

**SPRAWOZDANIE ROCZNE
ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO**

**Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty**

za okres od 1 stycznia 2024 roku do 31 grudnia 2024 roku

OŚWIADCZENIE ZARZĄDU

Zgodnie z art. 222d ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. 2024 poz. 1034, 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 2024 r. wykazujący aktywa netto i kapitały w wysokości 236 695 tys. zł,
2. Rachunek wyniku z operacji za okres od 1 stycznia 2024 r. do 31 grudnia 2024 r. wykazujący dodatni wynik z operacji w kwocie 8 760 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	2024-12-31	2023-12-31
I. Aktywa	237 234	168 154
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	5 364	4 198
2. Należności	401	175
3. Transakcje reverse repo/buy-sell back	-	-
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	200 410	135 927
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku	31 059	27 854
6. Pozostałe aktywa	-	-
II. Zobowiązania	539	393
1) Zobowiązania własne subfunduszy	539	393
2) Zobowiązania proporcjonalne funduszu/subfunduszu	-	-
III. Aktywa netto (I - II)	236 695	167 761
IV. Kapitał Funduszu/Subfunduszu	202 068	141 894
1. Kapitał wpłacony	241 595	164 311
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-39 527	-22 417
V. Dochody zatrzymane	11 150	4 366
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	12 853	5 793
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-1 703	-1 427
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	23 477	21 501
VII. Kapitał Funduszu/Subfunduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	236 695	167 761

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych.

II. RACHUNEK ZYSKÓW I STRAT

POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 01-01-2024 do 31-12-2024	od 01-01-2023 do 31-12-2023
I. Przychody z lokat	8 394	4 304
Dywidendy i inne udziały w zyskach	4 118	1 617
Przychody odsetkowe	4 276	2 687
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Dodatnie saldo różnic kursowych	-	-
Pozostałe	-	-
II. Koszty Funduszu/Subfunduszu	1 637	1 302
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	788	483
- stała część wynagrodzenia	788	483
- zmienna część wynagrodzenia	-	-
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	-	-
Oplaty dla Depozytariusza	842	813
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów Funduszu/Subfunduszu	-	-
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	-	2
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	5	4
Pozostałe	2	-
III. Koszty pokrywane przez Towarzystwo	303	344
IV. Koszty Funduszu/Subfunduszu netto (II-III)	1 334	958
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	7 060	3 346
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	1 700	22 898
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-276	-630
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	1 976	23 528
- z tytułu różnic kursowych	63	-42
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	8 760	26 244
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 2024 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 wprowadziło następujące istotne zmiany w treści informacji dla klientów Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego:

— w dniu 10 stycznia 2024 roku:

- 1) Na stronie tytułowej datę sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Informacji dla Klienta, zastępuje się datą „11 stycznia 2024 r.”;
- 2) W pkt 2) zmienia się informację dotyczącą Podmiotu uprawnionego do badania sprawozdań finansowych Funduszu w ten sposób, że wskazuje się jako ten podmiot: „Deloitte Assurance sp. z o.o. z siedzibą w Warszawie, Al. Jana Pawła II, 00-133 Warszawa.”.

— w dniu 29 maja 2024 roku:

- 1) Na stronie tytułowej datę sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Informacji dla Klienta, tj. datę „11 stycznia 2024 r.”, zastępuje się datą „29 maja 2024 r.”;
- 2) W pkt 2) zmienia się informację dotyczącą Podmiotu zarządzającego Funduszem w zakresie jego adresu, w ten sposób, że wskazuje się jako adres tego podmiotu: „ul. Stanisława Żaryna 2A, 02-593 Warszawa”;
- 3) W pkt 2) zmienia się informację dotyczącą Podmiotu uprawnionego do badania sprawozdań finansowych Funduszu w ten sposób, że wskazuje się jako ten podmiot: „Deloitte Assurance Polska sp. z o.o. sp.k. z siedzibą w Warszawie, Al. Jana Pawła II, 00-133 Warszawa.”.

Informacja do sprawozdania rocznego AFI
Millennium PPK
Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

w okresie od 1 stycznia do 31 grudnia 2024 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 2024 roku wynosiła 41 osób fizycznych (35,18 etatów).
- 2) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 7 336 510,81 złotych.
- 3) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom w okresie sprawozdawczym wyniosło 1 099 035,28 złotych.
- 4) Wynagrodzenie stałe wypłacone pracownikom, których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 4 726 872,27 złotych.
- 5) Wynagrodzenie zmienne wypłacone pracownikom, o których mowa w art. 47a ust. 1, w okresie sprawozdawczym wyniosło 721 497,69 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 31.12.2024

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 31.12.2024

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 01.01.2024 do 31.12.2024			
	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”)	-	-	-	-