

**Protokół
zmian Statutu Millennium Funduszu Inwestycyjnego Otwartego
z dnia 17 września 2024 roku**

Millennium Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych Spółka Akcyjna informuje o zmianach w Statucie Millennium Funduszu Inwestycyjnego Otwartego (dalej: „Statut”).

Statut zostaje zmieniony w następujący sposób:

1. w §29 zmienia się ust. 23 oraz 24, które otrzymują następujące brzmienie:

„23. W przypadku wszystkich rodzajów lokat wymienionych w § 27, działalność lokacyjna Subfunduszu będzie prowadzona głównie w Polsce. W niewielkim zakresie jest dopuszczalna działalność lokacyjna w innych krajach.

24. Fundusz może inwestować od 80% do 100% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym, przy czym znaczącą część portfela akcyjnego Subfunduszu będą stanowiły akcje spółek które posiadają w długoterminowej perspektywie wysokie prawdopodobieństwo osiągnięcia ponadprzeciętnej dynamiki wzrostu przychodów i zysków. Z uwagi na fakt, iż powyższe kryteria są w stanie spełnić głównie spółki o małej i średniej kapitalizacji, udział spółek z tego sektora będzie stanowił nie mniej niż 70% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu. Za spółki o małej i średniej kapitalizacji uważa się spółki notowane na GPW w Warszawie, nie wchodzące w skład indeksu WIG 20. Powyższe limity uwzględniają wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych dla którego bazą są indeksy, wartość akcji reprezentowanych przez te indeksy. Część aktywów, która nie będzie ulokowana w instrumentach o charakterze udziałowym, Fundusz będzie inwestował przede wszystkim w dłużne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego, głównie emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski.”;

2. w §40 zmienia się ust. 23, 24 oraz 25, które otrzymują następujące brzmienie:

„23. W przypadku wszystkich rodzajów lokat wymienionych w §38, działalność lokacyjna Subfunduszu będzie prowadzona głównie w Polsce. W niewielkim zakresie jest dopuszczalna działalność lokacyjna w innych krajach.

24. Fundusz lokuje od 80% do 100% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym, przy czym udział akcji w portfelu Subfunduszu notowanych na GPW w Warszawie nie będzie niższy niż 70% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu. Powyższe limity uwzględniają wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych dla którego bazą są indeksy, wartość akcji reprezentowanych przez te indeksy. Pozostałe środki Fundusz może lokować w inne niż akcje instrumenty finansowe określone w §38, w szczególności dłużne papiery wartościowe, z uwzględnieniem limitów określonych w ust. 1 – 23.

25. Fundusz lokuje nie mniej niż 35% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w akcje spółek wchodzących w skład indeksu WIG-20. Powyższy limit uwzględnia wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych, dla którego bazą jest indeks WIG20, wartość akcji reprezentowanych przez ten indeks.”;

3. w §51 zmienia się ust. 25 oraz 26, które otrzymują następujące brzmienie:

„25. W przypadku wszystkich rodzajów lokat wymienionych w §49, działalność lokacyjna Subfunduszu będzie prowadzona głównie w Polsce. W niewielkim zakresie jest dopuszczalna działalność lokacyjna w innych krajach.

26. Fundusz lokuje od 20% do 100% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w instrumenty finansowe udziałowe w tym w szczególności w akcje. Powyższe limity uwzględniają wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych dla którego bazą są indeksy, wartość akcji reprezentowanych przez te indeksy. Pozostałe środki Subfunduszu są lokowane

w instrumenty finansowe inne niż instrumenty finansowe udziałowe, w szczególności w dłużne papiery wartościowe. Alokaacja pomiędzy częścią udziałową i dłużną dokonywana jest na podstawie przewidywań dotyczących cykli gospodarczych w krajach, w których inwestuje Subfundusz.”;

4. w §51 po ust. 27 dodaje się ust. 28 oraz ust. 29 w następującym brzmieniu:

- „28. Akcje notowane na GPW w Warszawie będą stanowiły nie mniej niż 70% portfela finansowych instrumentów udziałowych. Przy obliczaniu tego limitu uwzględnia się wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych dla którego bazą jest indeks giełdowy wartość akcji reprezentowanych przez ten indeks.
29. Obligacje emitowane, gwarantowane lub poręczane przez Skarb Państwa będą stanowiły nie mniej niż 80% portfela obligacyjnego Subfunduszu.”;

5. w §62 zmienia się ust. 24, który otrzymuje następujące brzmienie:

- „24. W przypadku wszystkich rodzajów lokat wymienionych w §60, działalność lokacyjna Subfunduszu będzie prowadzona głównie w Polsce. W niewielkim zakresie jest dopuszczalna działalność lokacyjna w innych krajach.”;

