

**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 wyliczenia 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 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 2.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Obligacji – Dynamiczna Alokacja 2** 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.:

75% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 25% WIBID O/N

gdzie:

ICE BofAML All Maturity Polish Government Index – główny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w polskich złotych dla obligacji skarbowych emitowanych przez Skarb Państwa.

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 „ICE BofAML All Maturity Polish 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. niewpisanego do ww. rejestru. 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 2.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Obligacji – Dynamiczna Alokacja 2**, 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 Stabilnego Inwestowania** 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% WIGdiv + 52,5% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 17,5% WIBID O/N

gdzie:

WIGdiv – Swoim portfelem indeks obejmuje spółki, które na przestrzeni ostatnich 5 lat obrotowych regularnie dokonywały wypłaty dywidendy. W skład portfela indeksu WIGdiv mogą wchodzić pakiety akcji spółek zakwalifikowanych do indeksów WIG20, mWIG40 lub sWIG80. WIGdiv jest indeksem dochodowym i przy jego obliczaniu uwzględnia się zarówno ceny zawartych w nim akcji, jak i dochody z dywidend i praw poboru.

ICE BofAML All Maturity Polish Government Index – Główny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w polskich złotych dla obligacji skarbowych emitowanych przez Skarb Państwa.

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 „ICE BofAML All Maturity Polish 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.

Wskaźniki referencyjne „WIGdiv” oraz „WIBID O/N” są opracowywane 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 Stabilnego Inwestowania**, 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 Dynamicznych Spółek** 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% sWIG80 + 35% mWIG40 + 10% MSCI World Index + 10% WIBID 1M

gdzie:

sWIG80 – Indeks sWIG80 obejmuje 80 małych spółek notowanych na Głównym Rynku GPW. sWIG80 jest indeksem typu cenowego, co oznacza, że przy jego obliczaniu bierze się pod uwagę jedynie ceny zawartych w nim transakcji, a nie uwzględnia się dochodów z tytułu dywidend. W indeksie sWIG80 nie uczestniczą spółki z indeksów WIG20 i mWIG40 oraz spółki zagraniczne notowane jednocześnie na GPW i innych rynkach o wartości rynkowej w dniu rankingu powyżej 100 mln euro. Udział jednej spółki w indeksie jest ograniczany do 10%.

mWIG40 – Indeks mWIG40 obejmuje 40 średnich spółek notowanych na Głównym Rynku GPW. mWIG40 jest indeksem typu cenowego, co oznacza, że przy jego obliczaniu bierze się pod uwagę jedynie ceny zawartych w nim transakcji, a nie uwzględnia się dochodów z tytułu dywidend. W indeksie mWIG40 nie uczestniczą spółki z indeksów WIG20 i sWIG80 oraz spółki zagraniczne notowane jednocześnie na GPW i innych rynkach o wartości rynkowej w dniu rankingu powyżej 1 mld euro.

MSCI World Index – globalny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu cen akcji dużych i średnich przedsiębiorstw z 23 rynków rozwiniętych, obliczany i publikowany przez MSCI.

WIBID 1M – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednomiesięczny.

Wskaźnik referencyjny „MSCI World 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.

Wskaźniki referencyjne „sWIG80”, „mWIG40” oraz „WIBID 1M” są opracowywane 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.”

- 7) **W Rozdziale III Część B w pkt 5.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Akcji – Aktywna Selekcja** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 2 stycznia 2015 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 2 stycznia 2015 r.:

90% WIG + 10% WIBID 1M

gdzie:

WIG – Indeks WIG obejmuje wszystkie spółki notowane na Głównym Rynku GPW, które spełnią bazowe kryteria uczestnictwa w indeksach. W indeksie WIG obowiązuje zasada dywersyfikacji, mająca na celu ograniczenie udziału pojedynczej spółki i sektora giełdowego. Jest indeksem dochodowym i przy jego obliczaniu uwzględnia się zarówno ceny zawartych w nim akcji, jak i dochody z dywidend i praw poboru.

WIBID 1M – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednomiesięczny.

Wskaźniki referencyjne „WIG” oraz „WIBID 1M” są opracowywane 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.”

- 8) **W Rozdziale III Część B w pkt 6.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Konserwatywny** 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 6M

gdzie:

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

Wskaźnik referencyjny „WIBID 6M” 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. niewpisanego do ww. rejestru. 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 7. dotyczącym Subfunduszu Pekao Konserwatywny Plus** dotychczasowe punkty: 7.1.1., 7.1.1.1., 7.1.1.2., 7.1.1.3., 7.1.1.4., 7.1.1.5., 7.1.1.6., 7.1.1.7., 7.1.2., 7.2., 7.3., 7.3.1., 7.3.2., 7.3.3., 7.3.4., 7.3.5., 7.3.6., 7.4., 7.4.1., 7.4.2., 7.4.3., 7.4.4., 7.4.5., 7.5. kolejno otrzymują nową następującą numerację: 7.2.1., 7.2.1.1., 7.2.1.2., 7.2.1.3., 7.2.1.4., 7.2.1.5., 7.2.1.6., 7.2.1.7., 7.2.2., 7.3., 7.4., 7.4.1., 7.4.2., 7.4.3., 7.4.4., 7.4.5., 7.4.6., 7.5., 7.5.1., 7.5.2., 7.5.3., 7.5.4., 7.5.5., 7.6.

