شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران (سهامی خاص)
شماره ثبت نزد سازمان بورس و اوراق بهادار: ۱۰۷۱۴
شماره ثبت: ۱۰۲۵۷۸

بیانیه سیاست سرمایه گذاری
صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی
گنجینه سپهر صادرات

دفتر مرکزی: تهران، خیابان ولی‌عصر، بلوار میرداماد، نرسیده به پل آفریقا، جنب بانک صادرات، پلاک ۴۴۰، کدپستی: ۱۹۶۹۷-۷۳۸۱۱، مرکز تماس: ۳۵۹ ۴۲ - ۰۲۱
www.saderatbourse.com
info@saderatbourse.com

مقدمه

ماده (۱): بیانیه سیاست سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات بر اساس منشور کمیته سیاست گذاری سرمایه گذاری و مدیریت ریسک شرکت کارگزاری بانک صادرات توسط کمیته سیاست گذاری سرمایه گذاری و مدیریت ریسک، شامل ده ماده تهیه شده و در تاریخ ۱۴۰۱/۰۳/۳۱ به تصویب هیأت مدیره کارگزاری بانک صادرات رسید.

گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق

ماده (۲): گروه مدیران سرمایه گذاری صندوق توسط مدیر صندوق انتخاب می شوند و پس از تایید سازمان بورس و اوراق بهادار وظیفه اجرای این بیانیه را دارند.

اهداف

ماده (۳): هدف این بیانیه ارائه چارچوبی برای مدیران صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات به منظور رسیدن به اهداف صندوق است که در این بیانیه به آنها اشاره خواهد شد. این بیانیه در حقیقت به منظور مشخص کردن اهداف و محدودیتهای تیم سرمایه گذاری صندوق تبیین شده است.

ماده (۴): هدف از تشکیل صندوق، ارتقاء رتبه نقد شوندگی، پوشش ریسک نوسان قیمت، جمع آوری وجوه از سرمایه گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چهارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق دستورالعمل بازارگردانی، امیدنامه، و کسب منافع از این محل برای سرمایه گذاران است. همچنین در صورتیکه صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع آوری شده و سایر داراییهای صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می شود بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه گذاران گردد.

امضای اعضای هیأت مدیره:

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران
(سهامی خاص)
شماره ثبت: ۱۰۲۵۷۸

فرهاد ذاکری احسان حاجی حسن معمار

سیاست ها و استراتژی های صندوق

ماده (۵): موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیره نویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است .صندوق سرمایه گذاری اختصاصی بازارگردانی گنجینه سپهر صادرات در اجرای موضوعات فعالیت یادشده و رسیدن به اهداف سرمایه گذاری، متعهد به انجام معاملات بر اساس شرایط زیر است:

- تفاوت بین کمترین قیمت خرید در سفارش خرید و بیشترین قیمت فروش در سفارش فروش نباید بیشتر از دامنه مظنه ذکر شده در بند ۷ امیدنامه باشد.
- حجم سفارش های خرید و فروش وارده باید برابر با حداقل سفارش انباشته مطابق بند ۷ امیدنامه باشد.
- تعهد روزانه صندوق مطابق بند ۷ امیدنامه تعیین میگردد.

استراتژی های صندوق

ماده(۶): استراتژی های صندوق به شرح زیر می باشد:

۱. بازارگردان در ورود سفارش های خرید و فروش، پارامترهای بازارگردانی مطابق با قوانین و مقررات بازار سرمایه مربوط به صندوق های بازارگردانی را رعایت نماید.

۲. صندوق می تواند منابع مالی مازاد خود را در دارائی های مالی واجد شرایط زیر سرمایه گذاری کند:

الف)اوراق مشارکت، اوراق اجاره و اوراق بهادار رهنی و سایر اوراق بهادار با درآمد ثابت که دارای تمامی شرایط زیر باشند:

- مجوز انتشار آنها از سوی دولت، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران یا سازمان بورس و اوراق بهادار صادر شده باشد.
- سود حداقلی برای آنها مشخص شده و پرداخت اصل سرمایه گذاری و سود آنها تضمین شده یا برای پرداخت اصل و سود سرمایه گذاری وثایق کافی وجود داشته باشد.
- در یکی از بورس ها پذیرفته شده و معاملات ثانویه آنها در بورس امکان پذیر باشد.

