Informacje, o których mowa w art. 222 b Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi („Ustawa")

dla PZU Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Akord

Towarzystwo na podstawie art. 222 b Ustawy udostępnia regularnie informacje o:

1) *zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej Funduszu, który może być stosowany w imieniu Funduszu oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI,*
2) *łącznej wysokości stosowanej dźwigni finansowej AFI.*

I.Informacje ujawniane regularnie:

1. Informacja o zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej Funduszu, który może być stosowany w imieniu Funduszu oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI

   Fundusz może korzystać z dźwigni finansowej AFI, jako techniki zarządzania Aktywami Funduszu m. in. zawierając umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, w tym także niewystandaryzowane instrumenty pochodne, oraz umowy mające za przedmiot prawa majątkowe, których cena zależy bezpośrednio lub pośrednio od oznaczonych co do gatunku rzeczy, określonych rodzajów energii, mierników i limitów wielkości produkcji lub emisji zanieczyszczeń, dopuszczone do obrotu na giełdach towarowych. Ponadto Fundusz może stosować w celu zwiększenia ekspozycji transakcje, sell-buy-back, repo a także pożyczki i kredyty.

   Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI przyjęty w dokumentacji wewnętrznej Towarzystwa na koniec okresu sprawozdawczego wynosił 800% przy zastosowaniu metody zaangażowania i jest zgodny z rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie maksymalnego limitu ekspozycji AFI (Dz. U. z 2017 r., poz. 1443). W okresie sprawozdawczym maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI nie uległ zmianie.

   Przy zawieraniu transakcji zwiększających ekspozycję oraz innych gdzie przedmiotem zabezpieczenia są papiery wartościowe (buy-sell-back, reverse repo), umowy zawarte z kontrahentami przewidują standardowe postanowienia w zakresie możliwości ponownego wykorzystania takiego zabezpieczenia.

2. Informacja o łącznej wysokości stosowanej dźwigni finansowej AFI

   Towarzystwo dokonuje codziennego pomiaru ryzyka funduszu poprzez obliczanie ekspozycji AFI metodą zaangażowania, która na koniec II kwartału 2021 r. dla funduszu wyniosła 136% Wartości Aktywów Netto oraz metodą brutto, która na koniec okresu sprawozdawczego wyniosła 197% Wartości Aktywów Netto.