

Ogłoszenie dotyczące treści statutu BPH FIO Parasolowego

23-04-2009

BPH Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 1 - 5 Ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych (Dz. U. Nr 146, poz. 1546, z późn. zm.) w związku z wytycznymi Komisji Nadzoru Finansowego („KNF”) z dnia 23 kwietnia 2009 r., w związku z ogłoszonymi w dniu 23 stycznia 2009 r. zmianami w statucie BPH FIO Parasolowego („Fundusz”) informuje, iż:

Zgodnie z art. 24 ust. 1 pkt 2, 3 i 4 ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych („Ustawa”), zezwolenia KNF wymaga zmiana statutu funduszu inwestycyjnego otwartego oraz specjalistycznego funduszu inwestycyjnego otwartego, który przy dokonywaniu lokat funduszu nie stosuje zasad i ograniczeń inwestycyjnych określonych dla funduszu inwestycyjnego zamkniętego, w zakresie wskazania rynku zorganizowanego, o którym mowa w art. 93 ust. 1 pkt 1 lub art. 94 ust. 1 pkt 1 Ustawy, wskazania lokat, o których mowa w art. 93 ust. 1 pkt 2 Ustawy oraz wskazania podmiotów, o których mowa w art. 93 ust. 1 pkt 4 lit. d Ustawy.

Uwzględniając fakt, iż zmiany dotyczące postanowień statutu Funduszu w powyższym zakresie, ogłoszone zostały w dniu 23 stycznia 2009 roku, a więc miały pierwotnie wejść w życie w dniu 24 kwietnia 2009 r., zgodnie ze stanowiskiem KNF zawartym w wytycznych, o których mowa powyżej, ogłoszone zmiany, w zakresie wymagającym zezwolenia KNF, są nieważne i nie wywierają jakichkolwiek skutków prawnych w stosunku do statutu Funduszu, tzn. że treść statutu Funduszu w powyższym zakresie pozostaje niezmieniona, z uwagi na ich bezwzględną nieważność z mocy prawa. W związku z powyższym, treść statutu Funduszu pozostaje niezmieniona we wskazanym poniżej zakresie (poniższe postanowienia statutu Funduszu nie ulegną zmianie z dniem 24 kwietnia 2009 r.):

1. art. 9 statutu:

„Artykuł 9

1. Jeżeli postanowienia Części II Statutu nie stanowią inaczej, Fundusz, z zastrzeżeniem ustępów poniższych oraz art. 11 Statutu może lokować Aktywa Subfunduszy wyłącznie w:

a) papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski, papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim, a także na rynkach zorganizowanych wskazanych odpowiednio w Części II Statutu,

b) papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego dopuszczone do obrotu publicznego nabywane w obrocie pierwotnym lub w pierwszej ofercie publicznej, jeżeli warunki emisji lub pierwszej oferty publicznej zakładają złożenie wniosku o dopuszczenie do obrotu na rynku, o którym mowa w lit. a), lub rynkach zorganizowanych wskazanych odpowiednio w Części II Statutu, oraz gdy dopuszczenie do tego obrotu jest zapewnione w okresie nie dłuższym niż rok od dnia, w którym po raz pierwszy nastąpi zaoferowanie tych papierów lub instrumentów, pod warunkiem, że postanowienia Statutu odnoszące się do danego Subfunduszu przewidują dokonywanie tego rodzaju lokat,

c) depozyty w bankach krajowych lub instytucjach kredytowych, o terminie zapadalności nie dłuższym niż rok, płatne na żądanie lub które można wycofać przed terminem zapadalności, w tym depozyty walutowe zawierane w celach zarządzania bieżącą płynnością Subfunduszu,

d) Instrumenty Rynku Pieniężnego inne niż określone w lit. a) i b), jeżeli instrumenty te lub ich emitent podlegają regulacjom mającym na celu ochronę inwestorów i oszczędności oraz są:

i. emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski, jednostkę samorządu terytorialnego, właściwe centralne, regionalne lub lokalne władze publiczne Państwa Członkowskiego, albo przez bank centralny Państwa Członkowskiego, Europejski Bank Centralny, Unię Europejską lub Europejski Bank Inwestycyjny, państwo inne niż Państwo Członkowskie, albo, w

przypadku państwa federalnego, przez jednego z członków federacji, albo przez organizację międzynarodową, do której należy co najmniej jedno Państwo Członkowskie, lub

ii. emitowane, poręczone lub gwarantowane przez podmiot podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym, zgodnie z kryteriami określonymi prawem wspólnotowym, albo przez podmiot podlegający i stosujący się do zasad, które są co najmniej tak rygorystyczne, jak określone prawem wspólnotowym, lub

iii. emitowane przez podmiot, którego papiery wartościowe są w obrocie na rynku regulowanym, o którym mowa w lit. a), lub

iv. emitowane przez podmiot posiadający rating na poziomie inwestycyjnym lub gwarantowane przez podmiot posiadający rating na poziomie inwestycyjnym, pod warunkiem że inwestycje w takie papiery wartościowe podlegają ochronie inwestora równoważnej do określonej w pkt i.-iii. oraz emitent spełnia łącznie następujące warunki:

- jest spółką, której kapitał własny wynosi co najmniej 10.000.000,- (dziesięć milionów) EUR,
- publikuje roczne sprawozdania finansowe, zgodnie z przepisami prawa wspólnotowego, dotyczące rocznych sprawozdań finansowych niektórych rodzajów spółek,
- należy do grupy kapitałowej, w skład której wchodzi co najmniej jedna spółka, której papiery wartościowe są przedmiotem obrotu na rynku regulowanym,
- zajmuje się finansowaniem grupy, o której mowa w tirecie trzeciej, albo finansowaniem mechanizmów przekształcania długu w papiery wartościowe z wykorzystaniem bankowej linii kredytowej, pod warunkiem, że postanowienia Statutu odnoszące się do danego Subfunduszu przewidują dokonywanie tego rodzaju lokat,

e) papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego, inne niż określone w lit. a), b) i d), z tym że łączna wartość tych lokat nie może przewyższyć 10% (dziesięć procent) wartości Aktywów Funduszu.

2. Lokowanie w papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego będące przedmiotem obrotu na rynku zorganizowanym, oraz w papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego, których dopuszczenie do takiego obrotu jest zapewnione, w państwie innym niż Rzeczpospolita Polska lub państwo należące do OECD, wymaga uzyskania zgody KNF na dokonywanie lokat na określonej giełdzie lub rynku.

3. KNF może udzielić zgody na lokowanie przez Fundusz Aktywów Subfunduszy w depozyty w bankach zagranicznych pod warunkiem, że bank ten podlega nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym w zakresie co najmniej takim, jak określony w prawie wspólnotowym.

4. Fundusz lokując Aktywa Subfunduszy może nabywać:

- a) jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych mających siedzibę na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej,
- b) tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne,
- c) tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, jeżeli:
 - i. instytucje te oferują publicznie tytuły uczestnictwa i umarzają je na żądanie uczestnika,
 - ii. instytucje te podlegają nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym Państwa Członkowskiego lub państwa należącego do OECD oraz zapewniona jest, na zasadzie wzajemności, współpraca KNF z tym organem,
 - iii. ochrona posiadaczy tytułów uczestnictwa tych instytucji jest taka sama jak posiadaczy jednostek uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych, w szczególności instytucje te stosują ograniczenia inwestycyjne co najmniej takie, jak określone w Rozdziale 1 Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych,
 - iv. instytucje te są obowiązane do sporządzania rocznych i półrocznych sprawozdań finansowych,
- pod warunkiem, że nie więcej niż 10% (dziesięć procent) wartości aktywów tych funduszy inwestycyjnych otwartych, funduszy zagranicznych lub instytucji może być, zgodnie z ich statutem lub regulaminem, zainwestowana łącznie w jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych oraz tytuły uczestnictwa innych funduszy zagranicznych i instytucji wspólnego

inwestowania.

