

**SPRAWOZDANIE ROCZNE
ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO**

**Millennium
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty**

za okres od 1 stycznia 2022 roku do 31 grudnia 2022 roku

OŚWIADCZENIE ZARZĄDU

Zgodnie z art. 222d ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. 2022 poz. 1523, z późn. zm.) Zarząd Millennium Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A., przedstawia sprawozdanie roczne alternatywnego funduszu inwestycyjnego, Millennium Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, na które składają się:

1. Bilans Funduszu sporządzony na dzień 31 grudnia 2022 r. wykazujący aktywa netto i kapitały w wysokości 1 260 290 tys. zł.
2. Rachunek wyniku z operacji za okres od 1 stycznia 2022 r. do 31 grudnia 2022 r. wykazujący dodatni wynik z operacji w kwocie -176 794 tys. zł.
3. Opis istotnych zmian informacji wymienionych w informacji dla klienta AFI, zgodny z art. 222d ust. 4 pkt 5.
4. Informację o liczbie pracowników i wynagrodzeniach, zgodny z art. 222d ust. 4 pkt 7
5. Informacja zgodna z art. 13 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012.
6. Sprawozdanie z działalności Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego, zgodne z art. 222d ust. 4 pkt 4.
7. Informacja, o której mowa w art. 11 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 2019/2088 z dnia 27 listopada 2019 r. w sprawie ujawnienia informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych.
8. Sprawozdanie z badania rocznego sprawozdania finansowego Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego, do którego załączone są:
 - 1) Sprawozdanie Finansowe Funduszu,
 - 2) List to uczestników Funduszu,
 - 3) Oświadczenie Depozytariusza.

Robert Borecki

Prezes Zarządu

Krzysztof Kamiński

Członek Zarządu

Dariusz Zawadzki

Członek Zarządu

I. BILANS

| POŁĄCZONY BILANS | 2022-12-31 | 2021-12-31 |
|--|------------------|------------------|
| I. Aktywa | 1 340 189 | 2 126 572 |
| 1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty | 140 750 | 219 244 |
| 2. Należności | 1 204 | 233 |
| 3. Transakcje reverse repo/buy-sell back | - | - |
| 4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku | 167 629 | 231 825 |
| 5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku | 1 030 606 | 1 675 270 |
| 6. Pozostałe aktywa | - | - |
| II. Zobowiązania | 79 899 | 36 959 |
| 1) Zobowiązania własne subfunduszy | 79 899 | 36 959 |
| 2) Zobowiązania proporcjonalne funduszu/subfunduszu | - | - |
| III. Aktywa netto (I - II) | 1 260 290 | 2 089 613 |
| IV. Kapitał Funduszu/Subfunduszu | 1 230 365 | 1 882 894 |
| 1. Kapitał wpłacony | 8 562 568 | 8 332 982 |
| 2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna) | -7 332 203 | -6 450 088 |
| V. Dochody zatrzymane | 46 261 | 123 296 |
| 1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto | 92 397 | 92 132 |
| 2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat | -46 136 | 31 164 |
| VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia | -16 336 | 83 423 |
| VII. Kapitał Funduszu/Subfunduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI) | 1 260 290 | 2 089 613 |

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

II. RACHUNEK ZYSKÓW I STRAT

| POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI | od 01-01-2022 do 31-12-2022 | od 01-01-2021 do 31-12-2021 |
|--|--|--|
| I. Przychody z lokat | 33 570 | 35 614 |
| Dywidendy i inne udziały w zyskach | 3 931 | 1 587 |
| Przychody odsetkowe | 19 778 | 7 103 |
| Przychody związane z posiadaniem nieruchomości | - | - |
| Dodatnie saldo różnic kursowych | 9 844 | 18 024 |
| Pozostałe | 17 | 8 900 |
| II. Koszty Funduszu/Subfunduszu | 33 305 | 38 346 |
| Wynagrodzenie dla Towarzystwa | 25 974 | 31 003 |
| - stała część wynagrodzenia | 25 974 | 31 003 |
| - zmienna część wynagrodzenia | - | - |
| Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję | - | - |
| Oplaty dla Depozytariusza | 530 | 520 |
| Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów Funduszu/Subfunduszu | - | - |
| Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne | - | - |
| Usługi w zakresie rachunkowości | 924 | 755 |
| Usługi w zakresie zarządzania aktywami Funduszu/Subfunduszu | - | - |
| Usługi prawne | - | - |
| Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne | - | - |
| Koszty odsetkowe | 3 524 | 6 002 |
| Koszty związane z posiadaniem nieruchomości | - | - |
| Ujemne saldo różnic kursowych | 2 353 | 66 |
| Pozostałe | - | - |
| III. Koszty pokrywane przez Towarzystwo | - | - |
| IV. Koszty Funduszu/Subfunduszu netto (II-III) | 33 305 | 38 346 |
| V. Przychody z lokat netto (I-IV) | 265 | -2 732 |
| VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata) | -177 059 | 51 841 |
| 1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat | -77 300 | -41 436 |
| 2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym: | -99 759 | 93 277 |
| - z tytułu różnic kursowych | -8 102 | 53 030 |
| VII. Wynik z operacji (V+-VI) | -176 794 | 49 109 |
| VIII. Podatek dochodowy | - | - |

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

**Opis istotnych zmian informacji
wymienionych w informacji dla klienta AFI**

Millennium

Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2022 roku

Zgodnie z wymaganiem art. 222d ust. 4 pkt 5 Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi z dnia 27 maja 2004 roku Towarzystwo informuje, iż w trakcie roku obrotowego, Towarzystwo wprowadziło następujące istotne zmiany w treści informacji dla klientów Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego:

— w dniu 29 lipca 2022 roku:

- 1) na stronie tytułowej datę sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Informacji dla Klienta, zastąpiono datą „29 lipca 2022 r.”;
- 2) pkt 19 otrzymał następujące brzmienie:
„19) Informacje ujawniane na podstawie Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2088 z dnia 27 listopada 2019 r. w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych („Rozporządzenie ESG”).”

Informacje ujawniane na podstawie Rozporządzenia ESG znajdują się w Prospekcie Rozdział 6 „Informacje dodatkowe” pkt 9 i 10.”

Informacja do sprawozdania rocznego AFI
Millennium
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2022 roku

Zgodnie z wymaganiem art. 222d ust. 4 pkt 7) Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi z dnia 27 maja 2004 roku Towarzystwo informuje:

- 1) Liczba pracowników Towarzystwa na dzień 31 grudnia 2022 roku wynosiła 36 osób fizycznych (30,16 etatów).
- 2) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 5 536 132,97 złotych.
- 3) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 955 895,90 złotych.
- 4) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom, których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 3 903 530,43 złotych.
- 5) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom, o których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 651 549,96 złotych.
- 6) Towarzystwo nie wypłacało wynagrodzenia dodatkowego ze środków Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego.

