

INFORMACJE W ZAKRESIE STRATEGII MILLENNIUM TFI DOTYCZĄCEJ WPROWADZANIA DO DZIAŁALNOŚCI RYZYK DLA ZRÓWNOWAŻONEGO ROZWOJU W PROCESIE PODEJMOWANIA DECYZJI INWESTYCYJNYCH ORAZ SKUTKÓW PODJĘTYCH DECYZJI INWESTYCYJNYCH DLA CZYNNIKÓW ZRÓWNOWAŻONEGO ROZWOJU

I. PRZEJRZYSTOŚĆ STRATEGII DOTYCZĄCYCH RYZYKA DLA ZRÓWNOWAŻONEGO ROZWOJU

Millennium Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. (dalej: Towarzystwo) uwzględnia kwestie dotyczące zrównoważonego rozwoju (dalej: ESG) jako ryzyko dla wartości inwestycji. Towarzystwo uważa za emitenci których strategia zbudowana jest w oparciu o dobre praktyki z obszaru ESG mogą być traktowani jako podmioty o obniżonym poziomie ryzyka inwestycyjnego, a tym samym o zwiększonej atrakcyjności inwestycyjnej. W związku z powyższym Towarzystwo wdrożyło ocenę tego ryzyka w proces podejmowania decyzji inwestycyjnych. W tym celu emitenci udziałowych i dłużnych instrumentów finansowych, w które mogą inwestować fundusze zarządzane przez Towarzystwo zostaną zaklasyfikowani do jednej z pięciu grup ryzyka ESG - ESG Risk Rating (bardzo niskie - A, niskie - B, umiarkowane - C, wysokie - D, bardzo wysokie - E). Fundusze zarządzane przez Towarzystwo inwestują w instrumenty emitowane przez podmioty zakwalifikowane do grupy D i E, z zastosowaniem dodatkowych limitów ograniczających udział tego typu instrumentów w portfelach tych funduszy. Tworząc klasyfikację Towarzystwo bierze w szczególności pod uwagę:

- ratingi publikowane przez niezależne agencje i analityków, dotyczące stosowania przez emitentów zasad ESG,
- publikowane przez emitentów raporty dotyczące stosowanych zasad z obszaru ESG,
- rodzaj branży w której działa emitent, rodzaj wytwarzanych produktów i świadczonych usług,
- inne ogólnie dostępne informacje, które mogą stanowić źródło dla oceny emitenta w zakresie ESG.

II. PRZEJRZYSTOŚĆ W ZAKRESIE NIEKORZYSTNYCH SKUTKÓW DLA ZRÓWNOWAŻONEGO ROZWOJU NA POZIOMIE PODMIOTU

Towarzystwo ze względu na ograniczony obecnie zakres danych z obszaru ESG, publikowanych przez emitentów przy podejmowaniu decyzji inwestycyjnych nie bierze pod uwagę ich niekorzystnych skutków dla czynników zrównoważonego rozwoju. Dopiero kiedy w ocenie Towarzystwa dane udostępniane przez emitentów będą umożliwiać rzetelną ocenę niekorzystnych skutków decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju, Towarzystwo rozważy kwestię uwzględniania głównych niekorzystnych skutków decyzji inwestycyjnych dla czynników zrównoważonego rozwoju.