

شرکت سید گردان لقمان

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		
۱۴۰۵/۰۳/۱۰	آقای رضا قنبری	آقای رحیم کریمی	آقای علیرضا کریمی

مهیار دشتی بقائی مدیر عامل و عضو هیئت‌مدیره	سید جواد درواری عضو هیئت‌مدیره	رحیم کریمی عضو هیئت‌مدیره	علیرضا کریمی نائب رئیس هیئت‌مدیره	رضا عبدالهی رئیس هیئت‌مدیره
--	-----------------------------------	------------------------------	--------------------------------------	--------------------------------

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		
۱۴۰۵/۰۳/۱۰	آقای رضا قنبری	آقای رحیم کریمی	آقای علیرضا کریمی

مهیاردشتی بقائی مدیرعامل و عضو هیئت مدیره	سید احمد درواری عضو هیئت مدیره	رحیم کریمی عضو هیئت مدیره	علیرضا کریمی نائب رئیس هیئت مدیره	رضا عبدالحی 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 مورد قبول 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 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 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.

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۵/۰۳/۱۰	آقای علیرضا کریمی	آقای رحیم کریمی	آقای رضا فنبیری

رضا عبدالمهی	علیرضا کریمی	رحیم کریمی	سید جواد مرواری	مهیار دشتی بقائی
رئیس هیئت مدیره	نائب رئیس هیئت مدیره	عضو هیئت مدیره	عضو هیئت مدیره	مدیرعامل و عضو هیئت مدیره

- 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.

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 به‌منظور 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 به‌عنوان مدیر صندوق تعیین می‌گردند.

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

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

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۵/۰۳/۱۰	آقای علی رضا کریمی	آقای رحیم کریمی	آقای رضا قنبری

رضا عبدالهی رئیس هیئت مدیره	علیرضا کریمی نائب رئیس هیئت مدیره	رحیم کریمی عضو هیئت مدیره	سید جواد درواری عضو هیئت مدیره	مهیار دشتی بقائی مدیرعامل و عضو هیئت مدیره
--------------------------------	--------------------------------------	------------------------------	-----------------------------------	---

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.

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 نکول اوراق مشارکت، ریسک نوسان نرخ بازده بدون ریسک، ریسک تغییر قوانین و مقررات، ریسک نقد شوندگی)

تاریخ تصویب	اعضاء کمیته مدیریت ریسک		
۱۴۰۵/۰۳/۱۰	آقای رضا قنبری	آقای رحیم کریمی	آقای علیرضا کریمی

مهیار دشتی بقائی مدیرعامل و عضو هیئت‌مدیره	سید جهاد درواری عضو هیئت‌مدیره	رحیم کریمی عضو هیئت‌مدیره	علیرضا کریمی نائب رئیس هیئت‌مدیره	رضا عبدالهی رئیس هیئت‌مدیره
---	-----------------------------------	------------------------------	--------------------------------------	--------------------------------

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 ریسک های عمده مدیریت این ریسک ها با توجه به شرایط بازار سرمایه و وضعیت اقتصادی و سیاسی داخل و خارج از کشور؛

۹- ارسال گزارش های دوره ای به کمیته سیاست گذاری صندوق و هیئت مدیره شرکت سبدگردان آمیتیس به عنوان مدیر صندوق؛

۱۰- ارائه گزارش از عملکرد سبد سرمایه گذاری و ارزیابی نتایج حاصله از اجرای تصمیمات اتخاذ شده در مورد هر یک از سرمایه گذاری های صورت گرفته در فواصل؛

۱۱- انجام سایر وظایف و مسئولیت هایی که ممکن است در هر زمانی هیئت مدیره شرکت سبدگردان آمیتیس برای آن تعیین نماید. 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.

اعضاء کمیته مدیریت ریسک			تاریخ تصویب
آقای علیرضا کریمی	آقای رحیم کریمی	آقای رضا فتنبری	۱۴۰۵/۰۳/۱۰

رضا عبدالمهی	علیرضا کریمی	رحیم کریمی	سید جواد درواری	مهیار دشتی بقائی
رئیس هیئت مدیره	نائب رئیس هیئت مدیره	عضو هیئت مدیره	عضو هیئت مدیره	مدیرعامل و عضو هیئت مدیره

۶- پایش و بازبینی عملکرد صندوق

بازبینی و نظارت بر عملکرد سپد سرمایه‌گذاری صندوق یکی از مهم‌ترین مراحل سرمایه‌گذاری می‌باشد و تیم سرمایه‌گذاری عملکرد صندوق را در دوره‌های ماهانه، سه‌ماهه، شش‌ماهه و سالانه با شاخص‌های مورد نظر می‌سنجند و سپس ارزیابی می‌نمایند و در صورت لزوم تغییرات لازم را اعمال می‌نمایند. در این مرحله ترکیب دارایی‌های صندوق نیز مورد بازبینی قرار می‌گیرد و گزارش‌های تهیه‌شده برای کمیته سیاست‌گذاری ارسال می‌گردد؛ همچنین مدیران سرمایه‌گذاری به‌منظور کنترل و مصون‌سازی صندوق در شرایط بحران و ارزیابی میزان تأثیرات آن در دوره‌های زمانی تعیین‌شده اقدام به بررسی وقوع شرایط بحرانی احتمالی، سناریوسازی می‌نمایند و بر حسب نیاز از پارامترهای زیر به‌منظور آمادگی در شرایط بحران استفاده می‌کنند:

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.

اعضاء کمیته مدیریت ریسک			تاریخ تصویب
آقای علیرضا کریمی	آقای رحیم کریمی	آقای رضا قنبری	۱۴۰۵/۰۳/۱۰

رضا عبدالمهدی رئیس هیئت‌مدیره	علیرضا کریمی نائب رئیس هیئت‌مدیره	رحیم کریمی عضو هیئت‌مدیره	سید جواد درواری عضو هیئت‌مدیره	مهیار دشتی مدیرعامل و عضو هیئت‌مدیره
----------------------------------	--------------------------------------	------------------------------	-----------------------------------	---