

Protokół
zmian w Prospekcie Millennium Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego
Otwartego (z wydzielonymi subfunduszami)
z dnia 28 października 2015 roku.

W związku z wymogami zawartymi w §10 Rozporządzenia Rady Ministrów z dnia 22 maja 2012 r. w sprawie prospektu informacyjnego funduszu inwestycyjnego otwartego i specjalistycznego funduszu inwestycyjnego otwartego oraz wyliczania wskaźnika zysku do ryzyka tych funduszy, Prospekt został zmieniony w następujący sposób:

1. Na stronie tytułowej dodaje się datę bieżącej aktualizacji: 28 października 2015r.
2. Rozdział 3 („DANE O FUNDUSZU”):
SUBFUNDUSZ ABSOLUTE RETURN punkt 2, ust. 1 otrzymuje następujące brzmienie:
„Subfundusz inwestuje nie mniej niż -20% i nie więcej niż 150% aktywów w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych, akcje oraz dłużne papiery wartościowe. Obowiązujący limit uwzględnia otwarte pozycje netto na kontrakty futures, których instrumentem bazowym są indeksy bądź akcje. Część akcyjna Subfunduszu może składać się zarówno z dużych spółek wchodzących w skład indeksu WIG20, jak również małych i średnich spółek oraz spółek notowanych na giełdach zagranicznych. Dodatkowo część portfela może być budowana w oparciu o instrumenty pochodne, dla których bazą są przede wszystkim uznane polskie lub zagraniczne indeksy oraz akcje.”
3. W Rozdziale 7 (ZAŁĄCZNIKI), w Załączniku nr. 2 „STATUT MILLENNIUM SPECJALISTYCZNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO OTWARTEGO” zmienia się w następujący sposób:
 1. W § 36 w ust. 3 pkt 3) po lit. d) skreśla się dotychczasową treść od słów „pod warunkiem, że” do słów „instytucji wspólnego inwestowania”. Dodatkowo, w lit. d) po słowach „i półrocznych sprawozdań finansowych” stawia się kropkę.
 2. § 39 otrzymuje następujący tytuł:

„ZASADY DYWERSYFIKACJI LOKAT ORAZ INNE OGRANICZENIA INWESTYCYJNE”.

3. **§ 39 ust. 3** otrzymuje brzmienie:

„3. Przepisów ust. 1 i 2, nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym.”.

4. **§ 39 ust. 5** otrzymuje brzmienie:

„5. Fundusz może lokować do 20% wartości Aktywów Subfunduszu łącznie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez podmioty należące do grupy kapitałowej, przy czym Fundusz nie może lokować więcej niż 10% wartości Aktywów Subfunduszu, w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot należący do grupy kapitałowej, z uwzględnieniem postanowień ust. 2. Podmioty należące do grupy kapitałowej traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot. Przez grupę kapitałową rozumie się grupę kapitałową w rozumieniu ustawy o rachunkowości (Dz. U. 2013.330 t.j.) dla której sporządzane jest skonsolidowane sprawozdanie finansowe.”.

5. **§ 39** do słów „lokowane w:”, otrzymuje brzmienie:

„28. Aby zapewnić płynność portfela Subfunduszu, nie mniej niż 25% Aktywów Netto Subfunduszu będzie lokowane w:”

6. **§ 65 ust 2** utrzymuje następujące brzmienie:

„2. Środki Subfunduszu są lokowane głównie w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych, akcje oraz dłużne papiery wartościowe. Subfundusz może inwestować część środków w inne instrumenty finansowe.”

7. **W § 66** w ust. 3 pkt. 3) po lit. d) skreśla się dotychczasową treść od słów „pod warunkiem, że” do słów „instytucji wspólnego inwestowania”. Dodatkowo, w lit. d) po słowach „i półrocznych sprawozdań finansowych” stawia się kropkę.

