع‌تر دارایی‌ها فراهم شده 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 سید گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق؛
 - یک نفر از فعالان و متخصصان بازار سرمایه به انتخاب مدیرعامل شرکت سید گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق؛
 - گروه مدیران سرمایه‌گذاری: حداقل ۳ شخص حقیقی از کارکنان تمام‌وقت شرکت سید 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 سید گردان آمیتیس به‌عنوان مدیر صندوق با توجه به قوانین و مقررات و الزامات سازمان بورس.

تاریخ تصویب	اعضای کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۲۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضای هیئت مدیره					
رضا عبدلهی رئیس هیئت مدیره	حسن کدخدا نایب‌رئیس هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	محمد آشفته پور عضو هیئت مدیره	مهیار دشتی بقالی مدیرعامل

۲- هدف:

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 امید نامه 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 تحلیل گران

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.

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۰۶	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علی‌رضا کریمی

اعضاء هیئت مدیره					
مهیار دشتی نقالی مدیر عامل	محمد آشفته پور رئیس هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	حسن کدخدا نائب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدالباقی رئیس هیئت مدیره

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 پیشنهادها 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 نکول 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 به‌عنوان 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.

تاریخ تصویب	اعضای کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۲/۱۱/۰۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضای هیئت مدیره					
مهیار دشتی بقائی مدیرعامل	محمد آشفته پور عضو هیئت‌مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت‌مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت‌مدیره	حسن کدخدا نائب‌رئیس هیئت‌مدیره	رضا عبدالحی رئیس هیئت‌مدیره

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 ۵ 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 ۱۰ 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 های 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 بر حسب نیاز از پارامترهای زیر به منظور آمادگی در شرایط بحران استفاده می کنند:

تاریخ تصویب	اعضای کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۰۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضای هیئت مدیره					
مهیار دشتی بقائی مدیرعامل	محمد آشفته پور عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	حسن کدخدا نایب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدلهی رئیس هیئت مدیره

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.

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۳/۱۱/۰۱	آقای احسان بدیعی	آقای ابراهیم دیلم	آقای علیرضا کریمی

اعضاء هیئت مدیره					
مهیار دشتی بقائی مدیر عامل	محمد آشفته نور عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی عضو هیئت مدیره	مریم کلهری زاده عضو هیئت مدیره	حسن گدخدا نائب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدالمولی رئیس هیئت مدیره