

# OKRESOWA INFORMACJA DLA INWESTORA

## MILLENNIUM SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Niniejszy dokument „Okresowa Informacja dla Inwestora Millennium Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty” (dalej jako: **Informacja dla Inwestora**) sporządzony został na mocy art. 222b Ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2020 r., poz. 95)

**Data i miejsce sporządzenia Okresowej Informacji dla Inwestora:**

14 sierpnia 2020r., Warszawa

- 1) Procent aktywów AFI będących przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością:
  1. Fundusz nie posiada aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.
- 2) Od ostatniej publikacji okresowej informacji nie nastąpiła zmiana procedur zarządzania ryzykiem płynności.
- 3) Aktualny profil ryzyka :
  1. Subfundusz Obligacji Korporacyjnych (PLN): 3
  2. Subfundusz Obligacji Korporacyjnych (EUR): 4
  3. Subfundusz Obligacji Korporacyjnych (USD): 5
  4. Subfundusz Konserwatywny: 3
  5. Subfundusz Absolute Return (PLN): 4
  6. Subfundusz Absolute Return (EUR): 5
  7. Subfundusz Absolute Return (USD): 5
  8. Subfundusz Globalny Stabilnego Wzrostu (PLN): 4
  9. Subfundusz Globalny Stabilnego Wzrostu (EUR): 5
  10. Subfundusz Globalny Stabilnego Wzrostu (USD): 5
  11. Subfundusz Globalny Strategii Alternatywnych (PLN): 4
  12. Subfundusz Globalny Strategii Alternatywnych (EUR): 4
  13. Subfundusz Globalny Strategii Alternatywnych (USD): 5
  14. Subfundusz Globalny Akcji (PLN): 5
  15. Subfundusz Globalny Akcji (EUR): 6
  16. Subfundusz Globalny Akcji (USD): 6
- 4) Główne cechy systemu zarządzania ryzykiem AFI:
  1. W strukturze organizacyjnej Towarzystwa wyodrębniono Biuro Zarządzania Ryzykiem (BZR), które jest niezależne od jednostek Towarzystwa odpowiedzialnych za podejmowanie decyzji inwestycyjnych.
  2. Do głównych zadań BZR należą, m.in.:
    - i. Wdrażanie procesów, metod i procedur zarządzania ryzykiem.
    - ii. Monitorowanie aktualnego poziomu ryzyka Funduszu.
    - iii. Monitorowanie limitów inwestycyjnych Funduszu.
    - iv. Weryfikacja zgodności aktualnego poziomu ryzyka ponoszonego przez Fundusz z profilem ryzyka Funduszu.
  3. Rodzaje ryzyka monitorowane przez BZR obejmują w szczególności:
    - i. Ryzyko rynkowe.
    - ii. Ryzyko płynności.
    - iii. Ryzyko kredytowe, łącznie z ryzykiem kontrahenta.
    - iv. Ekspozycję AFI.
    - v. Ryzyko operacyjne.
- 5) Informacja odnośnie poziomu dźwigni finansowej:
  1. Maksymalny poziom dźwigni finansowe obliczanej metodą zaangażowania ustalono:
    - i. Subfundusz Absolute Return: 200% aktywów netto;
    - ii. Subfundusz Obligacji Korporacyjnych: 200% aktywów netto;

- iii. Subfundusz Globalny Strategii Alternatywnych: 150% aktywów netto;
  - iv. Subfundusz Globalny Stabilnego Wzrostu: 150% aktywów netto;
  - v. Subfundusz Globalny Akcji: 150% aktywów netto;
  - vi. Subfundusz Konserwatywny: 150% aktywów netto;
2. Fundusz nie wykorzystuje ponownie zabezpieczeń oraz nie posiada gwarancji udzielonych na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej.
3. Informacja odnośnie poziomu ekspozycji AFI za okres II kwartał 2020:

<i>Stan</i>	<i>Absolute Return</i>	<i>Globalny Akcji</i>	<i>Globalny Strategii Alternatywnych</i>	<i>Globalny Stabilnego Wzrostu</i>	<i>Obligacji Korporacyjnych</i>	<i>Konserwatywny</i>
<i>Stan na 30-06-2020</i>	111%	117%	113%	109%	111%	104%
<i>Min</i>	110%	78%	102%	107%	111%	100%
<i>Średnia</i>	114%	111%	108%	114%	148%	105%
<i>Max</i>	119%	118%	116%	124%	168%	111%
<i>Limit (max)</i>	200%	150%	150%	150%	200%	150%