

**Informacja
o zmianach danych objętych prospektem informacyjnym
dokonanych w dniu 19 października 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. 2018, poz. 2202 ze zm.) Pekao Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. informuje o dokonaniu w dniu 19 października 2020 roku następujących zmian w treści prospektu informacyjnego **Pekao Walutowy Funduszu Inwestycyjnego Otwartego** („Fundusz”):

- 1) **Na stronie tytułowej prospektu informacyjnego Funduszu** w informacji o dacie sporządzenia ostatniego tekstu jednolitego Prospektu datę: „10 sierpnia 2020 r.” zastępuje się datą: „19 października 2020 r.”
- 2) **W Rozdziale III Część B pkt 3.5.3.** dotyczący **Subfunduszu Pekao Zrównoważony Rynek Amerykańskiego** 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 19 października 2020 r.:

55% MSCI USA Index + 40% ICE BofA US Corporate & High Yield Index + 5% ICE BofA US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Index

gdzie:

MSCI USA Index – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych i średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki z uwzględnieniem dywidend. Bloomberg: **[M1US Index - MSCI USA Index (Net Total Return)]**

ICE BofA US Corporate & High Yield Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu dla obligacji korporacyjnych denominowanych w USD, wyemitowanych na rynku krajowym Stanów Zjednoczonych Ameryki z ratingiem poniżej inwestycyjnego. Bloomberg: **[IUC0 Index – ICE BofA US Corporate & High Yield Index]**

ICE BofA US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego stopę LIBID overnight w USD. Bloomberg: **[LOUS Index – ICE BofA SOFR Overnight Rate Index]**

Wskaźnik referencyjny „**MSCI USA 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 „**ICE BofA US Corporate & High Yield Index**” jest opracowywany przez administratora "ICE Benchmark Administration Limited", wpisanego do ww. rejestru.

Wskaźnik referencyjny „**ICE BofA US Dollar Overnight Deposit Bid Rate Index**” jest opracowywany przez administratora "ICE Benchmark Administration Limited", wpisanego do ww. rejestru.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 1 stycznia 2019 r. do 18 października 2020 r.:

25% ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index + 5% ICE BofAML US High Yield Index + 15% ICE BofAML US Corporate & Government Index + 40% MSCI USA TR Gross Index + 15% MSCI US Mid Cap Value

gdzie:

ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu syntetycznego instrumentu finansowego wypłacającego sześciomiesięczną stopę LIBID w USD.

ICE BofAML US High Yield Index – Indeks obrazujący stopę zwrotu dla obligacji przedsiębiorstw denominowanych w USD, dopuszczonych do publicznego obrotu w USA z ratingiem poniżej inwestycyjnego.

ICE BofAML US Corporate & Government Index – Indeks, który odwzorowuje stopy zwrotu w USD dla obligacji o ratingu conajmniej inwestycyjnym publicznie emitowanych między innymi przez Departament Skarbu USA, amerykańskie agencje rządowe, a także obligacje innych krajów, ponadnarodowe (tzw. supranational) oraz przedsiębiorstw.

MSCI USA TR Gross Index – Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych i średnich spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki z uwzględnieniem dywidend.

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.

Wskaźniki referencyjne „ICE BofAML US Dollar 6-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index”, „ICE BofAML US High Yield Index” oraz „ICE BofAML US Corporate & Government Index” są opracowywane 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 „MSCI USA TR Gross Index” i „MSCI US Mid Cap Value” są opracowywane przez administratora "MSCI Ltd", wpisanego do ww. rejestru.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu od 21 lipca 2010 r. do 31 grudnia 2018 r.:

25% FTSE USD 6-Month Eurodeposit + 5% FTSE US High Yield Market Capped Index + 15% FTSE US Broad Investment Grade Bond Index + 40% MSCI USA Total Return + 15% MSCI US Mid Cap Value

gdzie:

FTSE USD 6-Month Eurodeposit. Indeks wyliczany w oparciu o średnie oprocentowanie 6. miesięcznych depozytów USD na rynku europejskim. Indeks publikowany codziennie przez FTSE Fixed Income LLC.

