

**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 Obligacji – Dynamiczna Alokacja 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 w pkt 27.3.** informacja o benchmarku obowiązującym w Funduszu od 1 stycznia 2019 r. otrzymuje nowe następujące brzmienie:

**„Benchmark obowiązujący w Funduszu 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” 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 w pkt 27.3.** zdanie w brzmieniu: „Źródło: © 2017 FTSE Fixed Income LLC. Wszelkie prawa zastrzeżone” usuwa się.

**Warszawa, 28 lutego 2020 r.**