

Ogłoszenie

z dnia 11 lipca 2023 r.

o zmianie statutu Generali Fundusze Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego

Niniejszym, Generali Investments Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. ogłasza o zmianie statutu Generali Fundusze Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego, w ten sposób że:

1) art. 42 ust. 1 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„1. Fundusz lokując Aktywa Subfunduszu przestrzega zasad i ograniczeń wynikających ze Statutu i Ustawy, stosując zasady i ograniczenia inwestycyjne dla funduszu inwestycyjnego otwartego.”

2) art. 42 ust. 2 pkt 5) statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„5) akcje, warranty subskrypcyjne, prawa do akcji, prawa poboru, kwity depozytowe oraz inne prawa majątkowe, które zgodnie z Ustawą, mogą być przedmiotem lokat Subfunduszu, na zasadach określonych w art. 43 ust. 8,”

3) art. 42 ust. 2 pkt 7) statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„7) jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne, tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne oraz tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą.”

4) art. 42 ust. 3 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„3. Co najmniej 50% Aktywów Subfunduszu będzie lokowane w Instrumenty Rynku Pieniężnego oraz dłużne papiery wartościowe denominowane w euro.”

5) w art. 42 statutu Funduszu po ust. 3 dodaje się ust. 3a, którym pkt 3-4 otrzymują następujące brzmienie:

3) Instrumenty Rynku Pieniężnego inne niż określone w pkt 1) i 2) powyżej, spełniające wymogi, o których mowa w art. 93 ust. 1 pkt 4) lit. a) – c) Ustawy, lub których emitent spełnia te wymogi,

4) papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego, inne niż określone w pkt 1) - 3) powyżej, z tym że łączna wartość tych lokat nie może przewyższyć 10% wartości Aktywów Subfunduszu.”

6) w art. 42 statutu Funduszu skreśla się w całości ust. 4 i ust. 5,

7) art. 42 ust. 6 statutu Funduszu część wstępna [przed pkt 1), pkt 2) i pkt 3)] statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„6. Z zastrzeżeniem ust. 7 oraz na warunkach wskazanych w Ustawie i w aktach wykonawczych wydanych na podstawie art. 116d Ustawy, Fundusz, na rachunek Subfunduszu, może zawierać umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne

oraz umowy mające za przedmiot Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, zarówno w celu ograniczenia ryzyka inwestycyjnego jak i w celu zapewnienia sprawnego zarządzania portfelem inwestycyjnym, w zakresie następujących rodzajów Instrumentów Pochodnych:”

8) w art. 42 ust. 8 pkt 3) statutu Funduszu kropkę zastępuje się przecinkiem, a następnie po pkt 3) dodaje się pkt 4) w następującym brzmieniu:

„4) jeśli na podstawie analizy rynku lub z powodu istotnych wydarzeń gospodarczych, według oceny zarządzającego istnieje znaczące ryzyko spadku wartości inwestycji w wyniku zmiany stopy procentowej, w celu ograniczenia tego ryzyka, z zastrzeżeniem, że nie będą wykorzystywane do zamiany aktywa utrzymywane na zaspokojenie bieżących zobowiązań Subfunduszu.”

9) w art. 42 statutu Funduszu po ust. 8 dodaje się ust. 8a, w którym pkt 2 otrzymuje następujące brzmienie:

2) utrzymuje taką część Aktywów, która pozwala na realizację transakcji. Aktywa te obejmują w szczególności papiery wartościowe, Instrumenty Rynku Pieniężnego i inne prawa majątkowe – w przypadku, gdy transakcja przewiduje fizyczną dostawę tych papierów wartościowych, Instrumentów Rynku Pieniężnego lub innych praw majątkowych albo środki pieniężne lub płynne papiery wartościowe – w przypadku, gdy transakcja przewiduje rozliczenie pieniężne.”

