

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:

13 września 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:
 - i. Subfundusz Emerytura 2025: 120% aktywów netto;
 - ii. Subfundusz Emerytura 2030: 130% aktywów netto;
 - iii. Subfundusz Emerytura 2035: 140% aktywów netto;
 - iv. Subfundusz Emerytura 2040: 150% aktywów netto;
 - v. Subfundusz Emerytura 2045: 150% aktywów netto;
 - vi. Subfundusz Emerytura 2050: 150% aktywów netto;
 - vii. Subfundusz Emerytura 2055: 150% aktywów netto;
 - viii. Subfundusz Emerytura 2060: 150% aktywów netto;
 - ix. Subfundusz Emerytura 2065: 150% aktywów netto;

2. Fundusz nie wykorzystuje ponownie zabezpieczeń oraz nie posiada gwarancji udzielonych na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej.

3. Informacja o poziomie ekspozycji AFI za okres II 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>
<i>Stan na 30-06-2022</i>	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%
<i>Min</i>	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%
<i>Średnia</i>	101%	101%	101%	101%	101%	101%	101%	101%	102%
<i>Max</i>	108%	107%	105%	106%	105%	105%	105%	107%	112%
<i>Limit (max)</i>	120%	130%	140%	140%	150%	150%	150%	150%	150%