

**Informacja
o zmianach danych objętych prospektem informacyjnym
dokonanych w dniu 28 lutego 2020 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 28 lutego 2020 roku następujących zmian w treści prospektu informacyjnego **Pekao Funduszy Globalnych Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego** („Fundusz”):

- 1) **Na stronie tytułowej prospektu informacyjnego Funduszu** w informacji o dacie sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Prospektu datę: „10 stycznia 2020 r.” zastępuje się datą: „28 lutego 2020 r.”
- 2) **W Rozdziale III Część B w pkt 1.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Dochodu i Wzrostu Rynku Chińskiego** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r.:

45% MSCI China 10/40 Index + 45% ICE BofAML US Corporate & Government Index + 5% ICE BofAML Emerging Markets External Debt Sovereign Index + 5% WIBID O/N

gdzie:

MSCI China 10/40 Index – liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks, w skład którego wchodzi chińskie spółki z ograniczeniem, że podmioty wchodzące w skład pojedynczej grupy kapitałowej („single group entity”) nie przekraczają 10% udziału w indeksie, a suma udziałów dla poszczególnych grup kapitałowych reprezentujących więcej niż 5% udziału w indeksie, nie przekracza 40% udziału w indeksie.

ICE BofAML US Corporate & Government Index – Indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w USD dla obligacji o ratingu co najmniej inwestycyjnym publicznie emitowanych między innymi przez Departament Skarbu USA, amerykańskie agencje rządowe, a także obligacje innych krajów, ponadnarodowe (tzw. supranational) oraz przedsiębiorstw.

ICE BofAML Emerging Markets External Debt Sovereign Index – Indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w USD i EUR dla obligacji publicznie emitowanych przez kraje spoza grupy G10 tj.: USA, kraje tzw. Eurolandu, Wielka Brytania, Japonia, Australia, Nowa Zelandia, Kanada, Szwajcaria, Norwegia i Szwecja.

WIBID O/N – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczają odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednodniowy (overnight).

Wskaźnik referencyjny "MSCI China 10/40 Index" jest opracowywany 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.

Wskaźniki referencyjne „ICE BofAML US Corporate & Government Index” oraz „ICE BofAML Emerging Markets External Debt Sovereign Index” są opracowywane przez administratora "ICE Data Indices LLC", 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 „WIBID O/N” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

3) **W Rozdziale III Część B w pkt 1.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Dochodu i Wzrostu Rynku Chińskiego** zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

4) **W Rozdziale III Część B w pkt 3.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Dochodu i Wzrostu Regionu Pacyfiku** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r.:

25% MSCI AC Asia ex. Japan Index + 35% MSCI Japan Index + 35% ICE BofAML US Corporate & Government Index + 5% WIBID O/N

gdzie:

MSCI AC Asia ex. Japan Index (MSCI All Country Asia excluding Japan) – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks uwzględniający ceny akcji dużych i średnich spółek notowanych na giełdach na następujących rynkach azjatyckich: Hong Kong i Singapur (rynkı rozwinęte) oraz Chiny, Indie, Indonezja, Korea Południowa, Malezja, Filipiny, Tajwan i Tajlandia (rynkı wschodzące).

MSCI Japan Index – liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynku w Japonii.

ICE BofAML US Corporate & Government Index – Indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w USD dla obligacji o ratingu co najmniej inwestycyjnym publicznie emitowanych między innymi przez Departament Skarbu USA, amerykańskie agencje rządowe, a także obligacje innych krajów, ponadnarodowe (tzw. supranational) oraz przedsiębiorstw.

WIBID O/N – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednodniowy (overnight).

Wskaźniki referencyjne „MSCI AC Asia ex. Japan Index” oraz „MSCI Japan 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 Corporate & Government Index” jest opracowywany przez administratora „ICE Data Indices LLC”, 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 „WIBID O/N” jest opracowywany przez administratora „GPW Benchmark S.A.”, 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

5) **W Rozdziale III Część B w pkt 3.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Dochodu i Wzrostu Regionu Pacyfiku** zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

6) **W Rozdziale III Część B w pkt 4.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Rynków Dalekiego Wschodu** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 29 czerwca 2010 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 29 czerwca 2010 r.:

35% MSCI China 10/40 Index + 25% MSCI Japan Index + 35% MSCI AC Asia ex. Japan Index + 5% WIBID

gdzie:

MSCI China 10/40 Index - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks, w skład którego wchodzi chińskie spółki z ograniczeniem, że pojedynczy „group entity” nie przekracza 9% udziału w indeksie a suma udziałów dla pojedynczych „group entity” reprezentujących więcej niż 4,5 % udziału w indeksie nie przekracza 36% udziału w indeksie;

* „group entity” - podmiot wchodzący w skład tej samej grupy kapitałowej w rozumieniu przepisów UCITS III.

MSCI Japan Index – liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji na rynkach w Japonii;

MSCI AC Asia ex. Japan Index (Morgan Stanley Capital International All Country Asia ex-Japan) - liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks uwzględniający ceny akcji notowanych na giełdach w następujących krajach: Chiny oraz Hong Kong, Indie, Tajwan, Singapur, Korea Południowa, Indonezja, Malezja, Filipiny, Tajlandia i jednocześnie pomijający papiery wartościowe niedostępne dla inwestorów zagranicznych na tych giełdach;

WIBID – Warsaw Interbank Bid Rate – stopa procentowa, jaką banki zapłacą za środki przyjęte w depozyt w PLN od innych banków dla depozytów jednodniowych.

