

**Informacja
o zmianach danych objętych prospektem informacyjnym
dokonanych w dniu 4 września 2019 roku**

Działając na podstawie Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 22 maja 2013 r. w sprawie prospektu informacyjnego funduszu inwestycyjnego otwartego i specjalistycznego funduszu inwestycyjnego otwartego oraz wyliczania wskaźnika zysku do ryzyka tych funduszy (Dz. U. 2013, poz. 673 ze zm.) Pekao Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. informuje o dokonaniu w dniu 4 września 2019 roku następujących zmian w treści prospektu informacyjnego **Pekao Walutowy Funduszu Inwestycyjnego Otwartego** („Fundusz”):

- 1) **Na stronie tytułowej** w informacji o dacie sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Prospektu datę: „31 sierpnia 2019 r.” zastępuje się datą: „4 września 2019 r.”
- 2) **W Rozdziale III Część B pkt 5.5.3.** dotyczący Subfunduszu **Pekao Akcji Amerykańskich** otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„5.5.3. Wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany dalej “benchmarkiem”

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 4 września 2019 r.:

95% MSCI USA All Cap Index + 5% ICE BofAML US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Index

gdzie:

MSCI USA All Cap Index (Net Return) [M1USAC] – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. (MSCI) indeks odzwierciedlający szeroki rynek akcji amerykańskich. Indeks składa się z 3400+ spółek o dużej, średniej, małej i mikro kapitalizacji reprezentujących około 99% rynku akcji w Stanach Zjednoczonych Ameryki.

ICE BofAML US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Constant Maturity Index [L0US] – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego stopę LIBID overnight w USD.

Wskaźnik referencyjny „MSCI USA All Cap Index (Net Return)” jest opracowywany przez administratora “MSCI Ltd”, wpisanego do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 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 zmieniające dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Wskaźnik referencyjny „ICE BofAML US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Constant Maturity Index” jest opracowywany przez administratora “ICE Benchmark Administration Limited”, wpisanego do ww. rejestru.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. do 3 września 2019 r.:

50% MSCI USA TR Gross Index + 15% MSCI US Mid Cap Value + 15% MSCI US Prime Market Value Index + 15% MSCI US Prime Market Growth Index + 5% ICE BofAML US Dollar 3-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index

gdzie:

MSCI USA TR Gross Index – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych i średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki z uwzględnieniem dywidend.

MSCI US Mid Cap Value – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US MidCap 450 Index charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i niską wartością oczekiwanego wzrostu.

MSCI US Prime Market Value Index – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks obrazujący stopę zwrotu spółek o dużej i średniej kapitalizacji rynkowej w Stanach

Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US Prime Market 750 Index charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i niską wartością oczekiwanego wzrostu.

MSCI US Prime Market Growth Index – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks obrazujący stopę zwrotu spółek o dużej i średniej kapitalizacji rynkowej w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US Prime Market 750 Index charakteryzujące się wysokim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i wysoką wartością oczekiwanego wzrostu.

ICE BofAML US Dollar 3-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego trzymiesięczną stopę LIBID w USD.

Wskaźniki referencyjne „MSCI USA TR Gross Index”, „MSCI US Mid Cap Value”, „MSCI US Prime Market Value Index” i „MSCI US Prime Market Growth Index” są opracowywane przez administratora „MSCI Ltd”, wpisanego do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 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 zmieniające dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Wskaźnik referencyjny „ICE BofAML US Dollar 3-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index” jest opracowywany przez administratora „ICE Benchmark Administration Limited”, wpisanego do ww. rejestru.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 2 listopada 2010 r. do 31 grudnia 2018 r.:

50% MSCI USA Total Return + 15% MSCI US Mid Cap Value + 15% MSCI US Prime Market Value Index + 15% MSCI US Prime Market Growth Index + 5% FTSE USD 3-Month Eurodeposit

gdzie:

MSCI USA Total Return - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych, średnich oraz małych spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki.

MSCI US Mid Cap Value - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US MidCap 450 Index charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i niską wartością oczekiwanego wzrostu.

MSCI US Prime Market Value Index - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks obrazujący stopę zwrotu spółek o dużej i średniej kapitalizacji rynkowej w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US Prime Market 750 Index charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i niską wartością oczekiwanego wzrostu.

MSCI US Prime Market Growth Index - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks obrazujący stopę zwrotu spółek o dużej i średniej kapitalizacji rynkowej w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu MSCI US Prime Market 750 Index charakteryzujące się wysokim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i wysoką wartością oczekiwanego wzrostu.