8. **§ 68 ust 4** otrzymuje brzmienie:

„4. Dokładny udział lokat Aktywów Subfunduszu w poszczególnych rodzajach instrumentów finansowych w ramach limitów określonych w § 69 będzie uzależniony od decyzji podejmowanych przez Fundusz na podstawie analiz dotyczących w szczególności: 1) oceny bieżącej sytuacji na rynku akcji i dłużnych papierów wartościowych, 2) przewidywań odnośnie rozwoju sytuacji na rynku akcji i dłużnych papierów wartościowych w przyszłości, w szczególności w zakresie kształtowania się cen akcji oraz rentowności dłużnych papierów wartościowych.”

9. § 69 ust. 3 otrzymuje brzmienie:

"3. Przepisów ust. 1 i 2, nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym.”.

10. § 69 ust. 5 otrzymuje brzmienie:

„5. Fundusz może lokować do 20% wartości Aktywów Subfunduszu łącznie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez podmioty należące do grupy kapitałowej, przy czym Fundusz nie może lokować więcej niż 10% wartości Aktywów Subfunduszu, w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot należący do grupy kapitałowej, z uwzględnieniem postanowień ust. 2. Podmioty należące do grupy kapitałowej traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot. Przez grupę kapitałową rozumie się grupę kapitałową w rozumieniu ustawy o rachunkowości (Dz. U. 2013.330 t.j.) dla której sporządzane jest skonsolidowane sprawozdanie finansowe.”.

11. § 79 ust. 4 otrzymuje brzmienie:

"4. Przepisów ust. 2 i 3, nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym.”.

12. § 79 ust. 6 otrzymuje brzmienie:

„6. Fundusz może lokować do 20% wartości Aktywów Subfunduszu łącznie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane

przez podmioty należące do grupy kapitałowej, przy czym Fundusz nie może lokować więcej niż 10% wartości Aktywów Subfunduszu, w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot należący do grupy kapitałowej, z uwzględnieniem postanowień ust. 3. Podmioty należące do grupy kapitałowej traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot. Przez grupę kapitałową rozumie się grupę kapitałową w rozumieniu ustawy o rachunkowości (Dz. U. 2013.330 t.j.) dla której sporządzane jest skonsolidowane sprawozdanie finansowe.”.

13. **§ 89** otrzymuje następujący tytuł:

„ZASADY DYWERSYFIKACJI LOKAT ORAZ INNE OGRANICZENIA INWESTYCYJNE”.

14. **§ 89 ust. 4** otrzymuje brzmienie:

”4. Przepisów ust. 2 i 3, nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym.”.

15. **§ 89 ust. 6** otrzymuje brzmienie:

„6. Fundusz może lokować do 20% wartości Aktywów Subfunduszu łącznie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez podmioty należące do grupy kapitałowej, przy czym Fundusz nie może lokować więcej niż 10% wartości Aktywów Subfunduszu, w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot należący do grupy kapitałowej, z uwzględnieniem postanowień ust. 3. Podmioty należące do grupy kapitałowej traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot. Przez grupę kapitałową rozumie się grupę kapitałową w rozumieniu ustawy o rachunkowości (Dz. U. 2013.330 t.j.) dla której sporządzane jest skonsolidowane sprawozdanie finansowe.”.

16. **§ 119** otrzymuje następujący tytuł:

„ZASADY DYWERSYFIKACJI LOKAT ORAZ INNE OGRANICZENIA INWESTYCYJNE”.

17. **§ 119 ust. 4** otrzymuje brzmienie:

"4. Przepisów ust. 2 i 3, nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym."

18. § 119 ust. 6 otrzymuje brzmienie:

„6. Fundusz może lokować do 20% wartości Aktywów Subfunduszu łącznie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez podmioty należące do grupy kapitałowej, przy czym Fundusz nie może lokować więcej niż 10% wartości Aktywów Subfunduszu, w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot należący do grupy kapitałowej, z uwzględnieniem postanowień ust. 3. Podmioty należące do grupy kapitałowej traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot. Przez grupę kapitałową rozumie się grupę kapitałową w rozumieniu ustawy o rachunkowości (Dz. U. 2013.330 t.j.) dla której sporządzane jest skonsolidowane sprawozdanie finansowe."

Zmiany wchodzi w życie w dniu ogłoszenia.