6. w §62 zmienia się ust. 26, który otrzymuje następujące brzmienie:

- „26. Fundusz lokuje nie mniej niż 20% i nie więcej niż 40% Aktywów Netto Subfunduszu w instrumenty finansowe o charakterze udziałowym w tym w szczególności w akcje. Powyższe limity uwzględniają wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych, dla którego bazą są indeksy, wartość akcji reprezentowanych przez te indeksy.”;

7. w §62 zmienia się ust. 29, który otrzymuje następujące brzmienie:

- „29. Akcje notowane na GPW w Warszawie będą stanowiły nie mniej niż 70% portfela instrumentów udziałowych. Przy obliczaniu tego limitu uwzględnia się wartość akcji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych dla którego bazą jest indeks giełdowy, wartość akcji reprezentowanych przez ten indeks.”;

8. w §62 po ust. 29 dodaje się ust. 30 w następującym brzmieniu:

- „30. Obligacje emitowane, gwarantowane lub poręczone przez Skarb Państwa będą stanowiły nie mniej niż 80% portfela obligacyjnego Subfunduszu.”;

9. w §84 zmienia się ust. 9 oraz 10, które otrzymują następujące brzmienie:

- „9. Fundusz może inwestować do 100% Wartości Aktywów Subfunduszu w dłużne instrumenty finansowe w tym tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze dłużnym, których polityka inwestycyjna zakłada, że lokaty w dłużne instrumenty finansowe będą stanowiły łącznie nie mniej niż 50% ich aktywów, przy czym łączny udział dłużnych instrumentów finansowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez państwa oraz tytułów uczestnictwa funduszy zagranicznych, których polityka inwestycyjna zakłada, że lokaty w wymienione powyżej instrumenty dłużne będą stanowiły nie mniej niż 50% ich aktywów, będzie stanowił nie mniej niż 80% Aktywów Netto Subfunduszu.
10. Dłużne instrumenty finansowe emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa, stanowią łącznie nie mniej niż 60% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”;

10. w §84 po ust. 10 dodaje się ust. 11, 12 oraz 13 w następującym brzmieniu:

- „11. Przy obliczaniu limitów, o których mowa w pkt. 9 i 10 uwzględnia się wartość obligacji stanowiących bazę instrumentów pochodnych, a w przypadku instrumentów pochodnych, dla którego bazą jest indeks, wartość obligacji reprezentowanych przez ten indeks.
12. Pozycja walutowa wynikająca z inwestycji Subfunduszu w instrumenty finansowe denominowane w walutach obcych będzie zabezpieczona z wykorzystaniem instrumentów pochodnych. Suma niezabezpieczonych pozycji walutowych nie może przekroczyć 10% wartości Aktywów Subfunduszu.
13. Modified duration portfela Subfunduszu składającego się z obligacji, listów zastawnych i instrumentów pochodnych będzie się zawierał w przedziale 1-7 lat.”;

11. w §95 zmienia się ust. 27 oraz 28, które otrzymują następujące brzmienie:

- „27. Fundusz lokuje nie mniej niż 60% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w dłużne instrumenty finansowe emitowane lub gwarantowane lub poręczane przez podmioty posiadające przynajmniej jeden rating na poziomie inwestycyjnym nadany przez agencję ratingową uznaną przez Europejski

Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ang. European Securities and Markets Authority, ESMA). Pozostałe środki Fundusz może inwestować w inne dłużne instrumenty finansowe w tym tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych o charakterze dłużnym, których polityka inwestycyjna zakłada, że lokaty w dłużne instrumenty finansowe będą stanowiły łącznie nie mniej niż 50% ich aktywów.

28. Fundusz lokuje nie więcej niż 60% Aktywów Subfunduszu w dłużne instrumenty finansowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność gospodarczą i jednostki samorządu terytorialnego oraz listy zastawne banków hipotecznych.”;

12. w §95 po ust. 28 dodaje się ust. 29 oraz 30 w następującym brzmieniu:

- „29. Pozycja walutowa wynikająca z inwestycji Subfunduszu w instrumenty finansowe denominowane w walutach obcych będzie zabezpieczana z wykorzystaniem instrumentów pochodnych. Suma niezabezpieczonych pozycji walutowych nie może przekroczyć 10 % Wartości Aktywów Subfunduszu.
30. Modified duration portfela Subfunduszu składającego się z obligacji, listów zastawnych i instrumentów pochodnych będzie nie dłuższy niż 3 lata.”;

13. W pozostałym zakresie Statut pozostaje bez zmian.