Zgodnie z art. 13 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 (Dz. Urz. UE 23.12.2015 L 337/1), na dzień bilansowy spółka zarządzająca UCITS prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Funduszu

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN)

Dane na dzień 31.12.2022

Dane ogólne:

| | |
|---|---|
| Kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki (z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów) | - |
| Kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego (wyrażona jako kwota bezwzględna w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania): | |
| Kwota bezwzględna w PLN | - |
| Odsetek zarządzanych aktywów | - |

Dane dotyczące koncentracji:

| | |
|---|---|
| 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy) | |
| 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia) | |
| Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów | - |
| Transakcje zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcje zwrotna sprzedaż-kupno | - |

Zbiornicze dane dotyczące transakcji:

| | |
|---|---|
| Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów | |
| Rodzaj i jakość zabezpieczeń | - |
| Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności | - |
| Waluta zabezpieczeń | - |
| Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności | - |
| Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby | - |
| Rozliczenie i rozrachunek | - |
| Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno | |
| Rodzaj i jakość zabezpieczeń | - |
| Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności | - |
| Waluta zabezpieczeń | - |
| Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności | - |
| Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby | - |
| Rozliczenie i rozrachunek | - |

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN)

Dane na dzień 31.12.2022

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

| | |
|--|---|
| Odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom | - |
| Zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych | - |

Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

| | |
|--|---|
| Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników. | |
| Liczba powierników | - |
| Powiernik | Kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie |

Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

| | |
|---|---|
| Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych rachunkach | - |
| Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wspólnych rachunkach | - |
| Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wszelkich innych rachunkach | - |

Dane dotyczące rentowności i kosztów:

| | od 01.01.2022 do 31.12.2022 | | | |
|---|-----------------------------|---------|--------|---------|
| | Rentowność | | Koszty | |
| Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów: | Kwota | Odsetek | Kwota | Odsetek |
| - Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania | - | - | - | - |
| - Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania | - | - | - | - |
| - Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”) | - | - | - | - |
| Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno: | Kwota | Odsetek | Kwota | Odsetek |
| - Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania | - | - | 3 | 100,00% |
| - Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania | - | - | - | - |
| - Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”) | - | - | - | - |

Millennium SFIO Subfundusz Plan Aktywny

Nazwa produktu: [uzupełnić] Identyfikator podmiotu prawnego: [uzupełnić] 259400KGGRFC3VS5C942
Aspekty środowiskowe lub społeczne

Zrównoważona inwestycja oznacza inwestycję w działalność gospodarczą, która przyczynia się do realizacji celu środowiskowego lub społecznego, o ile taka inwestycja nie wyrządza poważnych szkód względem żadnego celu środowiskowego lub społecznego, a spółki, w które dokonano inwestycji, stosują dobre praktyki w zakresie zarządzania.

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju jest to system klasyfikacji określony w rozporządzeniu (UE) 2020/852, ustanawiający wykaz zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Rozporządzenie to nie zawiera wykazu zrównoważonej społecznie działalności gospodarczej. Zrównoważone inwestycje, które służą celowi środowiskowemu, mogą być zgodne lub niezgodne z systematyką.

Wskaźniki zrównoważonego rozwoju stosuje się do pomiaru stopnia uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach produktu finansowego.

Czy niniejszy produkt finansowy służył celowi dotyczącemu zrównoważonych inwestycji? [zaznaczyć i wypełnić odpowiednio, wartość procentowa przedstawia minimalne zaangażowanie w zrównoważone inwestycje]

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="radio"/> Tak | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nie |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu środowiskowym: ____% <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo | <input type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne i chociaż jego celem nie była zrównoważona inwestycja, miał ____% udziału w zrównoważonych inwestycjach <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi społecznemu |
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu społecznym: ____% | <input checked="" type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne, ale nie miał udziału w zrównoważonych inwestycjach |

W jakim stopniu uwzględniono aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach tego produktu finansowego? [wymienić aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, w odniesieniu do zrównoważonych inwestycji służących celom środowiskowym, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, w ramach których prowadzono zrównoważone inwestycje służące celom społecznym, wymienić cele społeczne]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Jakie osiągnięto wartości wskaźników zrównoważonego rozwoju?

57,82% udział w Aktywach Netto Subfunduszu instrumentów finansowych, w tym w szczególności tytułów uczestnictwa funduszy zagranicznych które promują aspekty środowiskowe lub społeczne bądź które mają na celu zrównoważone inwestycje w rozumieniu art. 8 i 9 SFDR;
 81,75% udział pokrycia Aktywów Netto Subfunduszu oceną aspektów środowiskowych lub społecznych ustalaną wg metodologii wewnętrznej TFI na podstawie m.in. zewnętrznych ratingów ESG;
 67,56% udział Aktywów Netto Subfunduszu, dla których dostępne są dane dotyczące poziomu intensywności emisji CO₂, ekspozycji wobec firm działających w sektorze paliw kopalnych, naruszenia zasad opisanych w UN Global Compact i ekspozycji wobec kontrowersyjnej broni.

Główne niekorzystne skutki to najpoważniejsze niekorzystne skutki decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju, takie jak kwestie środowiskowe, społeczne i pracownicze, kwestie dotyczące poszanowania praw człowieka oraz przeciwdziałania korupcji i

- **...a w porównaniu z poprzednimi okresami?** [dotyczy sytuacji, gdy w odniesieniu do produktów finansowych przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe] Nie dotyczy.

- **Jakie były cele dotyczące zrównoważonych inwestycji, które miały być częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, i w jaki sposób zrównoważona inwestycja przyczyniła się do osiągnięcia tych celów?** [dotyczy produktów finansowych, w ramach których dokonywano zrównoważonych inwestycji; opisać cele, jeżeli nie zostały uwzględnione w odpowiedzi na poprzednie pytanie. Opisać, w jaki sposób zrównoważone inwestycje przyczyniły się do osiągnięcia celu zrównoważonych inwestycji. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

- **W jaki sposób zrównoważone inwestycje, które zostały częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, nie wyrządziły poważnych szkód względem jakiegokolwiek środowiskowego lub społecznego celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji?** [dotyczy sytuacji, gdy produkt finansowy obejmuje zrównoważone inwestycje]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

W jaki sposób uwzględniono wskaźniki dotyczące niekorzystnych skutków dla czynników zrównoważonego rozwoju?

