

ابلاغیه

شماره ابلاغیه: ۱۳۹۷/۰۹/۲۵ مورخ: ۱۳۹۷/۰۹/۲۵

صادرکننده: مدیریت نظارت بر نهادهای مالی

موضوع: انجام معاملات قراردادی آتی سبد سهام توسط صندوق های سرمایه گذاری

مخاطبین: کلیه صندوق های سرمایه گذاری ثبت شده نزد سازمان

با احترام؛

به اطلاع می‌رساند؛ در پانصد و چهل و ششمین صورتجلسه هیأت مدیره این سازمان با سرمایه گذاری صندوق های سرمایه گذاری در قرارداد آتی سبد سهام موافقت و به شرح ذیل ابلاغ می‌گردد:

۱- به فهرست موضوعات مجاز برای سرمایه‌گذاری صندوق در امیدنامه یک بند به شرح زیر اضافه گردید:

" به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت سهام موجود در سبد دارایی صندوق و متناسب با جهت و درجه همبستگی بین نوسانات قیمت سبد سهام صندوق و سبد پایه در قرارداد آتی، مجاز به اتخاذ موقعیت خرید یا فروش در قرارداد آتی سبد سهام در بازار معاملات آتی هستند. علاوه بر این، صندوق های سرمایه گذاری می‌توانند، حداکثر تا سقف ۱٪ از ارزش سبد صندوق در قرارداد آتی سبد سهام موقعیت خرید یا فروش اتخاذ نمایند."؛

۲- به انتهای بند مربوط به اهداف و استراتژی های صندوق در امید نامه عبارت زیر اضافه گردید:

" مدیر صندوق می‌تواند به منظور پوشش ریسک نوسان قیمت سهام موجود در سبد دارایی صندوق، در بازار معاملات آتی با توجه به جهت همبستگی بین تغییرات قیمت سبد سهام صندوق در مقایسه با تغییرات قیمت سبد سهام قرارداد آتی اقدام به اتخاذ موقعیت خرید یا فروش نماید. موقعیت های باز خرید یا فروش باید به میزانی باشد که ریسک نوسان قیمت سبد سهام صندوق پوشش داده شود. در صورتی که تعداد موقعیت های خرید یا فروش بیش از میزان لازم جهت پوشش ریسک باشد، مدیر موظف است با اتخاذ موقعیت معکوس، تعداد موقعیت های باز صندوق را به میزان مورد نظر کاهش دهد. همچنین، مدیر صندوق می‌تواند علاوه بر پوشش ریسک نوسان قیمت سهام، تا میزان مقرر در امیدنامه صندوق، در قرارداد آتی سبد سهام، موقعیت خرید یا فروش اتخاذ نماید."

صندوق های سرمایه گذاری فعال بدون نیاز به انجام تشریفات از تاریخ ابلاغ این مصوبه مجاز به انجام معاملات قرارداد آتی سبد سهام می‌باشند.

محمد رضا معتمد

مدیریت نظارت بر نهادهای مالی

- رونوشت: اعضای محترم هیأت مدیره سازمان جهت استحضار؛