

**Informacja
o zmianach danych objętych prospektem informacyjnym
dokonanych w dniu 29 kwietnia 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 29 kwietnia 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: „11 marca 2020 r.” zastępuje się datą: „29 kwietnia 2020 r.”
- 2) **W Rozdziale III Część B pkt 3.5.3.** dotyczącym **Subfunduszu Pekao Stabilnego Inwestowania** otrzymuje nowe następujące brzmienie:

„3.5.3. Wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany dalej „wzorcem” (benchmark)

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 24 kwietnia 2020 r.:

30% MSCI High Dividend Yield Index + 52,5% ICE BofAML All Maturity Polish Government Index + 17,5% WIBID O/N

gdzie:

MSCI High Dividend Yield index - Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji spółek spośród składników indeksu MSCI World płacących wysokie dywidendy (Bloomberg: [M1WDHDVD Index - MSCI World High Dividend Yield Net Total Return Index].

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 naliczają 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 Benchmark Administration 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.

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.

Wskaźnik referencyjny „**MSCI High Dividend 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 „**WIBID O/N**” jest opracowywany przez administratora „GPW Benchmark”, niewpisanego do ww. rejestru.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. do 23 kwietnia 2020 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.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 6 lipca 2012 r. do 31 grudnia 2018 r.:

30% WIG-DIV + 70% BB

gdzie:

BB = 75% FTSE Poland Government Bond Index + 25% WIBID

WIG-DIV - indeks obejmuje do 30 spółek, które są uczestnikami indeksów WIG20, mWIG40 oraz sWIG80, które charakteryzują się najwyższą stopą dywidendy na koniec sierpnia każdego roku i regularnie tę dywidendę wypłacały w latach poprzednich. WIG-DIV jest indeksem dochodowym i przy jego obliczaniu uwzględnia się zarówno ceny zawartych w nim akcji, jak i dochody z dywidend i praw poboru. Indeks jest obliczany i publikowany przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

FTSE Poland Government Bond Index - główny indeks polskich obligacji skarbowych obliczany i publikowany przez FTSE Fixed Income LLC

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

Stosowane wskaźniki referencyjne są opracowywane przez administratorów, którzy nie zostali wpisani 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.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu do dnia 5 lipca 2012 r.:

30% WIG + 70% BB

gdzie:

BB = 75% CPGBI + 25% WIBID

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

CPGBI główny indeks polskich obligacji skarbowych (Citigroup Poland Government Bond Index) obliczany i publikowany przez Citigroup

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

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 odpowiedności, 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 sponosuje, 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, 29 kwietnia 2020 r.