

بيان صحفى

البورصة تدشن

متساوي الأوزان لتتويج أدوات قياس أداء السوق EWI EGX70 مؤشر

بداية من أغسطس EWI EGX50 و EWI EGX70 على مؤشرى EGX30 تعميم منهجية اختيار الشركات بمؤشر

يستهدف اتباع المنهجيات المتعارف عليها ليعكس أداء الشركات بطريقة أفضل EWI EGX70: فريد

متساوي الأوزان، وهو مؤشر يقيس أداء أفضل 70 شركة في EWI EGX70 تدشن البورصة المصرية الأحد المقبل مؤشر جديد، EWI EGX70 وإلغاء المؤشر الحالي، EWI EGX30 البورصة المصرية من حيث قيمة السيولة والنشاط بعد استبعاد الشركات المكونة لمؤشر. وبما يتوافق مع أفضل الممارسات الدولية في مجال إدارة مؤشرات أسواق الأوراق المالية ابتداءً من 2 يناير 2008 بقيمة 1000 نقطة، وتحصل كل شركة مدرجة EWI EGX70 تم احتساب المؤشر الجديد الذي يعتبر بديلاً لمؤشر على نفس الوزن النسبي وهو حوالي 1,43% في أول أيام المراجعة الدورية EWI EGX 70 بمؤشر كما أقرت لجنة المؤشرات بالبورصة المصرية، تعديل منهجية إدراج الشركات بالمؤشرات بحيث يتم اختيار الشركات المكونة لمؤشر على أن يتم العمل به EWI EGX30 كما هو معمول به في مؤشر البورصة المصرية الرئيسي EWI EGX50 ومؤشر ، EWI EGX70 إدراج الشركات «EGX30» اعتباراً من شهر أغسطس 2020، حيث راعت إدارة البورصة خلال عملية تطويرها لمنهجية مؤشر التي تحقق قيم تداول مرتفعة بشكل شهري بدلاً من الاعتداد بإجمالي قيم التداول بنهاية فترة المراجعة كل 6 أشهر، والتي كان من الممكن أن تتضمن انضمام شركات التي تحقق طفرات في قيم التداول ولكن بصورة غير مستمرة من جانبه قال محمد فريد رئيس البورصة المصرية، إن منهجية احتساب المؤشر الجديد هي أحد المناهج المتبعة من قبل العديد من المؤسسات العالمية التي تصدر مؤشرات تعكس أداء الشركات المكونة للمؤشر بصورة أكثر تعبيراً عن أدائها السعري ويتيح المؤشر الجديد إمكانية استحداث منتجات مالية كصناديق مؤشرات، حيث أن المؤشر الجديد يعد أداة جيدة تستطيع المؤسسات وكذلك يتماشى المؤشر مع متطلبات، INDEX TRACKING الاستثمارية استهدافها لإصدار صناديق استثمار تتبع المؤشر العاملين في السوق، خاصة مديري صناديق الاستثمار الذين يرغبون في وجود مؤشر مرجعي متساوي الأوزان وهو ما يسهم في الترويج لوثائقها

من شأن المؤشر الجديد أن يساعد في تعزيز فرص نمو وتطور صناعة صناديق الاستثمار عبر تنويع الخيارات الاستثمارية أمامهم وتمكينهم من دقة قياس أداء محافظهم التي تستهدف المؤشر وعقدت إدارة البورصة حواراً مع كافة أطراف السوق الفاعلة حول المؤشر الجديد، والتي انتهت إلى احتياج السوق لمؤشر جديد متساوي الأوزان، واستكملت البورصة متطلبات البنية الفنية واختبارات المؤشر على نظام التداول الإلكتروني، اللازمة لإطلاقه نهائياً والمقرر له الأحد المقبل الموافق 2 فبراير 2020

وتأتى هذه الخطوة استكمالاً لخطة التطوير الشاملة التي تنفذها إدارة البورصة على كافة مؤشرات، حرصاً منها على تطوير أدوات السوق ومؤشراتها، لتلبي رغبات العديد من الأطراف الفاعلة في سوق الأوراق المالية المصري يضم أنشط 30 شركة من، "EGX30 CAPPED" وكانت البورصة المصرية قد دشنت فبراير 2019، مؤشر جديد محدد الأوزان حيث السيولة والنشاط، فيما يحدد رأس المال السوقي المرجح بنسبة الأسهم حرة التداول وزن كل شركة داخل المؤشر بأنه محدد الأوزان، حيث تضع قواعده حداً أقصى لوزن كل شركة داخل المؤشر 15% عند "EGX30 Capped" يتميز مؤشر المراجعة ربع السنوية للأوزان بهدف الحد من سيطرة عدد محدود من الشركات على حركة المؤشر في مجمله مع التعديلات الأخيرة التي طرأت على الباب الثالث باللائحة التنفيذية لقانون سوق رأس المال EWI EGX30 Capped وتتسق منهجية الصادر بالقانون رقم 95 لسنة 1992 الخاص بالسياسات الاستثمارية لصناديق الاستثمار، الأمر الذي يساعد مديري الاستثمار والمساهمين على قياس أدائها

وتتفق منهجية المؤشر مع المادة 174 (السياسة الاستثمارية للصندوق) من الفصل الثاني (صناديق الاستثمار) والتي تنص على " ألا تزيد نسبة ما يستثمر في شراء أوراق مالية لشركة واحدة على 15% من صافي أصول الصندوق وبما لا يتجاوز 20% من الأوراق المالية لتلك الشركة"، وذلك تحديداً للمادة رقم 149 من الفصل الثاني (صناديق الاستثمار) من الباب الثالث من اللائحة التنفيذية لقانون سوق المال الصادر بالقانون رقم 95 لعام 1992

ونصت على أن "يكون استثمار أموال صندوق الاستثمار في الأوراق المالية في الحدود ووفقاً للشروط التي أقرت بالآلا تزيد نسبة ما يستثمر في شراء أوراق مالية لشركة واحدة على 10% من أموال الصندوق وبما لا يتجاوز 15% من أوراق تلك الشركة

لأنشط 30 شركة للعائد الكلي، ليعكس أثر توزيعات «EGX30 TR» ودشنت البورصة أيضا خلال شهر أغسطس عام 2019 مؤشراً الأرباح النقدية على أداء السوق، وهو ما لم يكن متاحاً قبل هذا المؤشر الذي يعكس التحركات السعرية للأسهم المكونة للمؤشر مضافاً إليها الأثر الإيجابي لتوزيعات الأرباح النقدية لتعكس أداء السوق بصورة أشمل.

وفي يناير عام 2020 انتهت إدارة البورصة من عملية تطوير شاملة لكافة المؤشرات القطاعية، وذلك في ضوء الهيكلة الواسعة التي أجرتها على جميع القطاعات، وإعادة توييب وتسكين للشركات المدرجة، وانتهت عملية المراجعة والتطوير إلى إصدار ١٧ مؤشراً قطاعياً بدلاً من ١٢ قبل هيكلة القطاعات، حيث تم استحداث مؤشرات قطاعية جديدة أهمها مؤشر لقطاع الخدمات التعليمية وخدمات النقل والشحن، وتستهدف إدارة البورصة من تطوير المؤشرات القطاعية مساعدة كافة المتعاملين في قياس الأداء السعري للشركات التابعة لكل قطاع وذلك بغرض إحداث قدر كبير من تكافؤ الفرص بين الشركات العاملة بذات النشاط.