- 10) **W Rozdziale III Część B w pkt 7.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Konserwatywny Plus** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 31 października 2017 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Od dnia 31 października 2017 r. w Subfunduszu obowiązuje benchmark:

WIBID 3M + 50 bp

gdzie:

WIBID 3M (Warsaw Interbank Bid Rate 3 months) – średnia stopa procentowa, według której banki naliczają odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt trzymiesięczny

50 bp – 50 punktów bazowych; jeden punkt bazowy to jedna setna punktu procentowego (‰/1000)

Wskaźnik referencyjny „WIBID 3M” 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 7.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Konserwatywny Plus**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.
- 12) **W Rozdziale III Część B w pkt 8.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Obligacji 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.:

75% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 25% WIBID O/N

gdzie:

ICE BofAML All Maturity Polish Government Index – główny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w polskich złotych dla obligacji skarbowych emitowanych przez Skarb Państwa.

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 „ICE BofAML All Maturity Polish 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. niewpisanego do ww. rejestru. 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.”

- 13) **W Rozdziale III Część B w pkt 8.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Obligacji Plus**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.
- 14) **W Rozdziale III Część B w pkt 9.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Stabilnego Wzrostu** 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% WIG + 52,5% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 17,5% WIBID O/N

gdzie:

WIG – Indeks WIG obejmuje wszystkie spółki notowane na Głównym Rynku GPW, które spełnią bazowe kryteria uczestnictwa w indeksach. W indeksie WIG obowiązuje zasada dywersyfikacji, mająca na celu ograniczenie udziału pojedynczej spółki i sektora giełdowego. Jest indeksem dochodowym i przy jego obliczaniu uwzględnia się zarówno ceny zawartych w nim akcji, jak i dochody z dywidend i praw poboru.

ICE BofAML All Maturity Polish Government Index – Główny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w polskich złotych dla obligacji skarbowych emitowanych przez Skarb Państwa.

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 „ICE BofAML All Maturity Polish 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.

Wskaźniki referencyjne „WIG” oraz „WIBID O/N” są opracowywane 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.”

15) **W Rozdziale III Część B w pkt 9.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Stabilnego Wzrostu**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

16) **W Rozdziale III Część B w pkt 10.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Zrównoważony** 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.:

55% WIG + 33,75% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 11,25% WIBID O/N

gdzie:

WIG – Indeks WIG obejmuje wszystkie spółki notowane na Głównym Rynku GPW, które spełnią bazowe kryteria uczestnictwa w indeksach. W indeksie WIG obowiązuje zasada dywersyfikacji, mająca na celu ograniczenie udziału pojedynczej spółki i sektora giełdowego. Jest indeksem dochodowym i przy jego obliczaniu uwzględnia się zarówno ceny zawartych w nim akcji, jak i dochody z dywidend i praw poboru.

ICE BofAML All Maturity Polish Government Index – Główny indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w polskich złotych dla obligacji skarbowych emitowanych przez Skarb Państwa.

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 „ICE BofAML All Maturity Polish 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.

Wskaźniki referencyjne „WIG” oraz „WIBID O/N” są opracowywane 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.”

17) **W Rozdziale III Część B w pkt 10.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Zrównoważony**, zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

18) **W Rozdziale III Część B w pkt 12.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Akcji Polskich** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 4 stycznia 2016 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Od dnia 4 stycznia 2016 r. w Subfunduszu obowiązuje benchmark:

80%WIG + 10%MSCI Europe + 10%WIBID 1M

gdzie

WIG - Warszawski Indeks Giełdowy spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie, obliczany i publikowany przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

MSCI Europe – indeks ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. z siedzibą w Nowym Jorku 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.

WIBID 1M – Warsaw Interbank Bid Rate – średnia stopa procentowa, według której banki nalicza odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt miesięczny.

Wskaźnik referencyjny "MSCI Europe" 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 „WIG” oraz „WIBID 1M” są opracowywane 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.”

- 19) **W Rozdziale III Część B w pkt 13.5.3. dotyczącym Subfunduszu Pekao Małych i Średnich Spółek Rynku Polskiego** informacja o benchmarku obowiązującym w ww. Subfunduszu od 2 stycznia 2017 r. – otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 2 stycznia 2017 r.:

70% mWIG40 + 20% sWIG80 + 10% WIBID 1M

gdzie

sWIG80 – Indeks sWIG80 obejmuje 80 małych spółek notowanych na Głównym Rynku GPW. sWIG80 jest indeksem typu cenowego, co oznacza, że przy jego obliczaniu bierze się pod uwagę jedynie ceny zawartych w nim transakcji, a nie uwzględnia się dochodów z tytułu dywidend. W indeksie sWIG80 nie uczestniczą spółki z indeksów WIG20 i mWIG40 oraz spółki zagraniczne notowane jednocześnie na GPW i innych rynkach o wartości rynkowej w dniu rankingu powyżej 100 mln euro. Udział jednej spółki w indeksie jest ograniczany do 10%.

mWIG40 – Indeks mWIG40 obejmuje 40 średnich spółek notowanych na Głównym Rynku GPW. mWIG40 jest indeksem typu cenowego, co oznacza, że przy jego obliczaniu bierze się pod uwagę jedynie ceny zawartych w nim transakcji, a nie uwzględnia się dochodów z tytułu dywidend. W indeksie mWIG40 nie uczestniczą spółki z indeksów WIG20 i sWIG80 oraz spółki zagraniczne notowane jednocześnie na GPW i innych rynkach o wartości rynkowej w dniu rankingu powyżej 1 mld euro.

WIBID 1M – Warsaw Interbank Bid Rate, czyli średnia stopa procentowa, według której banki naliczą odsetki od środków przyjętych od innych banków na depozyt jednomiesięczny.

Wskaźniki referencyjne „mWIG40”, „sWIG80” oraz „WIBID 1M” są opracowywane 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.”

Warszawa, 28 lutego 2020 r.