

Poznań, dnia 23 lutego 2021 roku

Santander Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych Spółka Akcyjna z siedzibą w Poznaniu, pl. Władysława Andersa 5, 61-894 Poznań, wpisane do rejestru przedsiębiorców prowadzonego przez Sąd Rejonowy Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, VIII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000001132, posiadające NIP 778-13-14-701, o kapitale zakładowym w wysokości 13.500.000,00 zł, w całości opłaconym, niniejszym ogłasza o zmianie statutu funduszu Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty („Fundusz”).

Towarzystwo dokonuje zmiany statutu Funduszu w ten sposób, że postanawia:

1) w jego artykule 2 po dotychczasowym pkt (40) dodać nowy pkt (41) w następującym brzmieniu:

„(Art. 2)

- (41) Rozporządzenie o Instrumentach Pochodnych - Rozporządzenie Ministra Finansów z dnia 30 kwietnia 2013 roku w sprawie zawierania przez fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne (Dz. U. z 2018 r., poz 1879 t.j.),”

2) w jego artykułach 58, 71, 83, 96, 109, 122, 135 i 148 uchylić dotychczasowe brzmienie ust. 1. i nadać mu następujące nowe brzmienie:

„(Art. Art. 58, 71, 83, 96, 109, 122, 135 i 148)

1. Z zastrzeżeniem ust. 2, Subfundusz może zawierać umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim, a także na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub Państwie Członkowskim, oraz umowy mające za przedmiot niewystandaryzowane instrumenty pochodne.”

3) w jego artykułach 58 i 96 ust. 3. po dotychczasowym pkt (2) kropkę zastąpić średnikiem i dodać nowe pkt (3), (4) i (5) w następującym brzmieniu:

„(Art. Art. 58 i 96)

(ust. 3.)

- (3) kontrakty terminowe, dla których bazę stanowią dłużne papiery wartościowe, instrumenty rynku pieniężnego, stopy procentowe,
(4) transakcje swap na stopę procentową,
(5) transakcje swap walutowy.”

4) w jego artykułach 58 i 96 uchylić dotychczasowe brzmienie ust. ust 4. i 5. i nadać im następujące nowe brzmienie:

„(Art. Art. 58 i 96)

4. Kryteriami wyboru instrumentów pochodnych, o których mowa w ust. 3 pkt (1), będą dopasowanie instrumentów do planowanych lub zrealizowanych transakcji zakupu lub sprzedaży papierów wartościowych lub instrumentów rynku pieniężnego, których cena jest wyrażona w odpowiednich walutach obcych oraz wartość ryzyka kontrahenta. Kryteriami wyboru instrumentów pochodnych, o których mowa w ust. 3 pkt (2) - (5), będą płynność tych instrumentów, koszty transakcji oraz – w przypadku instrumentów niewystandaryzowanych - wartość ryzyka kontrahenta.

5. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (1), pod warunkiem, że Subfundusz będzie miał Aktywa lub zobowiązania wyrażone w walutach obcych albo będzie istniało wysokie prawdopodobieństwo zawarcia transakcji, wskutek których powstanie zobowiązanie lub należność wyrażona w walucie obcej. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (2), pod warunkiem, że szacowany koszt wykonania, w danym terminie, planowanych zmian alokacji pomiędzy akcje a instrumenty dłużne, z użyciem instrumentów pochodnych, jest niższy niż w przypadku bezpośrednich transakcji na rynku akcji. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (3) – (5), gdy oczekiwany kierunek zmian stóp procentowych lub kursów walut stwarza możliwość osiągnięcia wyższej stopy zwrotu z części dłużnej portfela Subfunduszu. Transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3, będą zawierane z podmiotami spełniającymi kryteria wskazane w § 4 ust. 1 pkt 1) Rozporządzenia o Instrumentach Pochodnych będącymi bankami krajowymi, bankami zagranicznymi lub instytucjami kredytowymi w rozumieniu Ustawy oraz posiadającymi w dniu zawarcia transakcji:

- (1) rating długoterminowy w walucie obcej na poziomie inwestycyjnym, nadany przez co najmniej jedną z następujących agencji ratingowych: Moody's, Standard&Poor's lub Fitch lub
(2) kapitały własne w wysokości co najmniej 500.000.000,00 zł (pięciuset milionów złotych) albo jej równowartości w walucie obcej,
lub ich oddziałami.”

5) w jego artykułach 71, 83 i 135 ust. 5., na jego końcu, dodać słowa:

„(Art. Art. 71, 83 i 135)

Transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3, będą zawierane z podmiotami spełniającymi kryteria wskazane w § 4 ust. 1 pkt 1) Rozporządzenia o Instrumentach Pochodnych będącymi bankami krajowymi, bankami zagranicznymi lub instytucjami kredytowymi w rozumieniu Ustawy oraz posiadającymi w dniu zawarcia transakcji:

- (1) rating długoterminowy w walucie obcej na poziomie inwestycyjnym, nadany przez co najmniej jedną z następujących agencji ratingowych: Moody's, Standard&Poor's lub Fitch lub
- (2) kapitały własne w wysokości co najmniej 500.000.000,00 zł (pięciuset milionów złotych) albo jej równowartości w walucie obcej,
lub ich oddziałami."