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Czy zrównoważone inwestycje były zgodne z Wytycznymi OECD dla przedsiębiorstw wielonarodowych i Wytycznymi ONZ dotyczącymi biznesu i praw człowieka? Dodatkowe informacje:

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Inwestycje w ramach tego produktu nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.

[dodać oświadczenie w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju określa zasadę „nie czynić poważnych szkód”, zgodnie z którą inwestycje zgodne z systematyką nie powinny wyrządzać poważnych szkód względem celów unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju, a towarzyszą jej konkretne kryteria unijne.

Zasada „nie czynić poważnych szkód” stosowana jest wyłącznie w odniesieniu do tych inwestycji w ramach produktu finansowego, które uwzględniają unijne kryteria dotyczące zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Inwestycje w ramach pozostałej części tego produktu finansowego nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.



Czy w ramach tego produktu finansowego wzięto pod uwagę główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję, jeżeli produkt finansowy uwzględnił główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju].*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie główne inwestycje obejmuje ten produkt finansowy?

Wykaz zawiera inwestycje stanowiące największą część inwestycji w ramach tego produktu finansowego w okresie odniesienia, którym jest: *[uzupełnić]*

| Największe inwestycje | Sektor | % aktywów | Państwo |
|-----------------------|--------|-----------|---------|
|-----------------------|--------|-----------|---------|

| | | | |
|---|------------------|--------|--|
| BlackRock Sustainable Advantage US Equity Fund | Fundusze akcyjne | 16,56% | |
| JPMorgan Investment Funds - US Select Equity Fund | Fundusze akcyjne | 16,03% | |
| iShares US Index Fund D | Fundusze akcyjne | 10,21% | |
| Japanese Opportunities C | Fundusze akcyjne | 7,62% | |
| European Dynamic Growth Fund Y | Fundusze akcyjne | 6,13% | |
| Continental European Flexible Fund D2 | Fundusze akcyjne | 5,35% | |
| Emerging Markets C | Fundusze akcyjne | 5,30% | |
| Mirae Asset China Growth Equity Fund R | Fundusze akcyjne | 4,38% | |
| Asia Fund Y | Fundusze akcyjne | 3,70% | |
| StocksPLUS™ Fund IINST | Fundusze akcyjne | 3,34% | |
| Europe Dynamic Small Cap Fund C | Fundusze akcyjne | 2,49% | |
| BlackRock European Opportunities Extension D2 | Fundusze akcyjne | 0,65% | |



Alokacja aktywów ukazuje udział inwestycji w poszczególne aktywa.

Jaki był udział inwestycji związanych ze zrównoważonym rozwojem?

Fundusze z art. 8 SFDR stanowiły 57,8% aktywów.

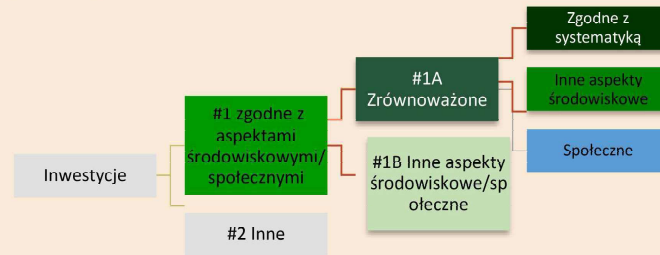
● *Jak przedstawiała się alokacja aktywów?*

Fundusze akcyjne 81,75%

Rachunki podstawowe 3,98%

Inne 14,27%

[dodać tylko odpowiednie pola, usunąć pola nieistotne dla danego produktu finansowego]



Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje Inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego.

Kategoria „#2 inne” obejmuje pozostałe inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego, które nie są zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi ani nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[wskazać poniżej, jeżeli w ramach tego produktu finansowego dokonano zrównoważonych inwestycji]

Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje:

- podkategorię „#1A zrównoważone” obejmującą zrównoważone inwestycje służące celom środowiskowym i społecznym;
- podkategorię „#1B inne aspekty środowiskowe lub społeczne” obejmującą inwestycje zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi, które nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[dodać uwagę w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność zgodna z systematyką jest wyrażona jako udział:

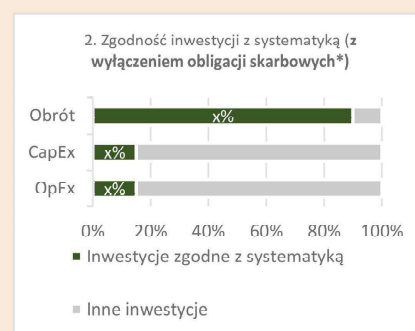
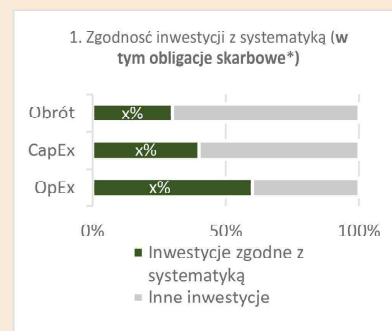
- **obrotu**, który odzwierciedla „ekologiczną” działalność spółek, w które dokonano inwestycji obecnie;
- **nakładów inwestycyjnych** (CapEx), ukazujących zielone inwestycje dokonane przez spółki, w które dokonano inwestycji, istotnych z punktu widzenia przejścia na zieloną gospodarkę;
- **wydatków operacyjnych** (OpEx), które odzwierciedlają ekologiczną działalność operacyjną spółek, w które dokonano inwestycji.

W których sektorach gospodarki dokonano inwestycji?



W jakim stopniu zrównoważone inwestycje służące realizacji celu środowiskowego były dostosowane do unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju? [dodać sekcję w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852 oraz dodać informacje zgodnie z art. 51 niniejszego rozporządzenia]

Na wykresach poniżej przedstawiono na zielono odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju. Ponieważ brak jest odpowiednich metod umożliwiających określenie zgodności obligacji skarbowych* z systematyką, na pierwszym wykresie przedstawiono zgodność z systematyką w odniesieniu do wszystkich inwestycji w ramach produktu finansowego, w tym obligacji skarbowych, natomiast na drugim wykresie przedstawiono zgodność z systematyką wyłącznie w odniesieniu do inwestycji w ramach produktu finansowego innych niż obligacje skarbowe.



* Do celów niniejszych wykresów „obligacje skarbowe” obejmują całe zaangażowanie w dług państwowy

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność

wspomagająca

bezpośrednio wspomaga inne rodzaje działalności we wnoszeniu istotnego wkładu w realizację celu środowiskowego.