10) art. 42 ust. 10 część wstępna [przed pkt 1), pkt 2), pkt 3) i pkt 4)] statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„10. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może zawierać umowy, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, pod warunkiem, że:”

11) art. 42 ust. 10 pkt 1) statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„1) kontrahentem jest podmiot z siedzibą w Rzeczypospolitej Polskiej lub państwie członkowskim, podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym w tym państwie,”

12) art. 42 ust. 11 część wstępna [przed pkt 1) i pkt 2)] statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„11. Przy stosowaniu limitów inwestycyjnych, o których mowa w art. 96 - 100 Ustawy, Fundusz uwzględnia kwotę zaangażowania w Instrumenty Pochodne w ten sposób, że:”

13) w art. 42 statutu Funduszu skreśla się w całości ust. 13a,

14) art. 42 ust. 14 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„14. Maksymalna Ekspozycja AFI Subfunduszu wyliczona przy zastosowaniu metody określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać

maksymalnego limitu Ekspozycji AFI określonego dla specjalistycznych funduszy inwestycyjnych otwartych stosujących zasady i ograniczenia inwestycyjne określone dla funduszy inwestycyjnych otwartych wynikającego z przepisów wydanych na podstawie art. 48c ust. 3 Ustawy.”

15) art. 42 ust. 15 część wstępna [przed pkt 1), pkt 2), pkt 3) i pkt 4)] statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„15. Fundusz działający na rzecz Subfunduszu ustala wartość ryzyka kontrahenta, rozumianą jako wartość ustalonego przez Fundusz niezrealizowanego zysku na transakcjach, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne. Dla potrzeb wyznaczania wartości ryzyka kontrahenta, przy ustalaniu niezrealizowanego zysku, o którym mowa w zdaniu poprzednim, nie uwzględnia się opłat bądź świadczeń ponoszonych przez Fundusz na rachunek Subfunduszu przy zawarciu transakcji, w szczególności wartości zapłaconej premii przy zakupie opcji. Jeżeli Fundusz na rachunek Subfunduszu posiada otwarte pozycje w Niewystandaryzowanych Instrumentach Pochodnych z tytułu kilku transakcji z tym samym podmiotem, wartość ryzyka kontrahenta jest wyznaczana jako różnica niezrealizowanych zysków i strat na wszystkich takich transakcjach, o ile:”

16) art. 42 ust. 16 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„16. Wartość ryzyka kontrahenta w odniesieniu do wszystkich transakcji, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne zawartych, z tym kontrahentem, nie może przekraczać:

- 1) 10% wartości Aktywów Subfunduszu - w przypadku transakcji rozliczanych przez CCP;
- 2) 10% wartości Aktywów Subfunduszu - w przypadku gdy kontrahentem jest instytucja kredytowa, bank krajowy lub bank zagraniczny;
- 3) 5% wartości aktywów funduszu - w innych przypadkach niż określone w pkt 1 i 2.”

17) w art. 42 ust. 16b pkt 3) statutu Funduszu kropkę zastępuje się przecinkiem, a następnie po pkt 3) dodaje się pkt 4) w następującym brzmieniu:

„4) ewentualne nabycie przez fundusz praw z papieru wartościowego lub Instrumentu Rynku Pieniężnego w wyniku realizacji zabezpieczeń na dzień przyjęcia zabezpieczenia nie spowoduje naruszenia art. 96-100 oraz art. 104 Ustawy.”

18) w art. 42 statutu Funduszu skreśla się w całości ust. 17,

19) po art. 42 statutu Funduszu dodaje się art. 42a, w którym ust. 1,2,4,5,6,7,8,10,11,12,14,15,16,17.

