

Poznań, dnia 1 października 2024 roku

**OGŁOSZENIE O ZMIANACH STATUTU  
CASPAR PARASOLOWY FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO OTWARTEGO**

**Caspar Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych Spółka Akcyjna** z siedzibą w Poznaniu, mając na uwadze stanowisko Komisji Nadzoru Finansowego wyrażone w Komunikacie Urzędu Komisji Nadzoru Finansowego dotyczący informacji publikowanych przez fundusze inwestycyjne, niniejszym ogłasza o zmianach w statucie Caspar Parasolowego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego.

Poniższe zmiany pozwalają dostosować zapisy Statutu do wytycznych Komisji.

Poniższe zmiany wchodzi w życie po upływie 3 miesięcy od dnia ogłoszenia, tj. w dniu **1 stycznia 2025 roku.**

- w Rozdziale I Statutu Funduszu w §2 po punkcie 5a. dodaje się punkt 5b., który otrzymuje następującą treść:

„5b. **Duration** - średni ważony poszczególnymi terminami przepływów gotówkowych okres oczekiwania na wpływ środków pieniężnych z tytułu posiadania instrumentu finansowego o charakterze dłużnym.”

- w Rozdziale I Statutu Funduszu w §2 punkt 40., który otrzymuje następującą treść:

„40. **Zmodyfikowane Duration** – miara wrażliwości przedstawiająca szacowaną zmianę ceny instrumentu o charakterze dłużnym w odniesieniu do zmian poziomu rynkowych stóp procentowych.”

- w Rozdziale II Statutu Funduszu w §1 ust. 1 otrzymuje następującą treść:

„Fundusz składa się z następujących Subfunduszy:

- 1) Subfundusz Caspar Akcji Światowych Liderów,
- 2) Subfundusz Caspar Stabilny Globalny,
- 3) Subfundusz Caspar Akcji Globalny,

- 4) Subfundusz Caspar Obligacji Skarbowy,
- 5) Subfundusz Caspar Akcji Polskich."

**- w Rozdziale IV Statutu Funduszu w §1 ust. 2-3 otrzymują następującą treść:**

„2. W ramach Jednostek Uczestnictwa zbywanych przez Fundusz za pośrednictwem Dystrybutorów, Fundusz zbywa Jednostki Uczestnictwa kategorii A i S różniące się rodzajem i wysokością pobieranej opłaty za zarządzanie. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Akcji Globalny i Caspar Akcji Polskich Fundusz nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii A. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Obligacji Skarbowy Fundusz nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii S.

3. W ramach Jednostek Uczestnictwa zbywanych przez Fundusz bezpośrednio, Fundusz zbywa Jednostki Uczestnictwa kategorii A1 i S1 różniące się rodzajem i wysokością pobieranej opłaty za zarządzanie. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Akcji Globalny i Caspar Akcji Polskich Fundusz nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii A1. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Obligacji Skarbowy Fundusz nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii S1.”

**- Rozdział VIII Statutu Funduszu otrzymuje tytuł:**

„SUBFUNDUSZ CASPAR STABILNY GLOBALNY”

**- w Rozdziale VIII Statutu Funduszu §7 otrzymuje następującą treść:**

**„§7 Zasady polityki inwestycyjnej Subfunduszu**

1. Subfundusz jest subfunduszem mieszanym z wyraźnie zarysowaną ekspozycją na zagraniczne rynki finansowe.
2. Co najmniej 70% Aktywów Subfunduszu będzie lokowane w Instrumenty Finansowe dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym poza terytorium Rzeczypospolitej Polskiej oraz na rynkach zorganizowanych niebędących rynkami regulowanymi poza terytorium Rzeczypospolitej Polskiej.
3. Lokaty w Instrumenty Akcyjne oraz Tytuły Uczestnictwa o profilu akcyjnym będą stanowić od 0% do 35% wartości Aktywów Subfunduszu.
4. Lokaty w Instrumenty Dłużne oraz Tytuły Uczestnictwa o profilu dłużnym będą stanowić od 0% do 100% wartości Aktywów Subfunduszu.
5. Za Tytuły Uczestnictwa o profilu akcyjnym oraz dłużnym uważa się Tytuły Uczestnictwa, które zgodnie ze stosowaną polityką inwestycyjną, wynikającą ze statutu, deklarowanego

benchmarku lub innych publikowanych informacji lokują co najmniej 66% swoich aktywów odpowiednio w Instrumenty Akcyjne oraz Instrumenty Dłużne.

