

بيان صحفى : البورصة تدشن مؤشر جديد متساوي الأوزان "EGX 100 EWI" لتتويج أدوات قياس أداء السوق

تعميم منهجية اختيار الشركات بمؤشر EGX30 على مؤشري EGX70 EWI و EGX50EWI و EGX100EWI بداية من أغسطس

فريد: EGX 100 EWI يستهدف اتباع المنهجيات المتعارف عليها ليعكس أداء الشركات بطريقة أفضل

تدشن البورصة المصرية الأحد المقبل مؤشر جديد مؤشر جديد متساوي الأوزان "EGX 100 EWI" ، وهو مؤشر يقيس أداء أفضل 100 شركة في البورصة المصرية من حيث السيولة والنشاط متضمنة الشركات المكونة لمؤشر EGX30 والشركات المكونة لمؤشر EGX70 EWI وإلغاء المؤشر الحالي EGX 100 ، وبما يتوافق مع أفضل الممارسات الدولية في مجال إدارة مؤشرات أسواق الأوراق المالية.

تم احتساب المؤشر الجديد الذي يعتبر بديلاً لمؤشر EGX 100 ابتداءً من 2 يناير 2006 بقيمة 1000 نقطة، وتحصل كل شركة مدرجة بمؤشر EGX 100 EWI على نفس الوزن النسبي وهو حوالي 1% في أول أيام المراجعة الدورية.

كما أقرت لجنة المؤشرات بالبورصة المصرية، تعديل منهجية إدراج الشركات بالمؤشرات بحيث يتم اختيار الشركات المكونة لمؤشر EGX 100 EWI، ومؤشر EGX70 EWI ، ومؤشر EGX50 EWI كما هو معمول به في مؤشر البورصة المصرية الرئيسي EGX30 على أن يتم العمل به اعتباراً من شهر أغسطس 2020، حيث راعت إدارة البورصة خلال عملية تطويرها لمنهجية مؤشر «EGX30» إدراج الشركات التي تحقق قيم تداول مرتفعة بشكل شهري بدلاً من الاعتماد 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 الاستثمارية استهدافها لإصدار صناديق استثمار تتبع المؤشر INDEX TRACKING، وكذلك يتماشى المؤشر مع متطلبات العاملين في السوق، خاصة مديري صناديق الاستثمار الذين يرغبون في وجود مؤشر مرجعي متساوي الأوزان وهو ما يساهم 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 10 مايو 2020.

وتأتى هذه الخطوة استكمالاً لخطة التطوير الشاملة التي تنفذها إدارة البورصة على كافة مؤشرات، حرصاً منها على تطوير أدوات السوق ومؤشراته، لتلبى رغبات العديد من الأطراف الفاعلة في سوق الأوراق المالية المصري.

وكانت البورصة المصرية قد دشنت فبراير 2019، مؤشر جديد محدد الأوزان "EGX30 CAPPED" ، يضم أنشط 30 شركة من حيث السيولة والنشاط، فيما يحدد رأس المال السوقي المرجح بنسبة الأسهم حرة التداول وزن كل شركة داخل المؤشر، وذلك بحد أقصى 15% للشركة الواحدة.

يتميز مؤشر "EGX30 Capped" بأنه محدد الأوزان، حيث تضع قواعده حداً أقصى لوزن كل شركة داخل المؤشر 15% عند المراجعة ربع السنوية للأوزان بهدف الحد من سيطرة عدد محدود من الشركات على حركة المؤشر في مجمله. وتتسق منهجية EGX30 Capped مع التعديلات الأخيرة التي طرأت على الباب الثالث باللائحة التنفيذية لقانون سوق رأس المال 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.

ودشنت البورصة أيضاً خلال شهر أغسطس عام 2019 مؤشراً «EGX30 TR» لأنشط 30 شركة للعائد الكلي، ليعكس أثر توزيعات الأرباح النقدية على أداء السوق، وهو مالم 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 الهيكل الواسعة التي أجرتها على جميع القطاعات، وإعادة توييب وتسكين للشركات المدرجة، وانتهت عملية المراجعة والتطوير إلى إصدار 17 مؤشراً قطاعياً بدلاً من 12 قبل هيكل 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.

وكانت البورصة قد دشنت خلال شهر فبراير عام 2020 مؤشر جديد EGX70 EWI متساوي الأوزان، وهو مؤشر يقيس أداء أفضل 70 شركة في البورصة المصرية من حيث قيمة السيولة والنشاط بعد استبعاد الشركات المكونة لمؤشر EGX30، وإلغاء المؤشر الحالي EGX70، وبما يتوافق مع أفضل الممارسات الدولية في مجال إدارة مؤشرات أسواق الأوراق المالية.

ولمزيد من المعلومات حول منهجية وأهداف مؤشر EGX 100 EWI متساوي الأوزان يمكنكم مطالعة الكتيب التعليمي الاسترشادي من خلال الرابط التالي على الموقع الإلكتروني للبورصة المصرية:

<https://www.egx.com.eg/ar/IndexRulesMethodologyEGX100-EWI.aspx?Nav=4>

ولمزيد من التوضيح برجاء مشاهدة الفيديو التعريفي حول منهجية وأهداف المؤشر الجديد من خلال الرابط التالي:

https://www.youtube.com/watch?v=FF36hozV_J0&feature=youtu.be