

**Protokół zmian
z dnia 12 lipca 2021.
w Prospekcie Informacyjnym Millennium Specjalistycznego
Funduszu Inwestycyjnego Otwartego
(z wydzielonymi subfunduszami)**

W związku z wymogami zawartymi w Rozporządzeniu Ministra Finansów z dnia 22 maja 2013 r. w sprawie prospektu informacyjnego funduszu inwestycyjnego otwartego i specjalistycznego funduszu inwestycyjnego otwartego oraz wyliczania wskaźnika zysku do ryzyka tych funduszy oraz Rozporządzeniu Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 13 października 2017 r. zmieniającego rozporządzenie w sprawie prospektu informacyjnego funduszu inwestycyjnego otwartego i specjalistycznego funduszu inwestycyjnego otwartego oraz wyliczania wskaźnika zysku do ryzyka tych funduszy, Prospekt Informacyjny Millennium Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego (dalej również jako: „Prospekt”) został zmieniony w następujący sposób:

1. Na stronie tytułowej zmienia się zapis:

datę bieżącej aktualizacji: 12 lipca 2021 roku.
data ostatniego tekstu jednolitego: 12 lipca 2021 roku.

2. W Rozdziale 3 w ust. 12 pkt 4 ppkt 2 zmienia się lit. d, która otrzymuje następujące brzmienie:

„d) w przypadku dłużnych papierów wartościowych - mają zastosowanie zasady określone w ust. 8 pkt 3,”;

3. W Rozdziale 3 w ust. 12 pkt 8 zmienia się ppkt 3, który otrzymuje następujące brzmienie:

„3) w przypadku dłużnych papierów wartościowych - w wartości godziwej z zastosowaniem modeli matematycznych, a dłużne papiery wartościowe, których pierwotny termin zapadalności jest nie dłuższy niż 92 dni, wycenia się w skorygowanej cenie nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej z uwzględnieniem odpisów z tytułu utraty wartości składnika aktywów,”;

4. W Rozdziale 3 w ust. 12 pkt 8 zmienia się ppkt 5, który otrzymuje następujące brzmienie:

„5) w przypadku instrumentów pochodnych - w wartości godziwej przy zastosowaniu modeli powszechnie stosowanych dla danego typu lokat, przy czym parametry wejściowe do wyceny będą pobierane z aktywnego rynku:

- a) kontrakty terminowe - modelu zdyskontowanych przepływów pieniężnych,
- b) opcje - modelu Blacka - Scholesa,
- c) kontrakty wymiany typu „swap” i transakcje typu „forward” - modelu zdyskontowanych przepływów pieniężnych.”;

5. W Rozdziale 3 w ust. 12 zmienia się pkt 9-10, które otrzymują następujące brzmienie:

„9. Transakcje reverse repo / buy-sell back i depozyty bankowe, wycenia się począwszy od dnia ujęcia w księgach za pomocą modelu wyceny, a w przypadku transakcji o terminie zapadalności nie dłuższym niż 92 dni dopuszcza się wycenę metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej z uwzględnieniem odpisów z tytułu utraty wartości składnika aktywów.

10. Transakcje repo/sell-buy back wycenia się począwszy od dnia ujęcia w księgach przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.”;

6. Aktualizacji podlega „OŚWIADCZENIE PODMIOTU UPRAWNIONEGO DO BADANIA SPRAWOZDAŃ FINANSOWYCH”.

7. W pozostałym zakresie Prospekt pozostaje bez zmian.