

**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 Walutowy 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 Obligacji Europejskich Plus** 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.:

95% ICE BofA ML Corp EMU + 5% ICE BofAML Euro Currency 1-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index

gdzie:

ICE BofA ML Corp EMU (ICE BofA ML EMU Large Cap Corporate Index) – Indeks obrazujący stopę zwrotu dużych emisji papierów korporacyjnych denominowanych w Euro, dopuszczonych do publicznego obrotu z ratingiem inwestycyjnym. Warunkiem kwalifikacji obligacji do benchmarku jest stały kupon, wielkość emisji co najmniej 500 mln Euro i czas do wykupu co najmniej 1 rok.

ICE BofAML Euro Currency 1-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego jednomiesięczną stopę LIBID w EUR.

Wskaźniki referencyjne „ICE BofA ML EMU Large Cap Corporate Index” oraz „ICE BofAML Euro Currency 1-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity 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.”

- 3) **W Rozdziale III Część B w pkt 1.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Obligacji Europejskich Plus**, 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 Zrównoważony 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.:

25% ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index + 5% ICE BofAML US High Yield Index + 15% ICE BofAML US Corporate & Government Index + 40% MSCI USA TR Gross Index + 15% MSCI US Mid Cap Value

gdzie:

ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego sześciomiesięczną stopę LIBID w USD.

ICE BofAML US High Yield Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu dla obligacji przedsiębiorstw denominowanych w USD, dopuszczonych do publicznego obrotu w USA z ratingiem poniżej inwestycyjnego.

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.

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.

Wskaźniki referencyjne „ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index”, „ICE BofAML US High Yield Index” oraz „ICE BofAML US Corporate & Government 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.

Wskaźniki referencyjne „MSCI USA TR Gross Index” i „MSCI US Mid Cap Value” są opracowywane przez administratora „MSCI Ltd”, wpisanego do ww. rejestru.”

5) **W Rozdziale III Część B w pkt 3.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Zrównoważony Rynek Amerykańskiego**, 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 Europejskich** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 5 grudnia 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 5 grudnia 2019 r.:

95% MSCI Europe IMI Index + 5% ICE BofAML Euro Currency Overnight Deposit Bid Rate Index

gdzie:

MSCI Europe IMI Net Return EUR Index [M7EUIM] – Liczony w EUR i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. (MSCI) indeks odzwierciedlający szeroki rynek (IMI - investable market index) spółek z 15 europejskich rynków rozwiniętych. Indeks składa się z 1.435 spółek o dużej, średniej i małej kapitalizacji reprezentujących około 99% kapitalizacji rynkowej (skorygowanej o free float, czyli liczbę akcji w wolnym obrocie) tych spółek na 15 europejskich rynkach rozwiniętych.

ICE BofAML Euro Currency Overnight Deposit Bid Rate Index [L0EC] – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego stopę LIBID overnight w EUR.

Wskaźnik referencyjny „MSCI Europe IMI 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 Euro Currency Overnight Deposit Bid Rate Index” jest opracowywany przez administratora „ICE Data Indices LLC”, wpisanego do ww. rejestru.”

7) **W Rozdziale III Część B w pkt 4.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Europejskich**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

8) **W Rozdziale III Część B w pkt 5.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Amerykańskich** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 4 września 2019 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„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 Data Indices LLC", wpisanego do ww. rejestru.”

- 9) **W Rozdziale III Część B w pkt 5.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Amerykańskich**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

Warszawa, 28 lutego 2020 r.