**6) w jego artykułach 109 i 122 uchylić dotychczasowe brzmienie ust. 5. i nadać mu następujące nowe brzmienie:
„(Art. Art. 109 i 122)**

5. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3, pod warunkiem, że Subfundusz będzie miał Aktywa lub zobowiązania wyrażone w walutach obcych albo będzie istniało wysokie prawdopodobieństwo zawarcia transakcji, wskutek których powstanie zobowiązanie lub należność wyrażona w walucie obcej. Transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3, będą zawierane z podmiotami spełniającymi kryteria wskazane w § 4 ust. 1 pkt 1) Rozporządzenia o Instrumentach Pochodnych będącymi bankami krajowymi, bankami zagranicznymi lub instytucjami kredytowymi w rozumieniu Ustawy oraz posiadającymi w dniu zawarcia transakcji:

- (1) rating długoterminowy w walucie obcej na poziomie inwestycyjnym, nadany przez co najmniej jedną z następujących agencji ratingowych: Moody's, Standard&Poor's lub Fitch lub
- (2) kapitały własne w wysokości co najmniej 500.000.000,00 zł (pięciuset milionów złotych) albo jej równowartości w walucie obcej,
lub ich oddziałami."

**7) w jego artykule 148 uchylić dotychczasowe brzmienie ust. 3. i nadać mu następujące nowe brzmienie:
„(Art. 148)**

3. Subfundusz może zawierać umowy mające za przedmiot wystandaryzowane lub niewystandaryzowane:

- (1) terminowe transakcje zakupu / sprzedaży walut,
- (2) kontrakty terminowe, warranty i opcje, dla których bazę stanowią akcje oraz indeksy giełdowe,
- (3) transakcje swap na stopę procentową,
- (4) transakcje swap walutowy."

8) w jego artykule 148 ust. 4. słowa: „ust. 3 pkt (2) – (5)”, zastąpić słowami: „ust. 3 pkt (2) – (4)”,

**9) w jego artykule 148 uchylić dotychczasowe brzmienie ust. 5. i nadać mu następujące nowe brzmienie:
„(Art. 148)**

5. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (1) pod warunkiem, że Subfundusz będzie posiadał aktywa lub zobowiązania wyrażone w walutach obcych albo będzie istniało wysokie prawdopodobieństwo zawarcia transakcji, wskutek których powstanie zobowiązanie lub należność wyrażona w walucie obcej. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (2) pod warunkiem, że szacowany koszt wykonania, w danym terminie, planowanych zmian alokacji pomiędzy akcje a instrumenty dłużne oraz zmian wielkości pozycji w akcjach poszczególnych spółek, z użyciem instrumentów pochodnych, jest niższy niż w przypadku bezpośrednich transakcji na rynku akcji lub transakcje na rynku akcji są niemożliwe bądź utrudnione. Subfundusz będzie zawierał umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3 pkt (3) i (4), gdy oczekiwany kierunek zmian stóp procentowych lub kursów walut stwarza możliwość osiągnięcia wyższej stopy zwrotu z części dłużnej portfela Subfunduszu. Transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, o których mowa w ust. 3, będą zawierane z podmiotami spełniającymi kryteria wskazane w § 4 ust. 1 pkt 1) Rozporządzenia o Instrumentach Pochodnych będącymi bankami krajowymi, bankami zagranicznymi lub instytucjami kredytowymi w rozumieniu Ustawy oraz posiadającymi w dniu zawarcia transakcji:

- (1) rating długoterminowy w walucie obcej na poziomie inwestycyjnym, nadany przez co najmniej jedną z następujących agencji ratingowych: Moody's, Standard&Poor's lub Fitch lub
- (2) kapitały własne w wysokości co najmniej 500.000.000,00 zł (pięciuset milionów złotych) albo jej równowartości w walucie obcej,
lub ich oddziałami."

Pozostałe zapisy statutu Funduszu pozostają bez zmian.

Zmiany statutu zgodnie z art. 24 ust. 1 ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz.U. z 2020, poz. 95 t.j.) nie wymagały zgody Komisji Nadzoru Finansowego.

Powyższe zmiany statutu, zgodnie z regulacją art. 24 ust. 8 pkt 1) ustawy z dnia 27 maja 2004 roku o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz.U. z 2020, poz. 95 t.j.) **wchodzą w życie w terminie 3 miesięcy od ogłoszenia, tj. z dniem 24 maja 2021 roku.**