

**Informacja  
o zmianach danych objętych prospektem informacyjnym  
dokonanych w dniu 9 marca 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 9 marca 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: „28 lutego 2020 r.” zastępuje się datą: „9 marca 2020 r.”
- 2) **W Rozdziale III Część B pkt 5.5.3.** dotyczący **Subfunduszu Pekao Akcji Małych i Średnich Spółek Rynków Rozwiniętych** otrzymuje nowe następujące brzmienie:

**„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 9 marca 2020 r.:**

**55% MSCI USA SMID cap index + 25% MSCI Europe SMID Cap Index + 10% MSCI Japan Small Cap Index + 10% WIBID O/N**

gdzie:

**MSCI USA SMID cap index** - Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji małych i średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki z uwzględnieniem dywidend pomniejszych o podatek (Bloomberg: [M1USSM Index - MSCI USA SMID Cap Index (Net Total Return)]).

**MSCI Europe SMID Cap Index** - Liczony w EUR i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji małych i średnich spółek z 15 największych europejskich krajów rozwiniętych z uwzględnieniem dywidend pomniejszych o podatek (Bloomberg: [M7EUSM Index - MSCI Europe SMID Cap Index (Net Total Return)]).

**MSCI Japan Small Cap Index** – Liczony w JPY i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji małych spółek japońskich z uwzględnieniem dywidend pomniejszych o podatek (Bloomberg: [M7JPSC Index - MSCI Small Cap Japan Index (Net Total Return)]).

**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 SMID cap 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 „**MSCI Europe SMID Cap Index**” jest opracowywany przez administratora "MSCI Ltd", wpisanego do ww. rejestru.

Wskaźnik referencyjny „**MSCI Japan Small Cap Index**” jest opracowywany przez administratora "MSCI Ltd", wpisanego do ww. rejestru.

Wskaźnik referencyjny „**WIBID O/N**” jest opracowywany przez administratora "GPW Benchmark", wpisanego do ww. rejestru.

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 17 lutego 2017 r. do 8 marca 2020 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.

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 3 grudnia 2010 r. do 16 lutego 2017 r.:**

**45% MSCI Europe Small Cap + 5% MSCI Europe + 45% 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 na rynku europejskim.

**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 Euro.

**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.

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

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 15 października 2010 r. do 2 grudnia 2010 r.:**

**50% MSCI Europe Small Cap + 45% 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 na rynku europejskim.

**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.

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

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 16 grudnia 2008 r. do 14 października 2010 r.:**

**40% Dow Jones Stoxx 200 Small\* + 45% Russell Mid Cap Value\*\* + 10% MSCI Europe Small Cap\* + 5% WIBID**

\*) – zmiany w EURO

\*\*\*) – zmiany w USD

gdzie:

**Dow Jones Stoxx Small 200** – należy przez to rozumieć indeks ustalany przez STOXX Limited z siedzibą w Zurychu, liczony w EUR, odzwierciedlający zmiany cen akcji spółek o małej kapitalizacji rynkowej na rynku europejskim w następujących krajach: Austria, Belgia, Dania, Finlandia, Francja, Niemcy, Grecja, Irlandia, Włochy, Luksemburg, Holandia, Norwegia, Portugalia, Hiszpania, Szwecja, Szwajcaria oraz Wielka Brytania

**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)

**MSCI Europe Small Cap** – liczony w EUR, indeks ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. odzwierciedlający zmiany cen akcji małych spółek na rynku europejskim

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

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 27 kwietnia 2007 r. do 15 grudnia 2008 r.:**

**45% Dow Jones Stoxx 200 Small\* + 30% Russell Mid Cap Value\*\* + 20% Russell 2000 Value\*\* + 5%**

**WIBID**

\*) – zmiany w EURO

\*\*) – zmiany w USD

gdzie:

**Dow Jones Stoxx Small 200** – należy przez to rozumieć indeks ustalany przez STOXX Limited z siedzibą w Zurychu odzwierciedlający zmiany cen akcji spółek o małej kapitalizacji rynkowej na rynku europejskim w następujących krajach: Austria, Belgia, Dania, Finlandia, Francja, Niemcy, Grecja, Irlandia, Włochy, Luksemburg, Holandia, Norwegia, Portugalia, Hiszpania, Szwecja, Szwajcaria oraz Wielka Brytania

**Russell 2000 Value** – należy przez to rozumieć indeks ustalany przez Frank Russell Company z siedzibą w Tacoma obrazujący stopę zwrotu 2000 najmniejszych spółek wchodzących w skład indeksu Russell 3000 Index, które reprezentują około 8% kapitalizacji rynkowej spółek wchodzących w skład indeksu Russell 3000 Index

**Russell Mid Cap Value** – należy przez to rozumieć 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)

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

**Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 10 kwietnia 2007 r. do 26 kwietnia 2007 r.:**

**45%\*Dow Jones Stoxx Small 200\* + 45%\*Russel 2000 Value\*\* + 5%\*Russel Mid Cap Value\*\* + 5%\*WIBID**

\*) zmiany w Euro

\*\*) zmiany w USD

gdzie:

**Dow Jones Stoxx Small 200** – należy przez to rozumieć indeks ustalany przez STOXX Limited z siedzibą w Zurychu odzwierciedlający zmiany cen akcji spółek o małej kapitalizacji rynkowej na rynku europejskim w następujących krajach: Austria, Belgia, Dania, Finlandia, Francja, Niemcy, Grecja, Irlandia, Włochy, Luksemburg, Holandia, Norwegia, Portugalia, Hiszpania, Szwecja, Szwajcaria oraz Wielka Brytania

**Russell 2000 Value** – należy przez to rozumieć indeks ustalany przez Frank Russell Company z siedzibą w Tacoma obrazujący stopę zwrotu 2000 najmniejszych spółek wchodzących w skład indeksu Russell 3000 Index, które reprezentują około 8% kapitalizacji rynkowej spółek wchodzących w skład indeksu Russell 3000 Index

**Russell Mid Cap Value** – należy przez to rozumieć 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)

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

**Źródło:** MSCI.

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

Warszawa, 9 marca 2020 r.