

**SPRAWOZDANIE ROCZNE
ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO**

**Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty**

za okres od 1 stycznia 2023 roku do 31 grudnia 2023 roku

OŚWIADCZENIE ZARZĄDU

Zgodnie z art. 222d ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. 2023 poz. 681, 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 2023 r. wykazujący aktywa netto i kapitały w wysokości 167 761 tys. zł.
2. Rachunek wyniku z operacji za okres od 1 stycznia 2023 r. do 31 grudnia 2023 r. wykazujący dodatni wynik z operacji w kwocie 26 244 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	2023-12-31	2022-12-31
I. Aktywa	168 154	94 466
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	4 198	4 559
2. Należności	175	257
3. Transakcje reverse repo/buy-sell back	-	-
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	135 927	72 765
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku	27 854	16 885
6. Pozostałe aktywa	-	-
II. Zobowiązania	393	1 520
1) Zobowiązania własne subfunduszy	393	1 520
2) Zobowiązania proporcjonalne funduszu/subfunduszu	-	-
III. Aktywa netto (I - II)	167 761	92 946
IV. Kapitał Funduszu/Subfunduszu	141 894	93 323
1. Kapitał wpłacony	164 311	101 927
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-22 417	-8 604
V. Dochody zatrzymane	4 366	1 650
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	5 793	2 447
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-1 427	-797
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	21 501	-2 027
VII. Kapitał Funduszu/Subfunduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	167 761	92 946

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

II. RACHUNEK ZYSKÓW I STRAT

POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 01-01-2022 do 31-12-2022	od 01-01-2022 do 31-12-2022
I. Przychody z lokat	4 304	2 147
Dywidendy i inne udziały w zyskach	1 617	1 019
Przychody odsetkowe	2 687	1 128
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Dodatnie saldo różnic kursowych	-	-
Pozostałe	-	-
II. Koszty Funduszu/Subfunduszu	1 302	987
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	483	271
- stała część wynagrodzenia	483	271
- zmienna część wynagrodzenia	-	-
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	-	-
Oplaty dla Depozytariusza	813	713
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów Funduszu/Subfunduszu	-	-
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	2	1
Oplaty za usługi w zakresie rachunkowości	-	-
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	4	2
Pozostałe	-	-
III. Koszty pokrywane przez Towarzystwo	344	713
IV. Koszty Funduszu/Subfunduszu netto (II-III)	958	274
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	3 346	1 873
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	22 898	-7 826
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-630	-1 188
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	23 528	-6 638
- z tytułu różnic kursowych	-42	-
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	26 244	-5 953
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 2023 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, Towarzystwo nie wprowadziło żadnych istotnych zmian w treści informacji dla klientów Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego.

Informacja do sprawozdania rocznego AFI
Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2022 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 2023 roku wynosiła 38 osób fizycznych (33,15 etatów).
- 2) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 6 546 623,72 złotych.
- 3) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 1 020 646,68 złotych.
- 4) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom, których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 4 452 651,43 złotych.
- 5) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom, o których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 714 112,92 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 31.12.2023

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 31.12.2023

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 01.01.2023 do 31.12.2023			
	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”)	-	-	-	-