Warszawa, 21 stycznia 2019 r.

Zmiana statutu ALTUS Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasolowego

ALTUS Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tj. Dz. U. z 2018 r. poz. 1355 z późn. zm., dalej zwana „Ustawą") niniejszym ogłasza zmianę statutu ALTUS Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasolowego:

1) w art. 2 ust. 4 lit. f) Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„ALTUS Subfundusz Konserwatywny,";

2) w art. 2 ust. 5 lit. f) Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„ALTUS Konserwatywny,";

3) tytuł rozdziału VI Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„Rozdział VI
ALTUS SUBFUNDUSZ KONSERWATYWNY";

4) w art. 10 po ust. 2 Statutu dodaje się nowy ust. 3 o następującym brzmieniu:
„3. Żaden z Subfunduszy nie jest funduszem rynku pieniężnego w rozumieniu rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1131 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie funduszy rynku pieniężnego (Dz. Urz. UE L 169 z 30.06.2017, str. 8-45) i w związku z tym nie dąży do zapewniania zysków odpowiadających stopom rynku pieniężnego lub utrzymania wartości inwestycji.";

5) w art. 68 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„2. Do 100% (sto procent) Aktywów Subfunduszu stanowią papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego emitowane, poręczone lub gwarantowane 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, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93 a Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych, z zastrzeżeniem ust. 3a.";

6) w art. 68 ust. 3 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„3. Nie więcej niż 30% (trzydzieści procent) Aktywów Subfunduszu stanowią listy zastawne, certyfikaty depozytowe, depozyty bankowe, dłużne papiery wartościowe i instrumenty Rynku Pieniężnego emitowane przez przedsiębiorstwa, a także akcje i obligacje zamienne na akcje, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93 a Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych, z zastrzeżeniem ust. 3a.";

7) w art. 68 po ust. 3 Statutu dodaje się nowy ust. 3a o następującym brzmieniu:
„3a. Fundusz może nabywać do portfela inwestycyjnego Subfunduszu Instrumenty Rynku Pieniężnego lub inne aktywa finansowe kwalifikowane jako Aktywa krótkoterminowe wyłącznie w zakresie niezbędnym do zarządzania bieżącą płynnością Subfunduszu.";

8) w art. 80 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„2. Instrumenty dłużne, tj.: obligacje, bony skarbowe, listy zastawne, o ratingu nie niższym niż posiada Rzeczpospolita Polska, a ponadto także Instrumenty Rynku Pieniężnego stanowią co najmniej 30% (trzydzieści procent) Aktywów Subfunduszu, z zastrzeżeniem ust. 3a.";

9) w art. 80 ust. 3 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„3. Nie więcej niż 30% (trzydzieści procent) Aktywów Subfunduszu stanowią: obligacje państw innych niż innych niż Rzeczpospolita Polska o ratingu nie niższym niż rating na poziomie inwestycyjnym przyznanym przez co najmniej jedną z uznanych agencji ratingowych: Standard&Poor's, Moody's lub Fitch, przy czym obligacje wyemitowane przez jedno państwo nie mogą stanowić więcej niż 10 (dziesięć procent) Aktywów Subfunduszu, z zastrzeżeniem ust. 3a. Dłużne papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego emitowane przez przedsiębiorstwa, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93 a Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych, a także certyfikaty depozytowe i obligacje zamienne na akcje,

stanowią nie więcej niż 50% (pięćdziesiąt procent) Aktywów Subfunduszu, z zastrzeżeniem ust. 3a.";

10) w art. 80 Statutu po ust. 3 dodaje się nowy ust. 3a o następującym brzmieniu:
„3a. Fundusz może nabywać do portfela inwestycyjnego Subfunduszu Instrumenty Rynku Pieniężnego lub inne aktywa finansowe kwalifikowane jako Aktywa krótkoterminowe wyłącznie w zakresie niezbędnym do zarządzania bieżącą płynnością Subfunduszu.";

11) w art. 80 ust. 4 Statutu otrzymuje, nowe następujące brzmienie:
„4. Fundusz może inwestować Aktywa Subfunduszu w akcje lub obligacje zamienne na akcje tylko i wyłącznie w przypadku, gdy istnieje zobowiązanie drugiej strony do odkupu tych akcji lub obligacji zamiennych, z zastrzeżeniem ust. 3a. Zobowiązanie to powinno mieć charakter instrumentu dłużnego.";

