

Warszawa, 21 stycznia 2019 r.

Zmiany statutu SKOK Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Rynku Pieniężnego

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.) niniejszym ogłasza następujące zmiany statutu SKOK Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Rynku Pieniężnego:

- 1) tytuł Statutu Funduszu, w związku ze zmianą jego nazwy, otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„STATUT SEJF FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO OTWARTEGO STRATEGII DŁUŻNYCH”;
- 2) w art. 1 ust. 1 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„1. Fundusz jest osobą prawną i działa pod nazwą „SEJF Fundusz Inwestycyjny Otwarty Strategii Dłużnych”, zwany dalej w Statucie „Funduszem”;
- 3) w art. 1 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„2. Fundusz może używać nazwy skróconej w brzmieniu: „SEJF FIO Strategii Dłużnych”
- 4) w art. 3 ust. 25 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:
„25. **Statut** – niniejszy Statut SEJF Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Strategii Dłużnych.”;
- 5) w art. 10 Statutu po ust. 2 dodaje się nowy ust. 3 o następującym brzmieniu:
„3. Fundusz 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.”;
- 6) Art. 11 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„Artykuł 11

Rodzaje lokat

1. Z zastrzeżeniem kolejnych ustępów, postanowień art. 12 i 13 oraz przepisów Ustawy, Aktywa Funduszu lokowane będą w następujące kategorie lokat:
 - 1) papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski, papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim, a także na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim,
 - 2) depozyty w bankach krajowych lub instytucjach kredytowych, o terminie zapadalności nie dłuższym niż rok, płatne na żądanie lub które można wycofać przed terminem zapadalności, w tym depozyty walutowe zawierane w celach zarządzania bieżącą płynnością Funduszu, z zastrzeżeniem ust. 3,
 - 3) instrumenty rynku pieniężnego inne niż określone w pkt 1 i 2, jeżeli instrumenty te lub ich emitent podlegają regulacjom mającym na celu ochronę inwestorów i oszczędności oraz są:
 - a) emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski, jednostkę samorządu terytorialnego, właściwe centralne, regionalne lub lokalne władze publiczne Państwa Członkowskiego, albo przez bank centralny Państwa Członkowskiego, Europejski Bank Centralny, Unię Europejską lub Europejski Bank Inwestycyjny, państwo inne niż Państwo Członkowskie, albo, w przypadku państwa federalnego, przez jednego z członków federacji, albo przez organizację międzynarodową, do której należy co najmniej jedno Państwo Członkowskie, lub
 - b) emitowane, poręczone lub gwarantowane przez podmiot podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym, zgodnie z kryteriami określonymi prawem wspólnotowym, albo przez podmiot podlegający i stosujący się do zasad, które są co najmniej tak rygorystyczne, jak określone prawem wspólnotowym, lub

- c) emitowane przez podmiot, którego papiery wartościowe są w obrocie na rynku regulowanym, o którym mowa w pkt 1.
 - 4) papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego, inne niż określone w pkt 1 i 3, z tym że łączna wartość tych lokat nie może przewyższyć 10% wartości Aktywów Funduszu.
2. Lokowanie w papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego będące przedmiotem obrotu na rynku zorganizowanym, oraz w papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego, których dopuszczenie do takiego obrotu jest zapewnione, w państwie innym niż Rzeczpospolita Polska, Państwo Członkowskie lub państwo należące do OECD, wymaga uzyskania zgody KNF na dokonywanie lokat na określonej giełdzie lub rynku.
 3. KNF może udzielić zgody na lokowanie Aktywów Funduszu w depozyty w bankach zagranicznych pod warunkiem, że bank ten podlega nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym w zakresie co najmniej takim, jak określony w prawie wspólnotowym.
 4. Aktywa Funduszu mogą być lokowane w:
 - 1) jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych mających siedzibę na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej,
 - 2) tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne,
 - 3) tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, jeżeli:
 - a) instytucje te oferują publicznie tytuły uczestnictwa i umarzają je na żądanie uczestnika,
 - b) instytucje te podlegają nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym Państwa Członkowskiego lub państwa należącego do OECD oraz zapewniona jest, na zasadzie wzajemności, współpraca KNF z tym organem,
 - c) ochrona posiadaczy tytułów uczestnictwa tych instytucji jest taka sama jak posiadaczy jednostek uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych, w szczególności instytucje te stosują ograniczenia inwestycyjne co najmniej takie, jak określone w Rozdziale 1 Ustawy,
 - d) instytucje te są obowiązane do sporządzania rocznych i półrocznych sprawozdań finansowych,
 - pod warunkiem, że nie więcej niż 10% (dziesięć procent) wartości aktywów tych funduszy inwestycyjnych otwartych, funduszy zagranicznych lub instytucji może być, zgodnie z ich statutem lub regulaminem, zainwestowana łącznie w jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych oraz tytuły uczestnictwa innych funduszy zagranicznych i instytucji wspólnego inwestowania.”;
- 7) Art. 12 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„Artykuł 12

Kryteria doboru lokat

1. Główne kryteria doboru dłużnych papierów wartościowych do portfela Funduszu to:
 - 1) prognozy Funduszu co do kształtowania się bieżących i przyszłych rynkowych stóp procentowych i inflacji,
 - 2) analiza sytuacji makroekonomicznej,
 - 3) płynność inwestycji rozumiana jako możliwość szybkiego wycofania się z takiej inwestycji i możliwość szybkiej zamiany takiej inwestycji na środki pieniężne.
 - 4) zmienność cen papierów wartościowych i instrumentów rynku pieniężnego, w tym możliwość wzrostu lub spadku tych cen,
 - 5) oceny ryzyka utraty płynności papierów wartościowych i instrumentów rynku pieniężnego oraz niewypłacalności emitentów,