ب)گواهی های سپرده منتشره توسط بانک ها یا موسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

ج)هر نوع سپرده گذاری نزد بانک ها و موسسات مالی اعتباری دارای مجوز از بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

امضای اعضای هیات مدیره:

فرهاد ذاکری — حاج حسن معمار

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران ((سهامی خاص)) شماره ثبت: ۱۰۲۵۷۸

دفتر مرکزی: تهران، خیابان ولی‌عصر، بلوار میرداماد، نرسیده به پل آفریقا، جنب بانک صادرات، پلاک ۴۴۰، کدپستی: ۱۹۶۹۷-۷۳۸۱۱، مرکز تماس: ۴۲ ۳۵۹ - ۰۲۱
www.saderatbourse.com
info@saderatbourse.com

ارزیابی عملکرد مدیران سرمایه گذاری

ماده(۷): با توجه به اهداف تعیین شده برای صندوق ، یکی از مهمترین شاخص ها برای ارزیابی عملکرد این صندوق، میزان موفقیت در افزایش نقدشوندگی و کاهش نوسان قیمت سهام مورد بازارگردانی است. بدین منظور گزارش های با دوره های زمانی مختلف روزانه، هفتگی و ماهانه از متغیرهای مختلف معاملاتی اوراق بهادار مورد تعهد بازارگردانی توسط مدیران سرمایه گذاری صندوق، تهیه و در جلسات کمیته بررسی خواهند شد.

انواع ریسک

ماده (۸): نظر به اینکه بازار سرمایه با ریسک های متعددی مواجه می باشد و فعالیت در این فضا نیاز مستمر به بررسی تاثیر این ریسک ها دارد، کمیته سیاست گذاری سرمایه گذاری و مدیریت ریسک، انواع ریسک های موثر بر بازدهی صندوق را رصد کرده و در صورت تغییر با اهمیت هر کدام از مولفه های مربوط به کاهش یا افزایش ریسک، نسبت به بازبینی و تغییر استراتژی های صندوق اقدام نماید.

انجام ادواری آزمون های بحران

ماده (۹): به منظور مصون سازی پرتفوی از شرایط بحرانی، مطالعه ادواری در زمینه های ذیل صورت می گیرد:

- تحلیل اقتصاد جهانی و پیگیری، پایش و تحلیل مولفه ها و تاثیر شاخص های اقتصاد جهانی بر بازار داخل.
- تحلیل اقتصاد کلان داخلی.
- تحلیل گزارشها و صورتهای مالی شرکت ها و نیز آمار تولید و فروش ماهانه و انطباق و اندازه گیری انحراف معیار آنها با گزارش تحلیلی مورد انتظار.

بازنگری و بروزرسانی

ماده (۱۰): کمیته باید در پایان هر سال نسبت به ارزیابی این بیانیه اقدام و آن را بروزرسانی کرده و موارد تغییر را برای تصویب هیات مدیره پیشنهاد کند. همچنین در صورت رخداد هر یک از شرایط زیر نیز بازنگری و تعدیل بیانیه صورت خواهد پذیرفت:

- هرگونه تغییر مؤثر در قوانین و الزامات حاکم بر فعالیت صندوقهای مشترک سرمایه‌گذاری.
- تغییر قابل توجه در ساختار سیاسی و اقتصادی کشور.
- افزایش و یا کاهش قابل توجه در خالص دارایی صندوق در اثر صدور و ابطال واحدهای سرمایه‌گذاری.

امضای اعضای هیات مدیره:

فرهاد ذاکری | احسان حاجی حسن معمار

شرکت کارگزاری بانک صادرات ایران
((سهامی خاص))
شماره ثبت: ۱۰۲۵۷۸