12) w art. 92 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„2. Fundusz, z zastrzeżeniem ust. 3a, lokuje Aktywa Subfunduszu zgodnie z następującymi zasadami:

a) celem prowadzonej polityki inwestycyjnej Subfunduszu jest osiągnięcie stopy zwrotu zbliżonej do zmian indeksu WIG20short, obliczanego i publikowanego przez GPW, będącego indeksem pochodnym do indeksu WIG20 obliczanego i publikowanego przez GPW,
b) w celu osiągnięcia stopy zwrotu zbliżonej do zmian indeksu WIG20short oraz dążenia do osiągnięcia dodatkowej stopy zwrotu Fundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, o których mowa w art. 11 ust. 5 a w szczególności kontrakty terminowe na indeks WIG20.
c) część Aktywów Subfunduszu, która nie będzie wykorzystana jako depozyt zabezpieczający w związku z zawarciem umów, o których mowa w lit. b, Fundusz będzie inwestował w instrumenty dłużne, tj.: obligacje, bony skarbowe, listy zastawne, certyfikaty depozytowe, a ponadto także w dłużne papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego emitowane przez przedsiębiorstwa, Instrumenty Rynku Pieniężnego oraz waluty, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz do portfela inwestycyjnego Subfunduszu, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93 a Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych – lokaty te będą dokonywane w celu zwiększenia stopy zwrotu Subfunduszu, jednak podstawowym kryterium doboru rodzaju lokaty będzie zachowanie płynności i bezpieczeństwa inwestycji. Im mniejsza będzie zmienność na rynku tym więcej może znaleźć się w portfelu instrumentów mniej płynnych, za to bardziej rentownych.
d) w celu osiągnięcia dodatkowych przychodów Aktywa Subfunduszu mogą być również w ograniczonym zakresie inwestowane w instrumenty udziałowe, tj. akcje oraz instrumenty finansowe o podobnym charakterze takie jak w szczególności: prawa poboru, prawa do akcji, warranty subskrypcyjne, kwity depozytowe, których bazą są akcje (lub inne prawa majątkowe inkorporujące prawa z akcji), obligacje zamienne na akcje, a także inne zbywalne papiery wartościowe inkorporujące prawa majątkowe odpowiadające prawom z akcji – lokaty te będą dokonywane w sytuacji dużego prawdopodobieństwa osiągnięcia zysku z danej lokaty lub możliwości dokonania arbitrażu, w zakresie akcji spółek wchodzących w skład indeksu WIG20, to jest w szczególności jednoczesnego zakupu i sprzedaży instrumentów finansowych, akcji (instrumentu bazowego) i kontraktu terminowego (instrumentu pochodnego), w celu osiągnięcia przy niskim ryzyku zysku wynikającego z różnicy ich ceny, będącej konsekwencją nieefektywności rynku. Arbitraż będzie dokonywany w sytuacji, kiedy różnica wyceny instrumentu pochodnego i odpowiadającego im koszyka akcji będzie się różniła w taki sposób, że dokonanie transakcji arbitrażowej po uwzględnieniu kosztów przyniesie najpóźniej w dniu wygaśnięcia kontraktów dodatkową stopę zwrotu.";

13) w art. 92 ust. 3 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„3. Cel inwestycyjny Subfunduszu jest realizowany głównie poprzez zawieranie umów mających za przedmiot kontrakty terminowe na indeks WIG20, w ramach następujących limitów:

a) kontrakty terminowe na indeks WIG20, z zastrzeżeniem ograniczeń, o których mowa w ust. 4,
b) instrumenty udziałowe, tj.: akcje oraz instrumenty finansowe o podobnym charakterze takie jak w szczególności: prawa poboru, prawa do akcji, warranty subskrypcyjne, kwity depozytowe, których bazą są akcje (lub inne prawa majątkowe inkorporujące prawa z akcji), obligacje zamienne na akcje, a także inne zbywalne papiery wartościowe inkorporujące prawa majątkowe odpowiadające prawom z akcji - od 0% do 20% wartości Aktywów Subfunduszu,
c) instrumenty dłużne, tj.: obligacje, bony skarbowe, listy zastawne, certyfikaty depozytowe, a ponadto także dłużne papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego emitowane przez przedsiębiorstwa, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93 a Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych - od 0% do 90% wartości Aktywów Subfunduszu, oraz z zastrzeżeniem ust. 3a,
d) instrumenty finansowe, o których mowa w art. 11 ust. 4 - od 0% do 10% wartości Aktywów Subfunduszu,
e) depozyty, o których mowa w art. 11 ust. 1 lit. c) - od 0% do 25% wartości Aktywów Subfunduszu.";

14) w art. 92 po ust. 3 dodaje się nowy ust. 3a o następującym brzmieniu:

„3a. Fundusz może nabywać do portfela inwestycyjnego Subfunduszu Instrumenty Rynku Pieniężnego lub inne aktywa finansowe kwalifikowane jako Aktywa krótkoterminowe wyłącznie w zakresie niezbędnym do zarządzania bieżącą płynnością Subfunduszu.".

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 1) – 3) powyżej nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego i wchodzą w życie z dniem ogłoszenia, tj. z dniem 21 stycznia 2019 r.

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 4) – 14) powyżej nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego i wejdą w życie w terminie trzech miesięcy od dnia ogłoszenia o zmianie statutu, tj. w dniu 21 kwietnia 2019 r.