Działalność na rzecz przejścia

jest to działalność, dla której alternatywne niskoemisyjne rozwiązania nie są jeszcze dostępne i która między innymi wytwarza emisje gazów cieplarnianych na poziomie odpowiadającym najlepszym wynikom.

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, które inwestują w działalność gospodarczą związaną z ochroną środowiska, nie będącą zrównoważoną środowiskowo działalnością gospodarczą]



to zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu, które **nie uwzględniają kryteriów** zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej na podstawie rozporządzenia (UE) 2020/852.



- *Jaki był udział inwestycji w działalność na rzecz przejścia i działalność wspomagającą? [załączyć zestawienie procentowych udziałów inwestycji w okresie odniesienia]*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

- *Jak w porównaniu z poprzednimi okresami odniesienia kształtował się odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju? [dotyczy sytuacji, gdy przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe]*

Nie dotyczy.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi środowiskowemu, które nie są zgodne z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, jeżeli produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu i dokonywane w działalność gospodarczą, która nie jest zrównoważona środowiskowo oraz wyjaśnić, dlaczego w ramach produktu finansowego inwestowano w działalność gospodarczą, która nie była zgodna z systematyką]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi społecznemu? *[dotyczy wyłącznie sytuacji, gdy produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi społecznemu]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie inwestycje uwzględniono w kategorii „inne”, czemu służyły takie inwestycje i czy w ich ramach zapewniono jakiegokolwiek minimalne zabezpieczenia środowiskowe lub społeczne?

Kontrakty terminowe na waluty, rachunki zabezpieczeń.

Jakie działania podjęto w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych w okresie odniesienia? *[wymienić działania podjęte w okresie objętym sprawozdaniem okresowym w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy, uwzględniając zaangażowanie akcjonariuszy, o którym mowa w art. 3 g dyrektywy 2007/36/WE, oraz jakiegokolwiek inne zaangażowanie związane z aspektami środowiskowymi lub społecznymi promowanymi w ramach produktu finansowego]*

Fundusz promuje aspekty środowiskowe lub społeczne poprzez uwzględnianie tych aspektów w kryteriach doboru lokat oraz stosowane limity i ograniczenia inwestycyjne. Fundusz promuje aspekty środowiskowe i społeczne bez wyróżniania w sposób szczególny indywidualnych aspektów.



[zamieścić uwagę dotyczącą produktów finansowych, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu osiągnięcia aspektu środowiskowego lub społecznego promowanego w ramach tego produktu finansowego]

Wskaźniki referencyjne to indeksy stosowane do pomiaru, czy w ramach produktu finansowego uwzględnia się aspekty środowiskowe lub społeczne promowane przez ten produkt.

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym? *[dodać sekcję, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego oraz wskazać, gdzie można zapoznać się z metodą zastosowaną na potrzeby obliczenia wyznaczonego indeksu]*

Nie został wyznaczony referencyjny punkt odniesienia (benchmark) w celu osiągnięcia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy.

- ***W jaki sposób wyznaczony wskaźnik referencyjny różni się od ogólnego indeksu rynkowego?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego pod względem wskaźników zrównoważonego rozwoju służących do ustalenia stopnia dostosowania danego wskaźnika referencyjnego do promowanych aspektów środowiskowych lub społecznych?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu z ogólnym indeksem rynkowym?***

Nie dotyczy.

Millennium SFIO Subfundusz Plan Wyważony
 Nazwa produktu: [uzupełnić] Identyfikator podmiotu prawnego: [uzupełnić] 259400OER85PZKP0KS23
Aspekty środowiskowe lub społeczne

Zrównoważona inwestycja oznacza inwestycję w działalność gospodarczą, która przyczynia się do realizacji celu środowiskowego lub społecznego, o ile taka inwestycja nie wyrządza poważnych szkód względem żadnego celu środowiskowego lub społecznego, a spółki, w które dokonano inwestycji, stosują dobre praktyki w zakresie zarządzania.

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju jest to system klasyfikacji określony w rozporządzeniu (UE) 2020/852, ustanawiający wykaz zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Rozporządzenie to nie zawiera wykazu zrównoważonej społecznie działalności gospodarczej. Zrównoważone inwestycje, które służą celowi środowiskowemu, mogą być zgodne lub niezgodne z systematyką.

Wskaźniki zrównoważonego rozwoju stosuje się do pomiaru stopnia uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach produktu finansowego.

Czy niniejszy produkt finansowy służył celowi dotyczącemu zrównoważonych inwestycji? [zaznaczyć i wypełnić odpowiednio, wartość procentowa przedstawia minimalne zaangażowanie w zrównoważone inwestycje]

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="radio"/> Tak | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nie |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu środowiskowym: ____% <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo | <input type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne i chociaż jego celem nie była zrównoważona inwestycja, miał ____% udziału w zrównoważonych inwestycjach <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi społecznemu |
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu społecznym: ____% | <input checked="" type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne, ale nie miał udziału w zrównoważonych inwestycjach |



W jakim stopniu uwzględniono aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach tego produktu finansowego? [wymienić aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, w odniesieniu do zrównoważonych inwestycji służących celom środowiskowym, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, w ramach których prowadzono zrównoważone inwestycje służące celom społecznym, wymienić cele społeczne]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Jakie osiągnięto wartości wskaźników zrównoważonego rozwoju?

55,65% udział w Aktywach Netto Subfunduszu instrumentów finansowych, w tym w szczególności tytułów uczestnictwa funduszy zagranicznych które promują aspekty środowiskowe lub społeczne bądź które mają na celu zrównoważone inwestycje w rozumieniu art. 8 i 9 SFDR;
 71,52% udział pokrycia Aktywów Netto Subfunduszu oceną aspektów środowiskowych lub społecznych ustalaną wg metodologii wewnętrznej TFI na podstawie m.in. zewnętrznych ratingów ESG;
 65,08% udział Aktywów Netto Subfunduszu, dla których dostępne są dane dotyczące poziomu i intensywności emisji CO₂, ekspozycji wobec firm działających w sektorze paliw kopalnych, naruszenia zasad opisanych w UN Global Compact i ekspozycji wobec kontrowersyjnej broni.

