

# **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:**

12 maja 2022 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
9. Subfundusz Emerytura 2065: 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 finansowe 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 2022r. :

| <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>Emerytura 2065</i> |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>Stan na 31-03-2022</b> | 100%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  |
| <b>Min</b>                | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  | 100%                  |
| <b>Średnia</b>            | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 101%                  | 102%                  |
| <b>Max</b>                | 107%                  | 108%                  | 107%                  | 107%                  | 106%                  | 107%                  | 107%                  | 111%                  | 109%                  |
| <b>Limit (max)</b>        | 120%                  | 130%                  | 140%                  | 140%                  | 150%                  | 150%                  | 150%                  | 150%                  | 150%                  |