

# 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:**

12 maja 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 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 I kwartał 2022r. :

<i>Miesiąc</i>	<i>Multistrategia</i>	<i>Plan Aktywny</i>	<i>Top Sectors</i>	<i>Plan Wyważony</i>	<i>Obligacji Globalnych</i>	<i>Plan Spokojny</i>
<b>Styczeń</b>	108,31%	110,88%	117,37%	110,93%	125,52%	103,91%
<b>Luty</b>	107,96%	111,23%	120,59%	113,09%	127,83%	103,47%
<b>Marzec</b>	114,25%	114,20%	120,70%	123,89%	139,87%	110,02%
<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>
<b>Stan na 31-03-2022</b>	111%	109%	112%	117%	136%	104%
<b>Min</b>	106%	107%	110%	104%	123%	99%
<b>Średnia</b>	110%	112%	120%	116%	131%	106%
<b>Max</b>	118%	120%	136%	132%	162%	117%
<b>Limit (max)</b>	200%	150%	150%	150%	200%	150%