„Art. 42a. Zasady dywersyfikacji lokat i inne ograniczenia inwestycyjne *Generali Euro*

1. Środki pieniężne Uczestników będą lokowane przez Fundusz działający na rachunek Subfunduszu w kategorii lokat określone w art. 42 ust. 2 Statutu w sposób określony w art. 43 ust. 1 Statutu, przy czym co najmniej 50% Aktywów Subfunduszu będzie lokowane w instrumenty rynku pieniężnego oraz dłużne papiery wartościowe denominowane w euro.
2. Z zastrzeżeniem ustępów poniższych, do 5% wartości Aktywów Subfunduszu może być lokowane w papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot.
4. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, z zastrzeżeniem postanowień niniejszego ustępu i ust. 5, nie może lokować więcej niż 25% Wartości Aktywów Subfunduszu w:
 - 1) listy zastawne wyemitowane przez jeden bank hipoteczny w rozumieniu ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. o listach zastawnych i bankach lub
 - 2) dłużne papiery wartościowe wyemitowane:
 - a) przed dniem 8 lipca 2022 r. przez jedną instytucję kredytową, która podlega szczególnemu nadzorowi publicznemu mającemu na celu ochronę posiadaczy tych papierów wartościowych, pod warunkiem że kwoty uzyskane z emisji tych papierów wartościowych są inwestowane przez emitenta w aktywa, które w całym okresie do dnia wykupu zapewniają spełnienie wszystkich świadczeń pieniężnych wynikających z tych papierów wartościowych oraz w przypadku niewypłacalności emitenta zapewniają pierwszeństwo w odzyskaniu wszystkich świadczeń pieniężnych wynikających z tych papierów wartościowych,
 - b) od dnia 8 lipca 2022 r. przez jedną instytucję kredytową zgodnie z przepisami państwa członkowskiego wdrażającymi dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2162 z dnia 27 listopada 2019 r. w sprawie emisji obligacji zabezpieczonych i nadzoru publicznego nad obligacjami zabezpieczonymi oraz zmieniającą dyrektywy 2009/65/WE i 2014/59/UE (Dz. Urz. UE L 328 z 18.12.2019, str. 29) i zabezpieczone aktywami stanowiącymi zabezpieczenie, w rozumieniu przepisów tej dyrektywy, względem których nabywcom tych papierów wartościowych bezpośrednio przysługuje pierwszeństwo w odzyskaniu świadczeń wynikających z tych papierów wartościowych.
5. Suma lokat w papiery wartościowe, o których mowa w ust. 4, nie może przekraczać 80% Wartości Aktywów Funduszu. Suma lokat w listy zastawne nie może przekraczać 80% Wartości Aktywów Funduszu. Łączna wartość lokat w papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego wyemitowane przez ten sam bank

hipoteczny, depozyty w tym podmiocie oraz wartość ryzyka kontrahenta wynikająca z transakcji, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, zawartych z tym samym bankiem, nie może przekroczyć 35% Wartości Aktywów Funduszu.

6. Przepis ust. 2 i ust. 3 nie stosuje się do depozytów i transakcji, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, zawieranych z podmiotami podlegającymi nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym.
7. Łączna wartość lokat w papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego wyemitowane przez jeden podmiot, depozyty w tym podmiocie oraz wartość ryzyka kontrahenta wynikająca z transakcji, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, zawartych z tym podmiotem nie może przekroczyć 20% wartości Aktywów Subfunduszu.
8. Podmioty należące do grupy kapitałowej w rozumieniu Ustawy o Rachunkowości, dla której jest sporządzane skonsolidowane sprawozdanie finansowe, traktuje się, do celu stosowania limitów inwestycyjnych, jako jeden podmiot.
10. Łączna wartość lokat Subfunduszu w papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego, w których Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, ulokował ponad 5% wartości Aktywów Subfunduszu nie więcej jednak niż 10%, wyemitowane przez podmioty należące do grupy kapitałowej, oraz inne podmioty nie może przekroczyć 40% wartości Aktywów Subfunduszu.
11. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może lokować do 35% wartości Aktywów Subfunduszu w papiery wartościowe emitowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski, jednostkę samorządu terytorialnego, państwo członkowskie, jednostkę samorządu terytorialnego państwa członkowskiego, państwo należące do OECD lub międzynarodową instytucję finansową, której członkiem jest Rzeczpospolita Polska lub co najmniej jedno państwo członkowskie.
12. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może lokować do 35% wartości Aktywów Subfunduszu w papiery wartościowe poręczone lub gwarantowane przez podmioty, o których mowa w ust. 11 powyżej, przy czym łączna wartość lokat w papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego wyemitowane przez podmiot, którego papiery wartościowe są poręczane lub gwarantowane, depozytów w tym podmiocie oraz wartość ryzyka kontrahenta wynikająca z transakcji, których przedmiotem są Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, zawartych z tym podmiotem nie może przekroczyć 35% wartości Aktywów Subfunduszu.
14. W przypadku, o którym mowa w ust. 13, Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, jest obowiązany dokonywać lokat w papiery wartościowe co najmniej

