

Warszawa, 15 października 2021 r.

**WYKAZ ZMIAN W PROSPEKCIE INFORMACYJNYM BALTIC SPECJALISTYCZNEGO  
FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO OTWARTEGO Z DNIA 12 MAJA 2020 ROKU  
ZMIENIONEGO W DN. 15 PAŹDZIERNIKA 2021 ROKU**

Baltic Capital TFI S.A. niniejszym informuje o zmianie Prospektu informacyjnego Baltic Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego („Prospekt”) poprzez:

- 1) Zmianę nazw subfunduszy w odniesieniu do całości Prospektu: dotychczasowy subfundusz Baltic Konserwatywny otrzymał nazwę Baltic Makro Obligacji, dotychczasowy subfundusz Baltic Zrównoważony otrzymał nazwę Baltic Makro Alokacji Plus i dotychczasowy subfundusz Baltic Stabilnego Dochodu otrzymał nazwę Baltic Stabilnego Dochodu w likwidacji;
- 2) Zmiany zasad dywersyfikacji lokat subfunduszy – zmiana w Rozdziale III.1 p 1.1., Rozdziale III.2 p 1.1., Rozdziale III.3 p 1.1., Rozdziale III.4 p 1.1., Rozdziale III.5 p 1.1., Rozdziale III.6 p 1.1.,
- 3) Zmianę informacji dotyczącej zmienności portfela wynikającej ze składu portfela i z przyjętej techniki zarządzania portfelem subfunduszu Baltic Makro Obligacji – Rozdział III.1 p. 1.4.,
- 4) Zmianę w zakresie opisu ryzyka rynkowego – zmiana w Rozdziale III.1 p. 2.1.1., Rozdziale III.2 p. 2.1.1., Rozdziale III.3 p. 2.1.1., Rozdziale III.4 p. 2.1.1., Rozdziale III.5 p. 2.1.1., Rozdziale III.6 p. 2.1.1.,
- 5) Zmianę w zakresie opisu ryzyka walutowego - zmiana w Rozdziale III.1 p. 2.1.1.,
- 6) Zmianę w zakresie opisu ryzyka związanego z koncentracją Aktywów lub rynków subfunduszu Baltic Makro Obligacji – 2.1.5.
- 7) Aktualizację profilu inwestora subfunduszu – Rozdział III p. 3, Rozdziale III.6. p. 3.,
- 8) Zmianę opisu ryzyka operacyjnego – Rozdział III.1 p 2.1.7., Rozdział III.2 p 2.1.7, Rozdział III.3 p 2.1.7., Rozdział III.4 p 2.1.7, Rozdział III.5 p 2.1.7, Rozdział III.6 p 2.1.7,
- 9) Zmianę w zakresie profilu inwestora dotycząca rekomendowanego okresu inwestowania w jednostki uczestnictwa subfunduszu – zmiana w Rozdziale III.1. p. 3, Rozdziale III.2. p. 3., Rozdziale III.3. p. 3., Rozdziale III.4. p. 3., Rozdziale III.5. p. 3., Rozdziale III.6. p. 3.,
- 10) Zmianę imienia i nazwiska Członka Zarządu Towarzystwa; zmiana dokonana w Rozdziale I p. 1 i p. 3 oraz w Rozdziale II p. 7,
- 11) Dodanie osoby fizycznej zarządzającej Funduszem Pana Krzysztofa Podwórnego oraz wykreślenie osoby fizycznej zarządzającej Funduszem Pana Bartosza Pawlaka; zmiana dokonana w Rozdziale II p. 7,
- 12) Zmianę nazwy funduszu z „Baltic Global Systematic Fundusz Inwestycyjny Zamknięty” na „Baltic Global Systematic Fundusz Inwestycyjny Zamknięty w likwidacji”, zmiana dokonana w Rozdziale II p. 11,
- 13) Dodanie zdania „Fundusz posiada sporządzone na piśmie plany określające działania, które Fundusz podejmie na wypadek istotnych zmian lub zaprzestania opracowywania danego wskaźnika referencyjnego.”; zmiana dokonana w Rozdziale III.3 p. 4.4, w Rozdziale III.4 p. 4.4 oraz w Rozdziale III.6 p. 4.4,
- 14) Aktualizację danych podmiotów, pośredniczących w zbywaniu i odkupywaniu przez Fundusz Jednostek Uczestnictwa –zmiana dokonana w Rozdziale V p. 2
- 15) Aktualizację danych podmiotów, którym powierzono czynności wyceny aktywów Funduszu –Zmianę dokonaną w Rozdziale V p. 10,

**BALTIC CAPITAL TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.**

z siedzibą w Warszawie, pod adresem ul. Bagno 2/244, 00-112 Warszawa, wpisana do rejestru przedsiębiorców Krajowego Rejestru Sądowego prowadzonego przez Sąd Rejonowy dla m. st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000593350, posiadająca numer REGON 363314289 oraz NIP 5252640776 z kapitałem zakładowym w wysokości 1 600 000,00 zł opłaconym w całości

16) Istotną zmianę całego pp. 1.5 w Rozdziale VI; poniżej przedstawiona jest pełna treść pp.1.5:

*„Mając na uwadze stosowanie przez Fundusz wskaźników referencyjnych dla obliczania opłaty zmiennej, będącej częścią wynagrodzenia za zarządzanie danym Subfunduszem, której wysokość jest uzależniona od wyników danego Subfunduszu wskazuje się, że spółka opracowująca stosowane przez Fundusz wskaźniki referencyjne (indeks WIG, zwany dalej „Wskaźnikiem”), tj. GPW Benchmark S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Książęca 4, 00-498 Warszawa, zarejestrowana w Sądzie Rejonowym dla m.st. Warszawy w Warszawie, pod numerem KRS 0000493097, o kapitale zakładowym w wysokości 4 900 000 zł, w całości opłaconym, posiadająca NIP: 525 25 46 511 (dalej: „GPW Benchmark SA”), jest administratorem wskaźników referencyjnych w rozumieniu Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2016/1011 z dnia 8 czerwca 2016 r. w sprawie indeksów stosowanych jako wskaźniki referencyjne w instrumentach finansowych i umowach finansowych lub do pomiaru wyników funduszy inwestycyjnych i zmieniającego dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014 (dalej: „Rozporządzenia BMR”).*

*W przypadku (i) zaprzestania opracowywania przez GPW Benchmark SA Wskaźnika, (ii) zaistnienia istotnej zmiany w sposobie opracowywania Wskaźnika, sposób obliczania opłaty zmiennej, będącej częścią wynagrodzenia za zarządzanie danym Subfunduszem zmodyfikowany zostanie w taki sposób, aby możliwie najpełniej i najwierniej ująć stosowane dotychczas Wskaźniki. W tym celu w pierwszej kolejności Towarzystwo ustali, czy opracowywanie Wskaźników zostanie powierzone innemu podmiotowi, któremu przysługiwać będzie status administratora na gruncie Rozporządzenia BMR. Jeśli opracowywanie Wskaźników nie zostanie powierzone innemu administratorowi, Towarzystwo – w celu ustalenia wskaźników referencyjnych, którymi można zastąpić Wskaźniki, podejmie następujące działania:*

*1) dokona przeglądu:*

- a) wskaźników opracowywanych przez Narodowy Bank Polski,*
- b) wskaźników referencyjnych typu dochodowego, opracowywanych przez krajowych administratorów w rozumieniu Rozporządzenia BMR, odnoszących się do cen zawartych w tych wskaźnikach akcji oraz dochodów z dywidend i praw poboru,*
- c) wskaźników referencyjnych typu dochodowego, opracowywanych przez światowych producentów, jak Standard & Poor's, odnoszących się do cen zawartych w tych wskaźnikach akcji oraz dochodów z dywidend i praw poboru,*

*2) Następnie Towarzystwo dokona oceny każdego wskaźnika, spośród wskaźników zidentyfikowanych w ramach przeglądu, o którym mowa powyżej, w oparciu o następujące dwie grupy kryteriów, przypisując im w każdej grupie a) i b) punkty od 1 do liczby punktów odpowiadającej liczbie zidentyfikowanych Wskaźników referencyjnych:*

- a) Towarzystwo porównuje wartości każdego wskaźnika referencyjnego z odnośnym, zastępowanym Wskaźnikiem w całym okresie, w którym wskaźniki te były równolegle publikowane, pod kątem wyboru wskaźnika referencyjnego najbardziej zbliżonego wartości do odnośnego, zastępowanego Wskaźnika,*
- b) Towarzystwo porównuje podobieństwo rodzaju i zakresu danych wejściowych każdego wskaźnika referencyjnego z danymi wejściowymi odnośnego, zastępowanego Wskaźnika w celu wyboru wskaźnika referencyjnego najbardziej zbliżonego w tym zakresie do odnośnego, zastępowanego Wskaźnika.*

*3) Następnie Towarzystwo przypisuje:*

- a) ocenie, o której mowa w pkt. 2 lit. a) powyżej wagę 85%,*

**BALTIC CAPITAL TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.**

*b) ocenie, o której mowa w pkt. 2 lit. b) powyżej wagę 15%,  
– nowy wskaźnik referencyjny lub też, jeżeli w ocenie Towarzystwa jest to zasadne,  
nowe wskaźniki referencyjne, które w ramach opisanej powyżej procedury zostały  
najwyżej ocenione i mogą zastępować odnośny Wskaźnik, zostaną zamieszczone na  
liście alternatywnych wskaźników, utworzonej po dokonaniu pierwszego  
okresowego przeglądu Wskaźników i uwzględnione w Prospekcie.  
Towarzystwo, w celu zapewnienia aktualności listy alternatywnych wskaźników  
referencyjnych, którymi można zastąpić Wskaźniki, dokonuje okresowych  
przeглядów listy w oparciu o procedurę opisaną powyżej.”.*

- 17) Zmianę załącznika do Prospektu - tekstu jednolitego statutu Baltic SFIO celem dostosowania go do obowiązującego brzmienia,
- 18) Aktualizację spisu treści – Rozdział VIII.
- 19) Wprowadzenie drobnych zmiany redakcyjne.

**BALTIC CAPITAL TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.**

z siedzibą w Warszawie, pod adresem ul. Bagno 2/244, 00-112 Warszawa, wpisana do rejestru przedsiębiorców Krajowego Rejestru Sądowego prowadzonego przez Sąd Rejonowy dla m. st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000593350, posiadająca numer REGON 363314289 oraz NIP 5252640776 z kapitałem zakładowym w wysokości 1 600 000,00 zł opłaconym w całości