

Informacje okresowe dla klienta alternatywnego funduszu inwestycyjnego

Skarbiec Globalni Liderzy Wzrostu Fundusz Inwestycyjny Zamknięty

Niniejszy dokument („**Informacja okresowa dla Klienta AFI**”) został sporządzony na podstawie art. 222b ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi („**Ustawa**”)

Data i miejsce sporządzenia dokumentu: 14 stycznia 2024 r., Warszawa

Okres objęty dokumentem: 01.01.2024 r - 30.12.2024r

1) Informacje o udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.

Funduszu nie posiada aktywów będących przedmiotem szczególnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.

2) Informacje o zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością.

Zarządzanie płynnością funduszu stanowi ważny element procesu inwestycyjnego w Skarbiec TFI S.A., który warunkuje regularną ocenę płynności poszczególnych składników lokat, rozumianej jako możliwości ich upłynnienia bez istotnego negatywnego wpływu na ich wartość. Nadrzędnym celem procesu zarządzania płynnością jest zapewnienie terminowej obsługi umorzeń jednostek uczestnictwa na żądanie Uczestników funduszu a także terminowe regulowanie zobowiązań funduszu wynikających z zawartych transakcji oraz kosztów związanych z prowadzoną działalnością.

W ramach procesu zarządzania ryzykiem płynności Towarzystwo dokonuje regularnych pomiarów bieżącej płynności aktywów w warunkach normalnych oraz niekorzystnych a także testuje zdolność funduszu do pokrycia prognozowanych zobowiązań. Towarzystwo wdrożyło oraz regularnie monitoruje wewnętrzne limity płynności.

W raportowanym okresie nie wystąpiły istotne zmiany w regulacjach wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością.

3) Informacje o aktualnym profilu ryzyka Funduszu oraz systemach zarządzaniach ryzykiem stosowanych przez Towarzystwo.

Opis ryzyk inwestycyjnych związanych z przyjętą polityką inwestycyjną Funduszu, z uwzględnieniem strategii zarządzania i szczegółowych strategii inwestycyjnych stosowanych w odniesieniu do inwestycji na określonym obszarze geograficznym, w określonej branży lub sektorze gospodarczym albo w odniesieniu do określonej kategorii lokat wskazane zostały w Rozdziale III Prospektu Informacyjnego Funduszu.

Aktualne prospekty informacyjne znajdują się na stronie www.skarbiec.pl

Towarzystwo jako istotne czynniki ryzyka dla Funduszu wskazuje:

- 1) Ryzyko kursów akcji
- 2) Ryzyko koncentracji
- 3) Ryzyko walutowe

System zarządzania ryzykiem w Towarzystwie tworzy Departament Zarządzania Ryzykiem jako odrębna i niezależna komórka organizacyjna, w szczególności pod względem podległości służbowej i pełnionych funkcji, od jednostek operacyjnych Towarzystwa odpowiedzialnych za podejmowanie decyzji inwestycyjnych. Na potrzeby procesu zarządzania ryzykiem, Towarzystwo wdrożyło odpowiednie metody pomiaru i monitorowania ryzyka inwestycyjnego wraz z wyznaczaniem ekspozycji AFI oraz implementacją systemu limitów wewnętrznych. Dodatkowo w Towarzystwie funkcjonuje zdefiniowany proces komunikowania stopnia wykorzystania limitów inwestycyjnych, wraz z raportowaniem przekroczeń lub prawdopodobnych przekroczeń uzgodnionych poziomów ryzyka. Każdorazowo gdy wewnętrzny limit ryzyka zostaje przekroczony - adekwatność działań naprawczych, jak również czas ich podjęcia powinny być zbieżne z interesem uczestników Funduszu.

4) Informacje zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej Funduszu, który może być stosowany w ich imieniu, oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej Funduszu.

Przyjęty w Towarzystwie maksymalny dozwolony wewnętrzny poziom ekspozycji AFI wynosi 115 % wartości aktywów netto Funduszu kalkulowanej zgodnie z metodą zaangażowania, tj. metodą wskazaną w Rozporządzeniu Delegowanym Komisji (UE) nr 231/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniającym dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru.

5) Łączna wysokości zastosowanej dźwigni finansowej Funduszu.

Metoda kalkulacji Całkowitej Ekspozycji	Stana na dzień 30.12.2024	Min w okresie?	Średnia	Max w okresie?	Możliwe źródła dźwigni finansowej
Metoda Brutto	206,92	129,91	206,63	258,13	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	100,29	96,55	100,04	106,56	

System zarządzania ryzykiem w Towarzystwie zapewnia, aby w żadnym momencie wartość ekspozycji AFI w odniesieniu do Funduszu nie przekroczyła ustalonego dopuszczalnego limitu. W okresie 12 miesięcy zakończonym 31 grudnia 2024 roku, nie nastąpiło przekroczenie limitów ekspozycji AFI Funduszu wskazanych w rozporządzeniu Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017r. w sprawie maksymalnego limitu ekspozycji AFI.