

**INNE INFORMACJE**  
**UJAWNIA NE W ZWIĄZKU Z WYMOGAMI PRAWA**

*publikowane wraz ze sprawozdaniem finansowym*



W związku z wymogami w zakresie ujawniania informacji przez fundusze – wskazanymi w odpowiednich przepisach Unii Europejskiej – razem ze sprawozdaniem finansowym funduszu publikowane są inne informacje wymagane przepisami prawa.

### **Przepisy, w związku z którymi dokonywane są te ujawnienia:**

**Ustawa:** ..... ustawa z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi [t.j. Dz.U. z 2020, poz. 95, ze zm.] ;

**Rozporządzenie UE NR 231/2013:**..... Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) NR 231/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru [R231/2013] ;

**Rozporządzenie UE NR 2015/2365 (SFTR):** .... Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 [SFTR] ;

### **Zakres informacji**

1. Ujawnienia dotyczące stosowania określonych technik inwestycyjnych i inwestycjach w określone instrumenty finansowe.

Na podstawie art. 13 Rozporządzenia 2015/2365 (SFTR) sporządzane są informacje o stosowaniu: (i) transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz (ii) swapów przychodu całkowitego. Celem tego ujawnienia jest zapewnienie, by uczestnicy byli w stanie podejmować swoje decyzje inwestycyjne z uwzględnieniem ogólnego profilu ryzyka i zysku funduszu, podczas, gdy transakcje finansowane z użycie papierów wartościowych są powszechnie stosowane w celu sprawnego zarządzania portfelem, przy osiągnięciu celu inwestycyjnego lub w celu zwiększenia rentowności.

2. Informacje dot. głównych cech systemów zarządzania ryzykiem stosowanych przez Towarzystwo do zarządzania rodzajami ryzyka, w tym poziomem dźwigni finansowej i poziomem wskaźnika ryzyka i zysku prezentowanego w dokumencie kluczowe informacje dla inwestora.

Zgodnie z przepisem art. 222b Ustawy (z uwzględnieniem art. 108 i 109 Rozporządzenia UE NR 231/2013) Fundusz (FIZ oraz SFIO) udostępnia uczestnikom okresowo informacje o: (a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością, (b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością, (c) aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający. Ponadto, ujawniane są regularnie (w stosunku do funduszy, które stosują dźwignię finansową AFI): (a) zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w ich imieniu, oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI, (b) łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI.

### **Ujawnienia SFTR (dotyczące stosowania określonych technik inwestycyjnych i inwestycjach w określone instrumenty finansowe)**

W roku 2020 Subfundusze nie dokonywały inwestycji wymagających ujawnień w zakresie SFTR:

- Fundusz / subfundusze nie udzielały w okresie sprawozdawczym ani nie miały na datę bilansową udzielonych pożyczek papierów wartościowych,
- Fundusz nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych (nie jest to dozwolone postanowieniami Ustawy ani Statutu),
- Fundusz / subfundusze nie miały na datę bilansową transakcji typu bsb / reverse-repo,
- Fundusz / subfundusze nie miały na datę bilansową transakcji typu sbb / repo.

### **Ujawnienia w zakresie profilu ryzyka, zarządzania ryzykiem, dotyczące dźwigni finansowej oraz poziomu wskaźnika ryzyka i zysku**

Towarzystwo ujawnia (zgodnie z art. 108 ust. 5 Rozporządzenia UE NR 231/2013) główne cechy systemów zarządzania ryzykiem stosowanych przez Towarzystwo do zarządzania rodzajami ryzyka, które mogą mieć wpływ na którykolwiek z zarządzanych przez nie funduszy. W przypadku wprowadzenia zmian ujawniane informacje obejmują informacje na temat zmiany oraz oczekiwanego wpływu, jaki będzie ona mieć na fundusz i jego inwestorów. Ponadto, zgodnie z przepisem art. 222b Ustawy (z uwzględnieniem art. 108 i 109 Rozporządzenia UE NR 231/2013) Fundusz udostępnia uczestnikom okresowo informacje o: (a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością, (b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością, (c) aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający.

- W okresie sprawozdawczym nie było przypadków specjalnych ustaleń w odniesieniu do aktywów w związku z ich niepłynnością.
- Regulacje wewnętrzne dotyczące zarządzania płynnością nie uległy w okresie sprawozdawczym zmianom.

- Informacje dotyczące dźwigni finansowej AFI zawarte są w poniższym zestawieniu, ze wskazaniem na metodę obliczania.

Informacja o aktualnym poziomie profilu ryzyka (syntetyczny wskaźnik ryzyka i zysku) zawarta jest w kluczowych informacjach dla klienta (KII), a poniżej zaprezentowano stawki aktualne na datę sprawozdania.

W stosunku do funduszy, które stosują dźwignię finansową AFI: (a) zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w ich imieniu, oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI, (b) łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI.

Według stanu na dzień ostatniej wyceny w okresie objętym sprawozdaniem łączna wysokość dźwigni finansowej (obliczanej odpowiednio metodą brutto [*gross exposure*] i metodą zaangażowania [*commitment approach*]) zastosowanej przez Fundusz miała wartość [%]:

<i>lp</i>	<i>Nazwa subfunduszu</i>	<i>Metoda brutto</i>	<i>Metoda zaangażowania</i>
1.	<b>Pekao PPK SFIO -z wydzielonymi subfunduszami:</b>		
1.1.	Pekao PPK 2020 Spokojne Jutro	0,2	100,0
1.2.	Pekao PPK 2025	5,9	103,9
1.3.	Pekao PPK 2030	8,2	103,3
1.4.	Pekao PPK 2035	9,5	104,2
1.5.	Pekao PPK 2040	7,7	105,1
1.6.	Pekao PPK 2045	5,8	104,4
1.7.	Pekao PPK 2050	3,2	104,9
1.8.	Pekao PPK 2055	1,6	105,8
1.9.	Pekao PPK 2060	0,5	105,0

W odniesieniu do Funduszu stosowana jest (jednakowa dla wszystkich funduszy, w tym subfunduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA) metoda zaangażowania.

Stawki SRRI (*synthetic risk-reward indicator* wskaźnika ryzyka i zysku) prezentowane są w dokumencie kluczowe informacje dla inwestora (KII) – dokumencie prezentowanym dla każdego subfunduszu m.in. na stronie [www.pekaotfi.pl](http://www.pekaotfi.pl). W przypadku zmiany stawki SRRI ma miejsce każdorazowo aktualizacja dokumentu KII.

	<i>Nazwa subfunduszu</i>	<i>SRRI</i>
1.	Pekao PPK 2020 Spokojne Jutro	2
2.	Pekao PPK 2025	3
3.	Pekao PPK 2030	4
4.	Pekao PPK 2035	4
5.	Pekao PPK 2040	4
6.	Pekao PPK 2045	4
7.	Pekao PPK 2050	5
8.	Pekao PPK 2055	5
9.	Pekao PPK 2060	5

Warszawa, dnia 20.08.2020 roku.

### Zarząd Pekao TFI SA:

**Jacek Janiuk** ..... – *Prezes Zarządu*

**Jacek Babiński** ..... – *Wiceprezes Zarządu*

Sprawozdanie sporządzone zostało w wersji elektronicznej, a podpisy złożone w formie kwalifikowanych podpisów elektronicznych