Główne niekorzystne skutki to najpoważniejsze niekorzystne skutki decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju, takie jak kwestie środowiskowe, społeczne i pracownicze, kwestie dotyczące poszanowania praw człowieka oraz przeciwdziałania korupcji i

- **...a w porównaniu z poprzednimi okresami?** [dotyczy sytuacji, gdy w odniesieniu do produktów finansowych przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe] Nie dotyczy.
- **Jakie były cele dotyczące zrównoważonych inwestycji, które miały być częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, i w jaki sposób zrównoważona inwestycja przyczyniła się do osiągnięcia tych celów?** [dotyczy produktów finansowych, w ramach których dokonywano zrównoważonych inwestycji; opisać cele, jeżeli nie zostały uwzględnione w odpowiedzi na poprzednie pytanie. Opisać, w jaki sposób zrównoważone inwestycje przyczyniły się do osiągnięcia celu zrównoważonych inwestycji. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

- **W jaki sposób zrównoważone inwestycje, które zostały częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, nie wyrządziły poważnych szkód względem jakiegokolwiek środowiskowego lub społecznego celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji?** [dotyczy sytuacji, gdy produkt finansowy obejmuje zrównoważone inwestycje]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

W jaki sposób uwzględniono wskaźniki dotyczące niekorzystnych skutków dla czynników zrównoważonego rozwoju?

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Czy zrównoważone inwestycje były zgodne z Wytycznymi OECD dla przedsiębiorstw wielonarodowych i Wytycznymi ONZ dotyczącymi biznesu i praw człowieka? Dodatkowe informacje:

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Inwestycje w ramach tego produktu nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.

[dodać oświadczenie w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju określa zasadę „nie czynić poważnych szkód”, zgodnie z którą inwestycje zgodne z systematyką nie powinny wyrządzać poważnych szkód względem celów unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju, a towarzyszą jej konkretne kryteria unijne.

Zasada „nie czynić poważnych szkód” stosowana jest wyłącznie w odniesieniu do tych inwestycji w ramach produktu finansowego, które uwzględniają unijne kryteria dotyczące zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Inwestycje w ramach pozostałej części tego produktu finansowego nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.



Czy w ramach tego produktu finansowego wzięto pod uwagę główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję, jeżeli produkt finansowy uwzględnił główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju].*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie główne inwestycje obejmuje ten produkt finansowy?

Wykaz zawiera inwestycje stanowiące największą część inwestycji w ramach tego produktu finansowego w okresie odniesienia, którym jest: *[uzupełnić]*

Największe inwestycje

Sektor

% aktywów

Państwo

| | | |
|--|------------------|--------|
| Global Bond ESG Fund INST | Fundusze dłużne | 15,14% |
| Strategic Bond Fund IU2 | Fundusze dłużne | 15,14% |
| Vanguard Global Bond Index Fund | Fundusze dłużne | 9,43% |
| Global Bond Opportunities Sustainable Fund C | Fundusze dłużne | 8,42% |
| iShares US Index Fund D | Fundusze akcyjne | 6,44% |
| Aggregate Bond Fund C | Fundusze dłużne | 3,73% |
| Comgest Growth Plc - Comgest Growth Europe I | Fundusze akcyjne | 3,65% |
| European Dynamic Growth Fund Y | Fundusze akcyjne | 3,25% |
| Emerging Markets Equity Fund C | Fundusze akcyjne | 2,79% |
| Emerging Markets C | Fundusze akcyjne | 1,95% |
| Europe Strategic Growth Fund C | Fundusze akcyjne | 1,57% |



Alokacja aktywów ukazuje udział inwestycji w poszczególne aktywa.

Jaki był udział inwestycji związanych ze zrównoważonym rozwojem?

Fundusze z art. 8 SFDR stano 55,59% aktywów.

● Jak przedstawiała się alokacja aktywów?

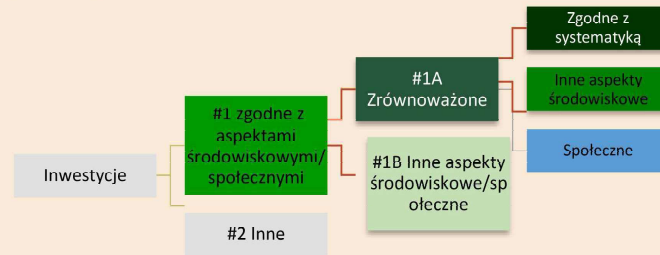
Fundusze dłużne 51,87%

Fundusze akcyjne 19,65%

Rachunki bankowe 15,63%

Inne 12,85%

[dodać tylko odpowiednie pola, usunąć pola nieistotne dla danego produktu finansowego]



Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje Inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego.

Kategoria „#2 inne” obejmuje pozostałe inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego, które nie są zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi ani nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[wskazać poniżej, jeżeli w ramach tego produktu finansowego dokonano zrównoważonych inwestycji]

Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje:

- podkategorię „#1A zrównoważone” obejmującą zrównoważone inwestycje służące celom środowiskowym i społecznym;
- podkategorię „#1B inne aspekty środowiskowe lub społeczne” obejmującą inwestycje zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi, które nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[dodać uwagę w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność zgodna z systematyką jest wyrażona jako udział:

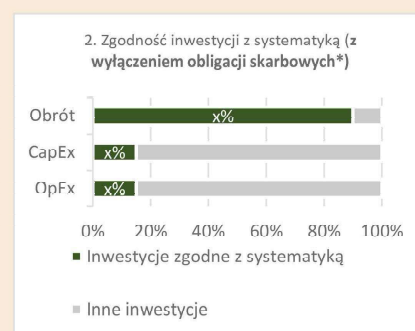
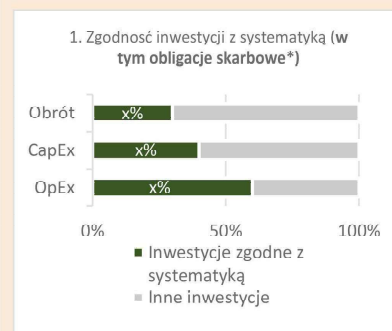
- **obrotu**, który odzwierciedla „ekologiczną” działalność spółek, w które dokonano inwestycji obecnie;
- **nakładów inwestycyjnych** (CapEx), ukazujących zielone inwestycje dokonane przez spółki, w które dokonano inwestycji, istotnych z punktu widzenia przejścia na zieloną gospodarkę;
- **wydatków operacyjnych** (OpEx), które odzwierciedlają ekologiczną działalność operacyjną spółek, w które dokonano inwestycji.

W których sektorach gospodarki dokonano inwestycji?



W jakim stopniu zrównoważone inwestycje służące realizacji celu środowiskowego były dostosowane do unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju? [dodać sekcję w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852 oraz dodać informacje zgodnie z art. 51 niniejszego rozporządzenia]

Na wykresach poniżej przedstawiono na zielono odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju. Ponieważ brak jest odpowiednich metod umożliwiających określenie zgodności obligacji skarbowych* z systematyką, na pierwszym wykresie przedstawiono zgodność z systematyką w odniesieniu do wszystkich inwestycji w ramach produktu finansowego, w tym obligacji skarbowych, natomiast na drugim wykresie przedstawiono zgodność z systematyką wyłącznie w odniesieniu do inwestycji w ramach produktu finansowego innych niż obligacje skarbowe.