5. Fundusz nie może lokować więcej niż 20% (dwadzieścia procent) wartości Aktywów Subfunduszu w jednostki uczestnictwa jednego funduszu inwestycyjnego otwartego lub tytułów uczestnictwa funduszu zagranicznego lub instytucji wspólnego inwestowania, o której mowa w ust. 4, a jeżeli ten fundusz inwestycyjny otwarty, fundusz zagraniczny, lub instytucja składają się z subfunduszy i każdy z subfunduszy stosuje inną politykę inwestycyjną – więcej niż 20% wartości Aktywów Subfunduszu w jednostki uczestnictwa lub tytuły uczestnictwa jednego subfunduszu.

6. Łączna wartość lokat w tytuły uczestnictwa instytucji wspólnego inwestowania innych niż jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych lub tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych nie może przewyższać 30% (trzydzieści procent) wartości Aktywów Subfunduszu.

7. Jeżeli Fundusz lokuje Aktywa Subfunduszy w jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych lub tytuły uczestnictwa funduszu zagranicznego lub instytucji wspólnego inwestowania, o której mowa w ust. 4, zarządzanych przez Towarzystwo lub podmiot z grupy kapitałowej Towarzystwa, Towarzystwo lub podmiot z grupy kapitałowej Towarzystwa nie pobiera opłat za zbywanie i odkupywanie tych jednostek uczestnictwa, certyfikatów inwestycyjnych lub tytułów uczestnictwa.

8. Zgodnie z polityką inwestycyjną określoną dla Subfunduszy, Fundusz może zawierać umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, pod warunkiem że:

- a) takie Instrumenty Pochodne są przedmiotem obrotu na rynku regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub Państwie Członkowskim, z zastrzeżeniem Niewystandaryzowanych Instrumentów Pochodnych, oraz
- b) umowa ma na celu zapewnienie sprawnego zarządzania portfelem inwestycyjnym danego Subfunduszu lub ograniczenie ryzyka inwestycyjnego związanego ze zmianą:
 - i. kursów, cen lub wartości papierów wartościowych i Instrumentów Rynku Pieniężnego, posiadanych przez Subfundusz, albo papierów wartościowych i Instrumentów Rynku Pieniężnego, które Subfundusz zamierza nabyć w przyszłości,
 - ii. kursów walut w związku z lokatami Funduszu,
 - iii. wysokości stóp procentowych w związku z lokatami w depozyty, dłużne papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego oraz aktywami utrzymywanymi na zaspokojenie bieżących zobowiązań Subfunduszy,
- c) zawarcie umowy będzie zgodne z celem inwestycyjnym danego Subfunduszu określonym w Części II Statutu,
- d) w celu sprawnego zarządzania portfelem inwestycyjnym wykorzystywane będą Instrumenty Pochodne wymienione w ust. 9, przy czym przy wyborze poszczególnych instrumentów Fundusz będzie kierował się kryteriami płynności oraz podnoszenia stopy zwrotu,
- e) warunkiem zastosowania Instrumentów Pochodnych jest aby portfel inwestycyjny Subfunduszu z uwzględnieniem ekspozycji na instrumentach stanowiących bazę utrzymywaną w portfelu Subfunduszu Instrumentów Pochodnych spełniał założenia realizowanej polityki inwestycyjnej Subfunduszu, a w szczególności aby nie naruszał ograniczeń i limitów inwestycyjnych dotyczących poszczególnych składników lokat Subfunduszu.

9. Fundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot następujące Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne:

- a) notowane na rynku regulowanym kontrakty terminowe na uznane indeksy giełdowe,
- b) notowane na rynku regulowanym kontrakty terminowe na akcje,
- c) notowane na rynku regulowanym kontrakty terminowe na obligacje,

- d) kontrakty zamiany stopy procentowej (interest rate swap),
- e) kontrakty terminowe na stopę procentową (forward rate agreement).
- f) opcje na stopy procentowe (interest rate option),
- g) kontrakty terminowe na waluty (currency forward, currency futures),
- h) opcje na waluty (currency option),
- i) kontrakty zamiany walut (currency swap),
- j) kontrakty zamiany walut i stóp procentowych (currency interest rate swap).

10. Przy stosowaniu limitów inwestycyjnych, o których mowa w art. 11 Statutu, Fundusz uwzględnia wartość papierów wartościowych lub Instrumentów Rynku Pieniężnego stanowiących bazę Instrumentów Pochodnych.

11. Przepisu ust. 10 nie stosuje się w przypadku Instrumentów Pochodnych, których bazę stanowią uznane indeksy.

12. Jeżeli papier wartościowy lub Instrument Rynku Pieniężnego zawiera wbudowany Instrument Pochodny, wartość instrumentu uwzględnia się przy stosowaniu przez Fundusz limitów inwestycyjnych.”

2. w art. 50 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

3. w art. 56 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

4. w art. 63 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

5. w art. 71 ust. 2:

„2. Fundusz może inwestować do 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe, tj. akcje, obligacje zamienne na akcje oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

6. w art. 77 ust. 3:

„3. W zakresie inwestycji Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne nie stosuje się postanowień art. 9 ust. 9 lit. a) i b).”

7. w art. 84 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 70% (siedemdziesiąt procent) WAN Funduszu w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

8. w art. 91 ust. 4:

„4. W zakresie inwestycji Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne nie stosuje się postanowień art. 9 ust. 9 lit. a) i b).”

9. w art. 97 ust. 3:

„3. W zakresie inwestycji Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne nie stosuje się postanowień art. 9 ust. 9 lit. a) i b).”

10. w art. 103 ust. 4:

„4. W zakresie inwestycji Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne nie stosuje się postanowień art. 9 ust. 9 lit. a) i b).”

11. w art. 109 ust. 2:

„2. Fundusz może inwestować do 40% (czterdzieści procent) WANS w instrumenty udziałowe, tj. akcje, obligacje zamienne na akcje oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

12. w art. 115 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 50% (pięćdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

13. w art. 121 ust. 3:

„3. Fundusz może inwestować nie mniej niż 50% (pięćdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe wskazane w ust. 1 oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

14. w art. 127 ust. 2:

„2. Fundusz może inwestować do 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w instrumenty udziałowe, tj. akcje, obligacje zamienne na akcje, a także w instrumenty finansowe o podobnym poziomie ryzyka emitowane przez spółki lub instytucje wspólnego inwestowania, które prowadzą działalność lub dokonują lokat w wyselekcjonowanych sektorach gospodarki lub w wybranych regionach geograficznych wskazanych zgodnie z ust. 4, oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

15. w art. 133 ust. 8:

„8. Fundusz może inwestować do 50% (pięćdziesięciu procent) WANS w instrumenty udziałowe, tj.: akcje i obligacje zamienne na akcje, a także w instrumenty finansowe o podobnym poziomie ryzyka emitowane przez spółki lub instytucje wspólnego inwestowania, oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”

16. w art. 139 ust. 8:

„8. Fundusz może inwestować do 50% (pięćdziesięciu procent) WANS w instrumenty udziałowe, tj.: akcje i obligacje zamienne na akcje, a także w instrumenty finansowe o podobnym poziomie ryzyka emitowane przez spółki lub instytucje wspólnego inwestowania, oraz w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 9 ust. 9 lit. a)–b) Statutu. Udział kontraktów terminowych liczony jest według wartości kontraktu terminowego rozumianego jako iloczyn mnożnika i kursu kontraktu terminowego.”