FTSE US High Yield Market Capped Index. Indeks obrazujący stopy zwrotu na rynku w USA dla obligacji korporacyjnych denominowanych w USD oraz posiadających rating nieinwestycyjny oparty na ratingach agencji Moody's i S&P (tzn. niższy niż BB+/Ba1). Warunkiem kwalifikacji obligacji do benchmarku jest: stały kupon, wielkość pojedynczej emisji co najmniej 100 mln USD przy całkowitej emisji 400 mln USD lub wielkość pojedynczej emisji co najmniej 200 mln USD przy całkowitej emisji poniżej 400 mln USD, maksymalna wielkość emisji dla emitenta wynosi 5 mld USD. Indeks publikowany codziennie przez FTSE Fixed Income LLC.

FTSE US Broad Investment Grade Bond Index. Indeks obrazujący stopy zwrotu na rynku w USA dla obligacji rządowych, korporacyjnych oraz zabezpieczonych, denominowanych w USD oraz posiadających rating inwestycyjny. Indeks publikowany codziennie przez FTSE Fixed Income LLC.

MSCI USA Total Return Liczony w USD i ustalany przez Morgan Stanley Capital International Inc. Indeks odzwierciedlający zmiany cen akcji dużych, średnich oraz małych spółek w Stanach Zjednoczonych Ameryki.

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.

Wskaźniki referencyjne „MSCI USA Total Return” 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 dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014.

Pozostałe stosowane wskaźniki referencyjne są opracowywane przez administratorów, którzy nie zostali wpisani do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 ww. Rozporządzenia.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) od 27 maja 2009 r. do 20 lipca 2010 r.:

50% S&P500 Total Return Index + 50% Barclays Capital Government/Corporate Bond Index

gdzie:

Barclays Capital Government/Corporate Bond Index - indeks odzwierciedlający zachowanie się amerykańskich papierów skarbowych i amerykańskich agend rządowych oraz obligacji amerykańskich przedsiębiorstw o ratingu inwestycyjnym na poziomie co najmniej Baa wydanym przez agencję ratingową Moody's. Indeks ten jest obliczany w oparciu o ceny instrumentów wyrażone w USD.

S&P500 Total Return Index – indeks (Standard and Poor's 500 Total Return Index) w skład którego wchodzi 500 spółek o największej kapitalizacji, notowanych na giełdach New York Stock Exchange oraz NASDAQ, dobranych ze względu na swoją płynność, kapitalizację rynkową i reprezentację odpowiednich sektorów gospodarki. Indeks ten jest obliczany w oparciu o ceny spółek wyrażone w USD.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) od 1 czerwca 2006 r. do 26 maja 2009 r.:

50% S&P500 + 50% Lehman Brothers Government/Credit Bond Index

gdzie:

Lehman Brothers Government/Credit Bond Index jest indeksem odzwierciedlającym zachowanie się amerykańskich papierów skarbowych i amerykańskich agend rządowych oraz obligacji amerykańskich przedsiębiorstw o ratingu inwestycyjnym,

S&P500 – Standard and Poor's Total Return Index jest indeksem, w skład którego wchodzi 500 spółek znajdujących się w obrocie w USA, dobranych ze względu na swoją płynność, kapitalizację rynkową i reprezentację odpowiednich sektorów gospodarki.

Benchmark obowiązujący w Subfunduszu (wówczas: Funduszu) do 31 maja 2006 r.:

50% S&P500 + 50% LehmanBrothersABI

gdzie:

LehmanBrothersABI – Lehman Brothers Aggregate Bond Index jest indeksem odzwierciedlającym zachowanie się amerykańskich papierów skarbowych, obligacji przedsiębiorstw oraz dłużnych papierów wartościowych zabezpieczonych na nieruchomościach i innych aktywach.

S&P500 – Standard and Poor's Total Return Index jest indeksem, w skład którego wchodzi 500 spółek znajdujących się w obrocie w USA, dobranych ze względu na swoją płynność, kapitalizację rynkową i reprezentację odpowiednich sektorów gospodarki.

Wzorzec (benchmark) dotyczy wszystkich kategorii Jednostek Uczestnictwa Funduszu.

Źródło: MSCI.

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.

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

Warszawa, 19 października 2020 r.