* Do celów niniejszych wykresów „obligacje skarbowe” obejmują całe zaangażowanie w dług państwowy

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność

wspomagająca

bezpośrednio wspomaga inne rodzaje działalności we wnoszeniu istotnego wkładu w realizację celu środowiskowego.

Działalność na rzecz przejścia

jest to działalność, dla której alternatywne niskoemisyjne rozwiązania nie są jeszcze dostępne i która między innymi wytwarza emisje gazów cieplarnianych na poziomie odpowiadającym najlepszym wynikom.

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, które inwestują w działalność gospodarczą związaną z ochroną środowiska, nie będącą zrównoważoną środowiskowo działalnością gospodarczą]



to zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu, które **nie uwzględniają kryteriów** zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej na podstawie rozporządzenia (UE) 2020/852.



- *Jaki był udział inwestycji w działalność na rzecz przejścia i działalność wspomagającą? [załączyć zestawienie procentowych udziałów inwestycji w okresie odniesienia]*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

- *Jak w porównaniu z poprzednimi okresami odniesienia kształtował się odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju? [dotyczy sytuacji, gdy przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe]*

Nie dotyczy.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi środowiskowemu, które nie są zgodne z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, jeżeli produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu i dokonywane w działalność gospodarczą, która nie jest zrównoważona środowiskowo oraz wyjaśnić, dlaczego w ramach produktu finansowego inwestowano w działalność gospodarczą, która nie była zgodna z systematyką]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi społecznemu? *[dotyczy wyłącznie sytuacji, gdy produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi społecznemu]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie inwestycje uwzględniono w kategorii „inne”, czemu służyły takie inwestycje i czy w ich ramach zapewniono jakiegokolwiek minimalne zabezpieczenia środowiskowe lub społeczne?

Kontrakty terminowe na waluty, depozyty zabezpieczające, należności.

Jakie działania podjęto w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych w okresie odniesienia? *[wymienić działania podjęte w okresie objętym sprawozdaniem okresowym w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy, uwzględniając zaangażowanie akcjonariuszy, o którym mowa w art. 3 g dyrektywy 2007/36/WE, oraz jakiegokolwiek inne zaangażowanie związane z aspektami środowiskowymi lub społecznymi promowanymi w ramach produktu finansowego]*

Fundusz promuje aspekty środowiskowe lub społeczne poprzez uwzględnianie tych aspektów w kryteriach doboru lokat oraz stosowane limity i ograniczenia inwestycyjne. Fundusz promuje aspekty środowiskowe i społeczne bez wyróżniania w sposób szczególny indywidualnych aspektów.



[zamieścić uwagę dotyczącą produktów finansowych, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu osiągnięcia aspektu środowiskowego lub społecznego promowanego w ramach tego produktu finansowego]

Wskaźniki referencyjne to indeksy stosowane do pomiaru, czy w ramach produktu finansowego uwzględnia się aspekty środowiskowe lub społeczne promowane przez ten produkt.

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym? *[dodać sekcję, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego oraz wskazać, gdzie można zapoznać się z metodą zastosowaną na potrzeby obliczenia wyznaczonego indeksu]*

Nie został wyznaczony referencyjny punkt odniesienia (benchmark) w celu osiągnięcia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy.

- ***W jaki sposób wyznaczony wskaźnik referencyjny różni się od ogólnego indeksu rynkowego?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego pod względem wskaźników zrównoważonego rozwoju służących do ustalenia stopnia dostosowania danego wskaźnika referencyjnego do promowanych aspektów środowiskowych lub społecznych?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu z ogólnym indeksem rynkowym?***

Nie dotyczy.

Millennium SFIO Subfundusz Plan Spokojny

Nazwa produktu: [uzupełnić] Identyfikator podmiotu prawnego: [uzupełnić] 259400279EIGV9V92R65

Aspekty środowiskowe lub społeczne

Zrównoważona inwestycja oznacza inwestycję w działalność gospodarczą, która przyczynia się do realizacji celu środowiskowego lub społecznego, o ile taka inwestycja nie wyrządza poważnych szkód względem żadnego celu środowiskowego lub społecznego, a spółki, w które dokonano inwestycji, stosują dobre praktyki w zakresie zarządzania.

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju jest to system klasyfikacji określony w rozporządzeniu (UE) 2020/852, ustanawiający wykaz **zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej**. Rozporządzenie to nie zawiera wykazu **zrównoważonej społecznie działalności gospodarczej**. Zrównoważone inwestycje, które służą celowi środowiskowemu, mogą być zgodne lub niezgodne z systematyką.

Wskaźniki zrównoważonego rozwoju stosuje się do pomiaru stopnia uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach produktu finansowego.

Czy niniejszy produkt finansowy służył celowi dotyczącemu zrównoważonych inwestycji? [zaznaczyć i wypełnić odpowiednio, wartość procentowa przedstawia minimalne zaangażowanie w zrównoważone inwestycje]

| <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="radio"/> Tak | <input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> Nie |
|--|--|
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu środowiskowym: ____% <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo | <input type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne i chociaż jego celem nie była zrównoważona inwestycja, miał ____% udziału w zrównoważonych inwestycjach <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi środowiskowemu i dokonywanych w działalność gospodarczą, która zgodnie z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju nie kwalifikuje się jako zrównoważona środowiskowo <input type="checkbox"/> służących celowi społecznemu |
| <input type="checkbox"/> W ramach produktu dokonano zrównoważonych inwestycji o celu społecznym: ____% | <input checked="" type="checkbox"/> Produkt promował aspekty środowiskowe/społeczne, ale nie miał udziału w zrównoważonych inwestycjach |

W jakim stopniu uwzględniono aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach tego produktu finansowego? [wymienić aspekty środowiskowe lub społeczne promowane w ramach produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, w odniesieniu do zrównoważonych inwestycji służących celom środowiskowym, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego. W przypadku produktów finansowych, w ramach których prowadzono zrównoważone inwestycje służące celom społecznym, wymienić cele społeczne]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Jakie osiągnięto wartości wskaźników zrównoważonego rozwoju?

