

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 września 2022 r., 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 Multistrategia (EUR) :5
- 2 Subfundusz Multistrategia :4
- 3 Subfundusz Multistrategia (USD) :6
- 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) :6
- 14 Subfundusz Top Sectors (EUR) :6
- 15 Subfundusz Top Sectors :6
- 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.
- vi. Ryzyko ESG.

5) Informacja odnośnie poziomu dźwigni finansowej:

1. Maksymalny poziom dźwigni finansowej obliczanej metodą zaangażowania ustalono:

- i. Subfundusz Multistrategia: 200% aktywów netto;
- ii. Subfundusz Obligacji Globalnych: 200% aktywów netto;

- iii. Subfundusz Top Sectors: 150% aktywów netto;
 - iv. Subfundusz Plan Wyważony: 150% aktywów netto;
 - v. Subfundusz Plan Aktywny: 150% aktywów netto;
 - vi. Subfundusz Plan Spokojny: 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 2022r. :

<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 30-06-2022	115%	110%	114%	129%	143%	115%
Min	109%	108%	110%	118%	115%	105%
Średnia	113%	111%	114%	125%	133%	112%
Max	118%	122%	126%	136%	144%	125%
Limit (max)	200%	150%	150%	150%	200%	150%