6. Fundusz może zawierać na rzecz Subfunduszu umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne."

**- w Rozdziale VIII Statutu Funduszu w §14 ust. 1 otrzymuje następującą treść:**

„1. Miesięczny przyrost wzorca w danym miesiącu kalendarzowym jest równy stopie zwrotu z portfela składającego się z 30% (trzydzieści procent) MSCI World Net Total Return USD Index (NDDUWI) + 70% (siedemdziesiąt procent) Federal Funds Target Rate – Lower Bound (FDTRFTRL).”

**- Rozdział XII Statutu Funduszu otrzymuje tytuł:**

„SUBFUNDUSZ CASPAR AKCJI GLOBALNY”

**- w Rozdziale XII Statutu Funduszu §7 otrzymuje następującą treść:**

**„§7. Szczegółowe zasady dywersyfikacji lokat**

1. Subfundusz jest subfunduszem akcyjnym globalnym, który w ramach prowadzonej polityki inwestycyjnej nie koncentruje lokat w określonym obszarze geograficznym.

2. Co najmniej 70% Aktywów Subfunduszu będzie lokowane w Instrumenty Finansowe dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym poza terytorium Rzeczypospolitej Polskiej oraz na rynkach zorganizowanych niebędących rynkami regulowanymi poza terytorium Rzeczypospolitej Polskiej.

3. Lokaty w Instrumenty Akcyjne oraz Tytuły Uczestnictwa o profilu akcyjnym będą stanowić co najmniej 80% Aktywów Subfunduszu.

4. Za Tytuły Uczestnictwa o profilu akcyjnym uważa się Tytuły Uczestnictwa, które zgodnie ze stosowaną polityką inwestycyjną, wynikającą ze statutu, deklarowanego benchmarku lub innych publikowanych informacji lokują co najmniej 66% swoich aktywów w Instrumenty Akcyjne.

5. Lokaty w Depozyty oraz Instrumenty Dłużne będą stanowić maksymalnie do 20% Aktywów Subfunduszu.

6. Fundusz może zawierać na rzecz Subfunduszu umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne."

**- w Rozdziale XII Statutu Funduszu w §12 ust. 10 otrzymuje następującą treść:**

„10. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Akcji Globalny Fundusz nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii A i A1.”

**- Rozdział XIII Statutu Funduszu otrzymuje tytuł:**

„SUBFUNDUSZ CASPAR OBLIGACJI SKARBOWY”

**- w Rozdziale XIII Statutu Funduszu §7 otrzymuje następującą treść:****„§7. Szczegółowe zasady dywersyfikacji lokat**

1. Subfundusz jest subfunduszem dłużnym rynku krajowego inwestującym przede wszystkim w Instrumenty Dłużne, emitowane, poręczane lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski.
2. Papiery wartościowe wskazane w ust. 1 będą stanowić co najmniej 80% Aktywów Subfunduszu.
3. Subfundusz w swojej polityce inwestycyjnej ogranicza ryzyko stopy procentowej stosując limit maksymalnego poziomu Zmodyfikowanego Duration portfela Subfunduszu.
4. Zmodyfikowane Duration portfela Subfunduszu jest zmienne. Maksymalne Zmodyfikowane Duration Subfunduszu ważone udziałami poszczególnych składników lokat w Wartości Aktywów Netto Subfunduszu nie będzie wyższe niż 3,5.
5. Lokaty w Depozyty będą stanowić maksymalnie do 20% Aktywów Subfunduszu.
6. Subfundusz nie będzie inwestował w Instrumenty Akcyjne lub Tytuły Uczestnictwa.
7. Fundusz nie będzie zawierał na rzecz Subfunduszu umów mających za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne.”

**- w Rozdziale XIII Statutu Funduszu w §12 ust. 3 otrzymuje następującą treść:**

„3. W odniesieniu do Subfunduszu Caspar Obligacji Skarbowy Towarzystwo nie zbywa Jednostek Uczestnictwa kategorii S i S1.”

**- w Rozdziale XIII Statutu Funduszu §14 otrzymuje następującą treść:**

„Subfundusz nie wskazuje wzorca służącego do oceny efektywności Subfunduszu.”

Pozostałe postanowienia Statutu pozostają bez zmian.