sześciu różnych emisji, z tym że wartość lokaty w papiery żadnej z tych emisji nie może przewyższać 30% wartości Aktywów Subfunduszu.

15. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może lokować aktywa Subfunduszu w jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych, tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne lub tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania z siedzibą za granicą spełniające wymogi określone w art. 101 ust. 1 pkt 3 Ustawy, które zgodnie z ich statutem lub regulaminem inwestują powyżej 10% aktywów w jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych oraz tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych i instytucji wspólnego inwestowania, jeżeli, zgodnie ze statutem funduszu, uczestnikami funduszu nie mogą być fundusze inwestycyjne otwarte, fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania z siedzibą za granicą zarządzane przez towarzystwo zarządzające funduszem lub podmiot z grupy kapitałowej towarzystwa – Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może lokować aktywa Subfunduszu do 20% wartości Aktywów Subfunduszu w jednostki uczestnictwa jednego funduszu inwestycyjnego otwartego lub tytuły uczestnictwa funduszu zagranicznego lub instytucji wspólnego inwestowania, o której mowa w art. 101 ust. 1 Ustawy.
16. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, nie może lokować więcej niż 20% Wartości Aktywów Subfunduszu w depozyty w tym samym banku krajowym lub tej samej instytucji kredytowej.
17. Łączna wartość pożyczonych przez Fundusz papierów wartościowych wchodzących w skład lokat Subfunduszu nie może przekroczyć 30% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

20) w art. 43 ust. 1 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

- „1. Środki pieniężne Uczestników będą lokowane przez Fundusz na rachunek Subfunduszu w Instrumenty Rynku Pieniężnego i dłużne papiery wartościowe. Instrumenty Rynku Pieniężnego kwalifikowalne jako lokaty funduszy rynku pieniężnego w rozumieniu artykułu 10 Rozporządzenia FRP nie będą stanowić istotnego udziału. Jednocześnie, udział pozostałych kategorii lokat określonych w art. 42 ust. 2 będzie niższy niż 30% wartości Aktywów Subfunduszu.”

21) art. 44 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„Art. 44. Pożyczki i kredyty

1. Fundusz działający na rachunek Subfunduszu, może zaciągać, wyłącznie w bankach krajowych lub instytucjach kredytowych, pożyczki i kredyty, o terminie spłaty do roku, w łącznej wysokości nieprzekraczającej 10% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu w chwili zawarcia umowy pożyczki lub kredytu.

2. Fundusz, działając na rachunek Subfunduszu, może udzielać innym podmiotom pożyczek, których przedmiotem są zdematerializowane papiery wartościowe, na zasadach określonych w Ustawie.”

Zmiany opisane w pkt 1-21 powyżej, na podstawie art. 24 ust. 8a ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tekst jedn.: Dz.U. z 2023 r., poz. 681 z późn. zm.) wejdą w życie pod warunkiem uzyskania zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego na inne zmiany statutu, a wejście w życie powyższych zmian będzie zgodne z terminem wejścia w życie zmian wymagających zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego, nie krótszym jednak niż 3 miesiące od dnia niniejszego ogłoszenia. Fakt ziszczenia lub nieziszczenia się warunku, o którym mowa w zdaniu poprzednim, zostanie podany w osobnym ogłoszeniu.