59,96% udział w Aktywach Netto Subfunduszu instrumentów finansowych, w tym w szczególności tytułów uczestnictwa funduszy zagranicznych które promują aspekty środowiskowe lub społeczne bądź które mają na celu zrównoważone inwestycje w rozumieniu art. 8 i 9 SFDR;
 75,27% udział pokrycia Aktywów Netto Subfunduszu oceną aspektów środowiskowych lub społecznych ustalaną wg metodologii wewnętrznej TFI na podstawie m.in. zewnętrznych ratingów ESG;
 73,00% udział Aktywów Netto Subfunduszu, dla których dostępne są dane dotyczące poziomu i intensywności emisji CO2, ekspozycji wobec firm działających w sektorze paliw kopalnych, naruszenia zasad opisanych w UN Global Compact i ekspozycji wobec kontrowersyjnej broni.

Główne niekorzystne skutki to najpoważniejsze niekorzystne skutki decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju, takie jak kwestie środowiskowe, społeczne i pracownicze, kwestie dotyczące poszanowania praw człowieka oraz przeciwdziałania korupcji i

- **...a w porównaniu z poprzednimi okresami?** [dotyczy sytuacji, gdy w odniesieniu do produktów finansowych przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe] Nie dotyczy.
- **Jakie były cele dotyczące zrównoważonych inwestycji, które miały być częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, i w jaki sposób zrównoważona inwestycja przyczyniła się do osiągnięcia tych celów?** [dotyczy produktów finansowych, w ramach których dokonywano zrównoważonych inwestycji; opisać cele, jeżeli nie zostały uwzględnione w odpowiedzi na poprzednie pytanie. Opisać, w jaki sposób zrównoważone inwestycje przyczyniły się do osiągnięcia celu zrównoważonych inwestycji. W przypadku produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, wymienić cele środowiskowe określone w art. 9 tego rozporządzenia, do których osiągnięcia przyczyniła się zrównoważona inwestycja w ramach danego produktu finansowego]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

- **W jaki sposób zrównoważone inwestycje, które zostały częściowo zrealizowane w ramach produktu finansowego, nie wyrządziły poważnych szkód względem jakiegokolwiek środowiskowego lub społecznego celu dotyczącego zrównoważonych inwestycji?** [dotyczy sytuacji, gdy produkt finansowy obejmuje zrównoważone inwestycje]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

W jaki sposób uwzględniono wskaźniki dotyczące niekorzystnych skutków dla czynników zrównoważonego rozwoju?

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Czy zrównoważone inwestycje były zgodne z Wytycznymi OECD dla przedsiębiorstw wielonarodowych i Wytycznymi ONZ dotyczącymi biznesu i praw człowieka? Dodatkowe informacje:

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Inwestycje w ramach tego produktu nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.

[dodać oświadczenie w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Unijna systematyka dotycząca zrównoważonego rozwoju określa zasadę „nie czynić poważnych szkód”, zgodnie z którą inwestycje zgodne z systematyką nie powinny wyrządzać poważnych szkód względem celów unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju, a towarzyszą jej konkretne kryteria unijne.

Zasada „nie czynić poważnych szkód” stosowana jest wyłącznie w odniesieniu do tych inwestycji w ramach produktu finansowego, które uwzględniają unijne kryteria dotyczące zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej. Inwestycje w ramach pozostałej części tego produktu finansowego nie uwzględniają unijnych kryteriów dotyczących zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej.



Czy w ramach tego produktu finansowego wzięto pod uwagę główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję, jeżeli produkt finansowy uwzględnił główne niekorzystne skutki dla czynników zrównoważonego rozwoju].*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie główne inwestycje obejmuje ten produkt finansowy?

Wykaz zawiera inwestycje stanowiące największą część inwestycji w ramach tego produktu finansowego w okresie odniesienia, którym jest: *[uzupełnić]*

| Największe inwestycje | Sektor | % aktywów | Państwo |
|--|------------------|-----------|---------|
| Strategic Bond Fund IU2 | Fundusze dłużne | 14,97% | |
| Global Bond ESG Fund INST | Fundusze dłużne | 14,72% | |
| Global Bond Opportunities Sustainable Fund C | Fundusze dłużne | 14,58% | |
| Vanguard Global Bond Index Fund | Fundusze dłużne | 13,04% | |
| Aggregate Bond Fund C | Fundusze dłużne | 10,30% | |
| European Dynamic Growth Fund Y | Fundusze akcyjne | 2,65% | |
| iShares US Index Fund D | Fundusze akcyjne | 2,27% | |
| Emerging Markets Equity Fund C | Fundusze akcyjne | 1,70% | |
| Europe Strategic Growth Fund C | Fundusze akcyjne | 1,03% | |



Alokacja aktywów ukazuje udział inwestycji w poszczególne aktywa.

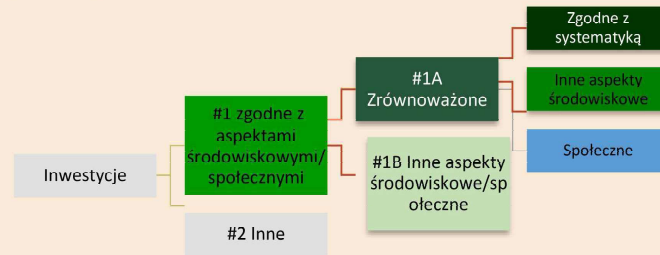
Jaki był udział inwestycji związanych ze zrównoważonym rozwojem?

Fundusze z art. 8 SFDR stano 59,96% aktywów.

● *Jak przedstawiała się alokacja aktywów?*

| | |
|------------------|--------|
| Fundusze dłużne | 67,62% |
| Rachunki bankowe | 10,35% |
| Fundusze akcyjne | 7,65% |
| Inne | 14,38% |

[dodać tylko odpowiednie pola, usunąć pola nieistotne dla danego produktu finansowego]



Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje Inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego.

Kategoria „#2 inne” obejmuje pozostałe inwestycje dokonane w ramach produktu finansowego, które nie są zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi ani nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[wskazać poniżej, jeżeli w ramach tego produktu finansowego dokonano zrównoważonych inwestycji]

Kategoria „#1 zgodne z aspektami środowiskowymi/społecznymi” obejmuje:

- podkategorię „#1A zrównoważone” obejmującą zrównoważone inwestycje służące celom środowiskowym i społecznym;
- podkategorię „#1B inne aspekty środowiskowe lub społeczne” obejmującą inwestycje zgodne z aspektami środowiskowymi lub społecznymi, które nie kwalifikują się jako zrównoważone inwestycje.

