

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:

8 marca 2022 r., Warszawa

- 1) Procent aktywów AFI będących przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich nie płynnością:
 1. Fundusz nie posiada aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich nie płynnością.
- 2) Od ostatniej publikacji okresowej informacji nie nastąpiła zmiana procedur zarządzania ryzykiem płynności.
- 3) Aktualny profil ryzyka :
 - 1 Subfundusz Multistrategia (EUR) :5
 - 2 Subfundusz Multistrategia :4
 - 3 Subfundusz Multistrategia (USD) :5
 - 4 Subfundusz Obligacji Globalnych (EUR) :4
 - 5 Subfundusz Obligacji Globalnych :3
 - 6 Subfundusz Obligacji Globalnych (USD) :5
 - 7 Subfundusz Plan Aktywny (EUR) :6
 - 8 Subfundusz Plan Aktywny :6
 - 9 Subfundusz Plan Aktywny (USD) :6
 - 10 Subfundusz Plan Spokojny :3
 - 11 Subfundusz Plan Wyważony (EUR) :5
 - 12 Subfundusz Plan Wyważony :4
 - 13 Subfundusz Plan Wyważony (USD) :5
 - 14 Subfundusz Top Sectors (EUR) :6
 - 15 Subfundusz Top Sectors :5
 - 16 Subfundusz Top Sectors (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 finansowej 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 IV kwartał 2021r. :

<i>Stan</i>	<i>Multistrategia</i>	<i>Plan Aktywny</i>	<i>Top Sectors</i>	<i>Plan Wyważony</i>	<i>Obligacji Globalnych</i>	<i>Plan Spokojny</i>
Stan na 31-12-2021	108%	110%	110%	107%	124%	100%
Min	107%	104%	106%	105%	124%	100%
Średnia	110%	112%	121%	110%	130%	105%
Max	115%	115%	148%	121%	135%	118%
Limit (max)	200%	150%	150%	150%	200%	150%