- 6) oceny ryzyka walutowego, w przypadku dokonywania lokat w papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego denominowane w walutach zagranicznych.
2. Główne kryteria doboru do portfela Funduszu kategorii lokat, o których mowa w art. 11 ust. 1 pkt 2 to:
 - 1) oprocentowanie depozytów,
 - 2) wiarygodność banku,
 - 3) płynność.
3. Główne kryteria doboru do portfela Funduszu kategorii lokat, o których mowa w art. 11 ust. 4 to:
 - 1) zgodność ze strategią i celem inwestycyjnym Funduszu,
 - 2) historyczne kształtowanie się stopy zwrotu,
 - 3) dostępność,
 - 4) koszty realizacji transakcji.”;
- 8) w art. 13 ust. 1 otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„1. Poza kryteriami doboru lokat, o których mowa w art. 12, podstawowym kryterium jest uzyskiwanie możliwie wysokiej stopy zwrotu przy jednoczesnym minimalizowaniu ryzyka związanego z niewypłacalnością emitenta, ryzyka zmienności stóp procentowych i ryzyka ograniczonej płynności. Ponadto, brane są pod uwagę następujące kryteria:

 - 1) dla lokat w dłużne papiery wartościowe i instrumenty rynku pieniężnego emitowane przez przedsiębiorstwa: stopa zwrotu ryzyko emitenta, płynność, termin wykupu, bieżące i przyszłe kształtowanie się stóp procentowych oraz inflacji,
 - 2) obligacje zamienne na akcje: rentowność obligacji, parytet i warunki wymiany na akcje, płynność obligacji,
 - 3) obligacje zagraniczne: rating kraju, rentowność obligacji, perspektywy kształtowania się stóp procentowych oraz inflacji.”;
- 9) w art. 13 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„2. Nie mniej niż 65% Aktywów Funduszu stanowią instrumenty rynku pieniężnego lub dłużne papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski lub inne podmioty wskazane w ust. 8, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93a Ustawy, oraz z zastrzeżeniem ust. 5. W ramach limitu określonego powyżej Aktywa Funduszu mogą być lokowane w kategorii lokat, o których mowa w art. 11 ust. 4, jeśli polityka inwestycyjna wskazanych tam funduszy inwestycyjnych, funduszy zagranicznych lub instytucji wspólnego inwestowania zakłada inwestowanie co najmniej 50% ich aktywów w lokaty, o których mowa w zdaniu pierwszym.”;
- 10) w art. 13 ust. 3 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„3. Nie więcej niż 35% Aktywów Funduszu stanowią instrumenty rynku pieniężnego lub dłużne papiery wartościowe emitowane przez przedsiębiorstwa, w tym: obligacje (w tym również obligacje uprawniające do objęcia akcji emitenta), listy zastawne, certyfikaty depozytowe, kwity depozytowe, których bazą są obligacje (lub inne papiery wartościowe inkorporujące prawa majątkowe odpowiadające prawom wynikającym z zaciągnięcia długu), a także inne zbywalne papiery wartościowe inkorporujące prawa majątkowe odpowiadające prawom wynikającym z zaciągnięcia długu, pod warunkiem, że instrumenty te spełniają kryteria wskazane w art. 93 i 93a Ustawy, oraz z zastrzeżeniem ust. 5. W ramach limitu określonego powyżej Aktywa Funduszu mogą być lokowane w kategorii lokat, o których mowa w art. 11 ust. 4, jeśli polityka inwestycyjna wskazanych tam funduszy inwestycyjnych, funduszy zagranicznych lub instytucji wspólnego inwestowania zakłada inwestowanie co najmniej 50% ich aktywów w lokaty, o których mowa w zdaniu pierwszym.”;
- 11) w art. 13 Statutu skreśla się ust. 4;
- 12) w art. 13 ust. 5 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„5. Do portfela inwestycyjnego Funduszu mogą być nabywane instrumenty rynku pieniężnego lub inne aktywa finansowe kwalifikowane jako Aktywa krótkoterminowe wyłącznie w zakresie niezbędnym do zarządzania bieżącą płynnością Funduszu.”;

13) w art. 13 Statutu skreśla się ust. 12 - 22;

14) w art. 14 ust. 2 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„2. Fundusz może udzielać innym podmiotom pożyczek, których przedmiotem są zdematerializowane papiery wartościowe, na warunkach określonych w art. 102 ust. 1 i 1a Ustawy.”;

15) w art. 14 ust. 3 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„3. Łączna wartość pożyczonych papierów wartościowych nie może przekroczyć 30% Wartości Aktywów Netto Funduszu.”;

16) w art. 14 ust. 4 Statutu otrzymuje nowe, następujące brzmienie:

„4. Łączna wartość pożyczonych papierów wartościowych i papierów wartościowych tego samego emitenta będących w portfelu inwestycyjnym Funduszu nie może przekroczyć mających zastosowanie do Funduszu limitów, o których mowa w art. 102 ust. 3 Ustawy.”.

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 1) – 4) powyżej nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego i wchodzi w życie z dniem ogłoszenia, tj. z dniem 21 stycznia 2019 r.

Zmiany statutu Funduszu wskazane w pkt 5) – 16) powyżej nie wymagały zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego i wejdą w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ogłoszenia, tj. 21 kwietnia 2019 r.