FTSE USD 3-Month Eurodeposit - indeks wyliczany w oparciu o średnie oprocentowanie trzymiesięcznych depozytów USD na rynku europejskim; indeks publikowany codziennie przez FTSE Fixed Income LCC.

Wskaźniki referencyjne „MSCI USA Total Return”, „MSCI US Mid Cap Value”, „MSCI US Prime Market Value Index” i „MSCI US Prime Market Growth Index” są opracowywane przez administratora „MSCI Limited”, wpisanego do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 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 zmieniające dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Pozostałe stosowane wskaźniki referencyjne są opracowywane przez administratorów, którzy nie zostali wpisani do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 ww. Rozporządzenia.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) od 6 stycznia 2010 r. do 1 listopada 2010 r.:

50% S&P 500 + 15% Russell Mid Cap Value + 15% Russell 1000 Value + 15% Russell 1000 Growth (TR) + 5% JPM Cash Index 3Month USD

gdzie:

S&P500 Index – indeks (Standard and Poor's 500 Index) w skład którego wchodzi akcje 500 spółek o największej kapitalizacji, notowanych na giełdach New York Stock Exchange oraz NASDAQ, dobranych ze względu na swoją płynność, kapitalizację rynkową i reprezentację odpowiednich sektorów gospodarki.

Indeks ten jest obliczany w oparciu o ceny spółek wyrażone w USD.

Russell Mid Cap Value – liczony w USD indeks ustalany przez Frank Russell Company z siedzibą w Tacoma obrazujący stopę zwrotu spółek uznawanych przez Frank Russell Company za spółki o średniej kapitalizacji rynkowej i charakteryzujących się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV).

Russell 1000 Value Index - liczony w USD indeks ustalany przez Frank Russell Company z siedzibą w Tacoma obrazujący stopę zwrotu spółek uznawanych przez Frank Russell Company za spółki o dużej kapitalizacji rynkowej. W skład tego indeksu wchodzi spółki z indeksu Russell 1000 charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i niską wartością oczekiwanego wzrostu.

Russell 1000 Growth Index - liczony w USD indeks ustalany przez Frank Russell Company z siedzibą w Tacoma obrazujący stopę zwrotu spółek uznawanych przez Frank Russell Company za spółki o średniej kapitalizacji rynkowej i charakteryzujących się wysokim wskaźnikiem ceny do wartości księgowej (P/BV) i wysoką wartością oczekiwanego wzrostu.

JPM Cash 3 month USD - liczony jest w oparciu o średnie stopy procentowych trzy miesięcznych depozytów w Euro na rynkach globalnych. Indeks JPM 3 month USD, liczony jest codziennie.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) od 27 maja 2009 r. do 5 stycznia 2010 r.:

S&P500 Total Return Index

gdzie:

S&P500 Total Return Index – indeks (Standard and Poor's 500 Total Return Index) w skład którego wchodzi 500 spółek o największej kapitalizacji, notowanych na giełdach New York Stock Exchange oraz NASDAQ, dobranych ze względu na swoją płynność, kapitalizację rynkową i reprezentację odpowiednich sektorów gospodarki. Indeks ten jest obliczany w oparciu o ceny spółek wyrażone w USD.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) od 2 kwietnia 2004 r. do 26 maja 2009 r.:

100% S&P 500 Total Return

z uwzględnieniem zmian kursów złotych do dolara

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) do 1 kwietnia 2004 r.:

S&P500

Wzorzec (benchmark) dotyczy wszystkich kategorii Jednostek Uczestnictwa Subfunduszu.

Źródło: MSCI.

Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone.

Źródło: Intercontinental Exchange („ICE”), wykorzystane za zgodą. ICE zezwala na wykorzystanie indeksów ICE i związanych z nimi danych "w stanie w jakim są", nie udziela jakichkolwiek gwarancji w odniesieniu do tych danych, nie gwarantuje odpowiedniości, jakości, dokładności, aktualności, i/lub kompletności indeksów ICE lub wszelkich zawartych, związanych lub uzyskanych z nich danych, nie ponosi odpowiedzialności w związku z użytkowaniem wyżej wymienionych danych oraz nie sponsoruje, nie popiera ani nie rekomenduje Pekao TFI S.A., w tym żadnych jego produktów lub usług.

Fundusz posiada rzetelne, sporządzone na piśmie, plany określające działania, które Fundusz podjąłby na wypadek istotnych zmian lub zaprzestania opracowywania danego wskaźnika referencyjnego.”

Warszawa, 4 września 2019 r.