

Zmiana statutu BPH FIZ Bezpieczna Inwestycja 4

19-02-2014

BPH Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 5 Ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych (Dz. U. Nr 146, poz. 1546, z późn. zm.) niniejszym ogłasza zmiany statutu BPH Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Bezpieczna Inwestycja 4 („Fundusz”):

1) w art. 19 Statutu po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu określonym poniżej:

„2a. Fundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot następujące Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne:

- a) kontrakty terminowe na indeksy giełdowe,
- b) kontrakty terminowe, dla których bazę stanowią dłużne papiery wartościowe, Instrumenty Rynku Pieniężnego, kursy walut, stopy procentowe (bond futures, currency forward, currency futures, forward rate agreement),
- c) opcje, dla których bazę stanowią kursy walut, stopy procentowe lub indeksy giełdowe (currency options, interest rate options, index options),
- d) transakcje wymiany płatności walutowych lub odsetkowych (FX swap, interest rate swap, currency interest rate swap).”;

2) w art. 19 Statutu ust. 4 otrzymuje brzmienie określone poniżej:

„4. W celu ograniczenia ryzyk wymienionych w ust. 3, Fundusz będzie nabywał Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, wyłącznie z zachowaniem następujących warunków:

- a) instrumentami bazowymi dla Instrumentów Pochodnych, w tym Niewystandaryzowanych Instrumentów Pochodnych wchodzących w skład portfela inwestycyjnego Funduszu mogą być wyłącznie: indeksy giełdowe, o których mowa w § 9 Rozporządzenia w Sprawie Instrumentów Pochodnych, dłużne papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego, kursy walut oraz stopy procentowe;
- b) Fundusz będzie dokonywał lokat w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, w celu realizacji polityki inwestycyjnej Funduszu, w szczególności: w celu zabezpieczenia portfela inwestycyjnego Funduszu przed spadkiem wartości poszczególnych jego składników, w przypadku niedostatecznej dla realizowania polityki inwestycyjnej płynności instrumentów bazowych, oraz w celu uzyskania ekspozycji na akcje w sytuacjach opisanych w ust. 1 powyżej oraz w związku z wykorzystywaniem techniki arbitrażowej opisanej w ust. 2 powyżej;

c) łączna ekspozycja na instrumentach bazowych uzyskana poprzez bezpośrednie lokowanie w te instrumenty oraz poprzez zajęcie pozycji na Instrumentach Pochodnych, w tym Niewystandaryzowanych Instrumentach Pochodnych, nie będzie przekraczać zgodnego z prawem i Statutem poziomu ekspozycji dotyczącego tych instrumentów bazowych, w szczególności maksymalna ekspozycja na akcje wynikająca z posiadanych w portfelu Fundusz akcji oraz zajętych pozycji na kontraktach terminowych na WIG20 nie będzie przekraczać 40% (czterdzieści procent) WAN Funduszu;

d) w przypadku nabywania Niewystandaryzowanych Instrumentów Pochodnych:

i) transakcje mogą być dokonywane wyłącznie z bankami, z którymi Fundusz podpisał odpowiednią umowę szczegółowo regulującą sposób przeprowadzania i rozliczania transakcji oraz postępowania w przypadku niewypłacalności jednej ze stron umowy;

ii) Fundusz nie może zawierać kolejnych transakcji z bankiem, jeżeli wartość ryzyka kontrahenta dla tego banku - wyznaczana jako wartość ustalonego przez Fundusz niezrealizowanego zysku na transakcjach z tym kontrahentem, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne – przekracza 10% (dziesięć procent) Wartości Aktywów Netto Funduszu;

iii) dany Niewystandaryzowany Instrument Pochodny powinien być kwotowany z co najmniej miesięczną częstotliwością, przy czym różnica pomiędzy kwotowaną ceną kupna i kwotowaną ceną sprzedaży nie może przekraczać 5% (pięć procent) wartości nominalnej Niewystandaryzowanego Instrumentu Pochodnego z Dnia Wyceny;

iv) instrumenty te podlegają codziennie możliwej do zweryfikowania wycenie według wartości godziwej.”;

3) w art. 19 Statutu po ust. 5 dodaje się ust. 6 w brzmieniu określonym poniżej:

„6. Dokonując lokat w Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, Fundusz kieruje się kryteriami takimi jak: zgodność instrumentów bazowych ze strategią i celem inwestycyjnym Funduszu, płynność notowań, dostępność, efektywność rozumianą jako zgodność zmiany wartości Instrumentu Pochodnego z oczekiwaną zmianą wartości instrumentu bazowego oraz koszty ponoszone w celu zajęcia pozycji na Instrumentach Pochodnych w relacji do kosztów ponoszonych w celu nabycia lub sprzedaży instrumentu bazowego.”

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 1 – 3 powyżej nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego.

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 1 - 3 wchodzi w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ogłoszenia tj. z dniem 20 maja 2014 r.