Wskaźniki referencyjne „MSCI China 10/40 Index”, „MSCI Japan Index” i „MSCI AC Asia ex. Japan 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 dyrektywę 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Wskaźnik referencyjny „WIBID” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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 dyrektywę 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 7) **W Rozdziale III Część B w pkt 5.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Akcji Małych i Średnich Spółek Rynków Rozwiniętych** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 17 lutego 2017 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 17 lutego 2017 r.:

45% MSCI Europe Small Cap + 30% MSCI Europe + 20% MSCI US Mid Cap Value + 5% WIBID

gdzie:

MSCI Europe Small Cap – liczony w Euro indeks ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. odzwierciedlający zmiany cen akcji małych spółek notowanych na 15 europejskich rynkach rozwiniętych.

MSCI Europe – liczony w Euro indeks ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na 16 europejskich rynkach rozwiniętych.

MSCI US Mid Cap Value – liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji średnich spółek notowanych na rynkach w Stanach Zjednoczonych Ameryki. W skład tego indeksu wchodzi spółki “wartościowe” charakteryzujące się niskim wskaźnikiem ceny akcji do wartości księgowej spółki (P/BV), niskim wskaźnikiem ceny akcji do prognozowanego (w skali 12 miesięcy) zysku spółki (P/E) oraz wysoką stopą dywidendy.

WIBID O/N – Warsaw Interbank Bid Rate – średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednodniowy (overnight).

Wskaźniki referencyjne „MSCI Europe Small Cap”, „MSCI Europe” i „MSCI US Mid Cap Value” 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 dyrektywę 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Wskaźnik referencyjny „WIBID O/N” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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 dyrektywę 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 8) **W Rozdziale III Część B w pkt 6.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Rynków Wschodzących** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 21 marca 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 21 marca 2019 r.:

90% MSCI Emerging Markets Index + 10% WIBID

gdzie:

MSCI Emerging Markets Index – indeks liczony w USD uwzględniający wypłacane dywidendy po ich opodatkowaniu (tzw. Net Return), obliczany przez Morgan Stanley Capital International Inc., który odzwierciedla notowania giełdowe dużych i średnich spółek z 24 krajów rozwijających się (tzw. Emerging Markets), tj.: Brazylii, Chile, Chin, Kolumbii, Czech, Egiptu, Grecji, Węgier, Indii, Indonezji, Korei Południowej, Malezji, Meksyku, Pakistanu, Peru, Filipin, Polski, Rosji, Kataru, Republiki Południowej Afryki, Tajwanu, Tajlandii, Turcji oraz Zjednoczonych Emiratów Arabskich.

WIBID – Warsaw Interbank Bid Rate – stopa procentowa, jaką banki zapłacą za środki przyjęte w depozyt w PLN od innych banków dla depozytów jednodniowych.

Wskaźnik referencyjny „MSCI Emerging Markets Index” jest opracowywany 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.

Wskaźnik referencyjny „WIBID” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 9) **W Rozdziale III Część B w pkt 11.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Spokojna Inwestycja** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 12 czerwca 2014 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Od dnia 12 czerwca 2014 r. w Subfunduszu obowiązuje benchmark:

100% WIBID 1M

gdzie:

WIBID (Warsaw Interbank Bid Rate) – średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednomiesięczny.

Wskaźnik referencyjny „WIBID 1M” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 10) **W Rozdziale III Część B w pkt 12.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Wzrostu i Dochodu Rynku Europejskiego** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 22 stycznia 2014 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 22 stycznia 2014 r.:

30% MSCI Europe Index + 65% ICE BofA ML Euro HY Index + 5% WIBID

gdzie:

MSCI Europe Index – liczony w EURO i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. z siedzibą w Nowym Jorku indeks odzwierciedlający zmiany głównych indeksów giełdowych 16 największych rynków europejskich: Austrii, Belgii, Danii, Finlandii, Francji, Niemiec, Grecji, Irlandii, Włoch, Holandii, Norwegii, Portugalii, Hiszpanii, Szwecji, Szwajcarii i Wielkiej Brytanii. Indeks odzwierciedla zmiany cen akcji europejskich wyrażonych w walutach lokalnych.

ICE BofA ML Euro HY Index –indeks obrazujący stopy zwrotu dla obligacji korporacyjnych o ratingu niższym niż inwestycyjny emitowanych na rynku EURO lub euroobligacji, wyrażone w walucie EURO.

WIBID (Warsaw Interbank Bid Rate) – średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednodniowy (overnight).

Wskaźnik referencyjny „MSCI Europe Index” jest opracowywany 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.

Wskaźnik referencyjny „ICE BofA ML Euro HY Index” jest opracowywany przez administratora "ICE Data Indices LLC", 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 „WIBID” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 11) **W Rozdziale III Część B w pkt 13.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Wzrostu i Dochodu Rynku Amerykańskiego** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r.:

30% MSCI USA TR Gross Index + 65% ICE BofAML US Corporate Index + 5% WIBID O/N

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.

ICE BofAML US Corporate Index – Indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w USD dla obligacji o ratingu co najmniej inwestycyjnym publicznie emitowanych przez przedsiębiorstwa z rynku w USA.

WIBID O/N – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednodniowy (overnight).

Wskaźnik referencyjny „MSCI USA TR Gross Index” 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 Corporate Index” jest opracowywany przez administratora "ICE Data Indices LLC", 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 „WIBID O/N” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark S.A.", 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. W dniu 6 grudnia 2019 r. Komisja Nadzoru Finansowego otrzymała od spółki GPW Benchmark S.A. wniosek o udzielenie zezwolenia na prowadzenie działalności jako administrator wskaźników stopy procentowej WIBID oraz WIBOR.”

- 12) **W Rozdziale III Część B w pkt 13.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Wzrostu i Dochodu Rynku Amerykańskiego** zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

Warszawa, 28 lutego 2020 r.