[dodać uwagę w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność zgodna z systematyką jest wyrażona jako udział:

- **obrotu**, który odzwierciedla „ekologiczną” działalność spółek, w które dokonano inwestycji obecnie;
- **nakładów inwestycyjnych** (CapEx), ukazujących zielone inwestycje dokonane przez spółki, w które dokonano inwestycji, istotnych z punktu widzenia przejścia na zieloną gospodarkę;
- **wydatków operacyjnych** (OpEx), które odzwierciedlają ekologiczną działalność operacyjną spółek, w które dokonano inwestycji.

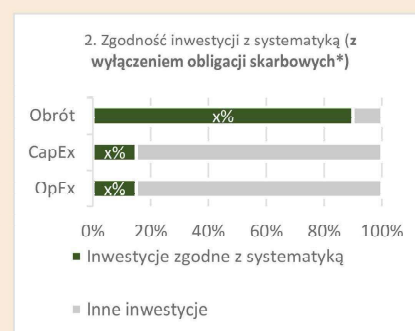
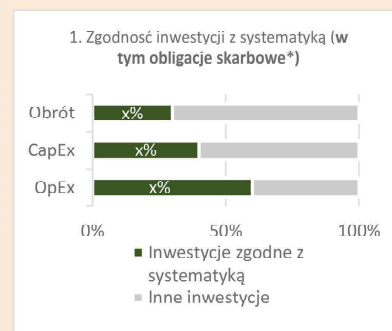
W których sektorach gospodarki dokonano inwestycji?



W jakim stopniu zrównoważone inwestycje służące realizacji celu środowiskowego były dostosowane do unijnej systematyki dotyczącej zrównoważonego rozwoju? [dodać sekcję w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852 oraz dodać informacje zgodnie z art. 51 niniejszego rozporządzenia]

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

Na wykresach poniżej przedstawiono na zielono odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju. Ponieważ brak jest odpowiednich metod umożliwiających określenie zgodności obligacji skarbowych* z systematyką, na pierwszym wykresie przedstawiono zgodność z systematyką w odniesieniu do wszystkich inwestycji w ramach produktu finansowego, w tym obligacji skarbowych, natomiast na drugim wykresie przedstawiono zgodność z systematyką wyłącznie w odniesieniu do inwestycji w ramach produktu finansowego innych niż obligacje skarbowe.




* Do celów niniejszych wykresów „obligacje skarbowe” obejmują całe zaangażowanie w dług państwowy

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852]

Działalność wspomagająca
bezpośrednio wspomaga inne rodzaje działalności we wnoszeniu istotnego wkładu w realizację celu środowiskowego.

Działalność na rzecz przejścia jest to działalność, dla której alternatywne niskoemisyjne rozwiązania nie są jeszcze dostępne i która między innymi wytwarza emisje gazów cieplarnianych na poziomie odpowiadającym najlepszym wynikom.

[dodać uwagę tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, które inwestują w działalność gospodarczą związaną z ochroną środowiska, nie będącą zrównoważoną środowiskowo działalnością gospodarczą]

 to zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu, które **nie uwzględniają kryteriów** zrównoważonej środowiskowo działalności gospodarczej na podstawie rozporządzenia (UE) 2020/852.



● **Jaki był udział inwestycji w działalność na rzecz przejścia i działalność wspomagającą?** *[załączyć zestawienie procentowych udziałów inwestycji w okresie odniesienia]*

Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.

● **Jak w porównaniu z poprzednimi okresami odniesienia kształtował się odsetek inwestycji zgodnych z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju?** *[dotyczy sytuacji, gdy przekazano wcześniej przynajmniej jedno sprawozdanie okresowe]*

Nie dotyczy.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi środowiskowemu, które nie są zgodne z unijną systematyką dotyczącą zrównoważonego rozwoju? *[dodać sekcję tylko w odniesieniu do produktów finansowych, o których mowa w art. 6 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2020/852, jeżeli produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi środowiskowemu i dokonywane w działalność gospodarczą, która nie jest zrównoważona środowiskowo oraz wyjaśnić, dlaczego w ramach produktu finansowego inwestowano w działalność gospodarczą, która nie była zgodna z systematyką]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jaki był udział zrównoważonych inwestycji służących celowi społecznemu? *[dotyczy wyłącznie sytuacji, gdy produkt finansowy obejmował zrównoważone inwestycje służące celowi społecznemu]*

Nie dotyczy. Produkt finansowy nie ma na celu zrównoważonych inwestycji.



Jakie inwestycje uwzględniono w kategorii „inne”, czemu służyły takie inwestycje i czy w ich ramach zapewniono jakiegokolwiek minimalne zabezpieczenia środowiskowe lub społeczne?

Kontrakty terminowe na waluty, depozyty zabezpieczające, należności.

Jakie działania podjęto w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych w okresie odniesienia? *[wymienić działania podjęte w okresie objętym sprawozdaniem okresowym w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy, uwzględniając zaangażowanie akcjonariuszy, o którym mowa w art. 3 g dyrektywy 2007/36/WE, oraz jakiegokolwiek inne zaangażowanie związane z aspektami środowiskowymi lub społecznymi promowanymi w ramach produktu finansowego]*

Fundusz promuje aspekty środowiskowe lub społeczne poprzez uwzględnianie tych aspektów w kryteriach doboru lokat oraz stosowane limity i ograniczenia inwestycyjne. Fundusz promuje aspekty środowiskowe i społeczne bez wyróżniania w sposób szczególny indywidualnych aspektów.



[zamieścić uwagę dotyczącą produktów finansowych, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu osiągnięcia aspektu środowiskowego lub społecznego promowanego w ramach tego produktu finansowego]

Wskaźniki referencyjne to indeksy stosowane do pomiaru, czy w ramach produktu finansowego uwzględnia się aspekty środowiskowe lub społeczne promowane przez ten produkt.

Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym? *[dodać sekcję, jeżeli wyznaczono indeks jako wskaźnik referencyjny w celu uwzględnienia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych w ramach tego produktu finansowego oraz wskazać, gdzie można zapoznać się z metodą zastosowaną na potrzeby obliczenia wyznaczonego indeksu]*

Nie został wyznaczony referencyjny punkt odniesienia (benchmark) w celu osiągnięcia aspektów środowiskowych lub społecznych promowanych przez produkt finansowy.

- ***W jaki sposób wyznaczony wskaźnik referencyjny różni się od ogólnego indeksu rynkowego?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego pod względem wskaźników zrównoważonego rozwoju służących do ustalenia stopnia dostosowania danego wskaźnika referencyjnego do promowanych aspektów środowiskowych lub społecznych?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu ze wskaźnikiem referencyjnym?***

Nie dotyczy.

- ***Jakie wyniki uzyskano w ramach tego produktu finansowego w porównaniu z ogólnym indeksem rynkowym?***

Nie dotyczy.
