

**SPRAWOZDANIE ROCZNE
ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO**

**Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty**

za okres od 1 stycznia 2021 roku do 31 grudnia 2021 roku

OŚWIADCZENIE ZARZĄDU

Zgodnie z art. 222d ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. 2004 nr 146 poz. 1546, z późn. zm.) Zarząd Millennium Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A., przedstawia sprawozdanie roczne alternatywnego funduszu inwestycyjnego, Millennium PPK Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, na które składają się:

1. Bilans Funduszu sporządzony na dzień 31 grudnia 2021 r. wykazujący aktywa netto i kapitały w wysokości 58 183 tys. zł.
2. Rachunek wyniku z operacji za okres od 1 stycznia 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. wykazujący dodatni wynik z operacji w kwocie 3 256 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. 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	2021-12-31	2020-12-31
I. Aktywa	58 299	20 584
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	2 020	444
2. Należności	113	5
3. Transakcje reverse repo/buy-sell back	-	-
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	46 214	17 218
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku	9 952	2 917
6. Pozostałe aktywa	-	-
II. Zobowiązania	116	33
1) Zobowiązania własne subfunduszy	116	33
2) Zobowiązania proporcjonalne funduszu/subfunduszu	-	-
III. Aktywa netto (I - II)	58 183	20 551
IV. Kapitał Funduszu/Subfunduszu	52 607	18 231
1. Kapitał wpłacony	55 851	18 648
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-3 244	-417
V. Dochody zatrzymane	965	130
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	574	115
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	391	15
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	4 611	2 190
VII. Kapitał Funduszu/Subfunduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	58 183	20 551

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

II. RACHUNEK ZYSKÓW I STRAT

POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 01-01-2021 do 31-12-2021	od 01-01-2020 do 31-12-2020
I. Przychody z lokat	611	115
Dywidendy i inne udziały w zyskach	404	40
Przychody odsetkowe	207	75
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Dodatnie saldo różnic kursowych	-	-
Pozostałe	-	-
II. Koszty Funduszu/Subfunduszu	842	60
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	148	-
- stała część wynagrodzenia	148	-
- zmienna część wynagrodzenia	-	-
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	-	-
Oplaty dla Depozytariusza	590	60
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów Funduszu/Subfunduszu	-	-
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	-	-
Oplaty za usługi w zakresie rachunkowości	104	-
Oplaty za usługi w zakresie zarządzania aktywami Funduszu/Subfunduszu	-	-
Oplaty za usługi prawne	-	-
Oplaty za usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	-	-
Koszty odsetkowe	-	-
Koszty związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Ujemne saldo różnic kursowych	-	-
Pozostałe	-	-
III. Koszty pokrywane przez Towarzystwo	690	60
IV. Koszty Funduszu/Subfunduszu netto (II-III)	152	-
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	459	115
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	2 797	2 198
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	376	15
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	2 421	2 183
- z tytułu różnic kursowych	-	-
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	3 256	2 313
VIII. Podatek dochodowy	-	-

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

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

Millennium PPK

Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2021 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, w dniu 10 marca 2021 roku, Towarzystwo wprowadziło następujące istotne zmiany w treści informacji dla klientów Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego:

- 1) na stronie tytułowej datę sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Informacji dla Klienta, zastąpiono datą „10 marca 2021 r.”;
- 2) zmieniono treść pkt 13, który otrzymał następujące brzmienie:

„13) Informację o opłatach i kosztach ponoszonych bezpośrednio lub pośrednio przez uczestników funduszu oraz inwestorów alternatywnej spółki inwestycyjnej lub unijnego AFI oraz maksymalną ich wysokość;

Wymagane informacje o opłatach i kosztach ponoszonych bezpośrednio lub pośrednio przez uczestników Funduszu znajdują się w Prospekcie, Rozdział 3 „Dane o funduszu”, w punktach zatytułowanych „Informacje o wysokości opłat i prowizji związanych z uczestnictwem w Subfunduszu, sposobie ich naliczania i pobierania oraz o kosztach obciążających Subfundusz”, o następujących numerach:

– Subfundusz Emerytura 2025	pkt 19,
– Subfundusz Emerytura 2030	pkt 25,
– Subfundusz Emerytura 2035	pkt 31,
– Subfundusz Emerytura 2040	pkt 37,
– Subfundusz Emerytura 2045	pkt 43,
– Subfundusz Emerytura 2050	pkt 49,
– Subfundusz Emerytura 2055	pkt 55,
– Subfundusz Emerytura 2060	pkt 61,

- Subfundusz Emerytura 2065 pkt 65.

oraz w Prospekcie, Załącznik nr 2 Statut Funduszu, w paragrafach zatytułowanych „Rodzaje, wysokość, sposób kalkulacji i terminy pokrywania kosztów obciążających Fundusz” oraz „Opłata manipulacyjna”, znajdujących się odpowiednio o następujących numerach:

- Subfundusz Emerytura 2025 \$25 - 26,
- Subfundusz Emerytura 2030 \$35 - 36,
- Subfundusz Emerytura 2035 \$45 - 46,
- Subfundusz Emerytura 2040 \$55 - 56,
- Subfundusz Emerytura 2045 \$65 - 66,
- Subfundusz Emerytura 2050 \$75 - 76,
- Subfundusz Emerytura 2055 \$85 - 86,
- Subfundusz Emerytura 2060 \$95 - 96,
- Subfundusz Emerytura 2065 \$105 - 106.”;

3) po pkt 18 dodano pkt 19, który 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.”

Informacja do sprawozdania rocznego AFI
Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2021 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 2021 roku wynosiła 37 osób fizycznych, co stanowiło 30,98 pełnych etatów.
- 2) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 4 897 730,01 złotych.
- 3) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 500 192,82 złotych.
- 4) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom, których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 3 340 723,14 złotych.
- 5) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom, o których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 384 450,50 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 31-12-2021

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 31-12-2021

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 01-01-2021 do 31-12-2021			
	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	-	-	-	-
- Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-