

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:

31 stycznia 2023 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) :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 :4
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 finansowe 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 III 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>
<i>Stan na 30-09-2022</i>	114%	117%	122%	132%	123%	125%
<i>Min</i>	110%	108%	113%	118%	118%	111%
<i>Średnia</i>	114%	114%	117%	127%	138%	119%
<i>Max</i>	124%	138%	123%	138%	151%	126%
<i>Limit (max)</i>	200%	150%	150%	150%	200%	150%