

## Ogłoszenie

z dnia 30 grudnia 2024 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) **w art. 5 statutu Funduszu po pkt 7) dodaje się pkt 7a) w następującym brzmieniu:**  
„7a) Dźwignia Finansowa AFI- metoda zwiększania Ekspozycji AFI, w szczególności przez pożyczanie środków pieniężnych lub papierów wartościowych lub przez inwestycje w Instrumenty Pochodne;”
- 2) **art. 42 ust. 14 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:**  
„14. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 160% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”
- 3) **art. 59 ust. 22 i ust. 23 statutu Funduszu otrzymują (odpowiednio) nowe, następujące brzmienie:**  
„22. Transakcje dotyczące instrumentów pochodnych będą dokonywane zgodnie z rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne.  
23. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w

art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 170% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

- 4) **w art. 66 statutu Funduszu po ust. 8 dodaje się ust. 8a w następującym brzmieniu:**
- „8a. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 160% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”
- 5) **art. 75 ust. 18 i ust. 19 statutu Funduszu otrzymują (odpowiednio) nowe, następujące brzmienie:**
- „18. Transakcje dotyczące instrumentów pochodnych będą dokonywane zgodnie z rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne. Fundusz działający na rachunek Subfunduszu ustala w każdym Dniu Wyceny wartość pozycji w bazie danego Instrumentu Pochodnego w ten sposób, że od wartości zajętych pozycji długich w bazie, wynikających z Instrumentu Pochodnego, odejmuje wartość zajmowanych pozycji krótkich w takiej samej bazie, wynikających z Instrumentu Pochodnego o takim samym terminie rozliczenia lub płatności w pełni kompensującego ryzyka wynikające z zajętych pozycji.
19. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 160% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”
- 6) **art. 100 ust. 24 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:**
- „24. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI.

Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 170% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

**7) art. 116 ust. 22 i ust. 23 statutu Funduszu otrzymują (odpowiednio) nowe, następujące brzmienie:**

„22. Transakcje dotyczące instrumentów pochodnych będą dokonywane zgodnie z rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne.

23. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 180% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

**8) art. 156 ust. 21 i ust. 22 statutu Funduszu otrzymują (odpowiednio) nowe, następujące brzmienie:**

„21. Transakcje dotyczące instrumentów pochodnych będą dokonywane zgodnie z rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne.

22. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 140% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

**9) art. 164 ust. 21 i ust. 22 statutu Funduszu otrzymują (odpowiednio) nowe, następujące brzmienie:**

„21. Transakcje dotyczące instrumentów pochodnych będą dokonywane zgodnie z

rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne.

22. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 140% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

10) **art. 172 ust. 16 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:**

- „16. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 160% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

11) **art. 180 ust. 18 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:**

- „18. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 140% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

12) **art. 188 ust. 18 statutu Funduszu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:**

- „18. Maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI wyznaczający między innymi maksymalny poziom zaangażowania Subfunduszu w Instrumenty Pochodne, w tym w Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, oraz transakcje z przyrzeczeniem odkupu, wyznacza się poprzez wyliczenie Ekspozycji AFI. Określony przez Ekspozycję AFI maksymalny poziom Dźwigni Finansowej AFI Subfunduszu wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania określonej w

art. 8 Rozporządzenia 231/2013, nie może przekraczać 140% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.”

**Pozostałe postanowienia Statutu pozostają bez zmian.**

**Zmiany Statutu, o których mowa w pkt 1- 12 powyżej, nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego i na podstawie art. 24 ust. 8 pkt 1) ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi, wchodzi one w życie w terminie 3 miesięcy od dnia publikacji niniejszego ogłoszenia, tj. 30 marca 2025 r.**