

# OKRESOWA INFORMACJA DLA INWESTORA

## MILLENNIUM PPK SPECJALISTYCZNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO OTWARTEGO

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 z późn. zm)

**Data i miejsce sporządzenia Okresowej Informacji dla Inwestora:**

18 października 2021 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) Aktualny profil ryzyka :
  1. Subfundusz Emerytura 2025: 3
  2. Subfundusz Emerytura 2030: 4
  3. Subfundusz Emerytura 2035: 5
  4. Subfundusz Emerytura 2040: 5
  5. Subfundusz Emerytura 2045: 5
  6. Subfundusz Emerytura 2050: 5
  7. Subfundusz Emerytura 2055: 5
  8. Subfundusz Emerytura 2060: 5
- 3) 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.
- 4) Informacja odnośnie poziomu dźwigni finansowej:
  1. Maksymalny poziom dźwigni finansowej obliczanej metodą zaangażowania ustalono na poziomie 200% aktywów netto dla wszystkich subfunduszy wydzielonych w ramach Millennium PPK SFIO.
  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 I kwartał 2021r. :

<i>Stan</i>	<i>Emerytura 2025</i>	<i>Emerytura 2030</i>	<i>Emerytura 2035</i>	<i>Emerytura 2040</i>	<i>Emerytura 2045</i>	<i>Emerytura 2050</i>	<i>Emerytura 2055</i>	<i>Emerytura 2060</i>
<i>Stan na 31-03-2021</i>	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	102%
<i>Min</i>	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%
<i>Średnia</i>	101%	101%	101%	102%	102%	102%	102%	102%
<i>Max</i>	109%	110%	108%	109%	108%	109%	109%	110%
<i>Limit (max)</i>	120%	130%	140%	140%	150%	150%	150%	150%

