

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

INNE INFORMACJE UJAWNIANE W ZWIĄZKU Z WYMOGAMI PRAWA

publikowane wraz ze sprawozdaniem finansowym

ZA OKRES PÓŁROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 30 CZERWCA 2022 ROKU

Warszawa, dnia 18.08.2022 roku.

Zarząd Pekao TFI S.A.:

Łukasz Kędzior
Prezes Zarządu

Jacek Babiński
Wiceprezes Zarządu

Maciej Łoziński
Wiceprezes Zarządu

Sprawozdanie finansowe sporządza się w wersji elektronicznej oraz zostaje podpisane z wykorzystaniem kwalifikowanych podpisów elektronicznych.

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 2021, poz. 605, 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] ;

Ustawa o rachunkowości:..... *ustawa z dnia 29 września 1994 roku o rachunkowości* [t.j. Dz.U. z 2021, poz. 217, ze zm.] ;

Rozporządzenie Ministra Finansów z dnia 18 listopada 2020 r. w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych [Dz.U., poz. 2103] ;

Wytyczne ESMA dotyczące opłat za wyniki... Wytyczne ESMA¹ dotyczące opłat za wyniki w UCITS i niektórych rodzajach AFI (dokument ESMA34-39-992 PL z 5/11/2020).

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 o metodzie pomiaru całkowitej ekspozycji Funduszu.

Zgodnie z art. 22 Rozporządzenia Ministra Finansów z 2.07.2019 w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych Towarzystwo ujawnia w rocznym sprawozdaniu finansowym FIO aktualnie stosowaną metodę pomiaru całkowitej ekspozycji funduszu.

3. Informacje dot. wyliczonego w roku sprawozdawczym wynagrodzenia zmiennego.

Zgodnie z zapisem pkt. (wytyczną) 49 dokumentu Wytyczne ESMA dotyczącymi opłat za wyniki w sprawozdaniu finansowym (rocznym oraz półrocznym) ujawniany jest wpływ naliczenia opłat za wyniki na poszczególne kategorie jednostek uczestnictwa w funduszu z prezentacją: (i) kwoty naliczonych opłat za wyniki oraz (ii) procentową wysokość opłat w odniesieniu do WAN danej kategorii jednostek uczestnictwa.

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

Towarzystwo jest zobowiązane do przekazywania informacji o stosowaniu przez Fundusz: (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.

Pojęcia powyższe oznaczają – w odniesieniu do Funduszu:

- *Transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych* – transakcje 'udzielanie pożyczek papierów wartościowych', 'zaciąganie pożyczek papierów wartościowych', 'transakcje zwrotne kupno-sprzedaż' (BSB) lub 'transakcje zwrotną sprzedaż-kupno' (SBB) oraz 'transakcja odkupu', 'transakcję z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego' Fundusz nie zaciąga pożyczek papierów wartościowych.
- swap przychodu całkowitego – specyficzny kontrakt pochodny opisany w SFTR – Fundusz nie zawierał takich kontraktów.

Transakcje takie prezentowane są w 'Notach objaśniających' (Nota 7) do sprawozdania finansowego oraz poniżej, a ogólny opis / informacje zaprezentowany zostały w treści *Prospektu Informacyjnego Funduszu* [w Rozdziale VI], gdzie zostały przedstawione także kryteria doboru kontrahentów oraz wskazania co do maksymalnych poziomów takich transakcji. W Prospekcie Informacyjnym Funduszu wskazane są m.in.:

- ogólny opis transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ogólny opis swapów przychodu całkowitego stosowanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania i uzasadnienie ich stosowania,

¹ ESMA - European Securities and Markets Authority: europejski organ nadzoru nad rynkiem instrumentów finansowych i giełd

- ogólne dane, które należy zgłaszać w odniesieniu do poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego:
- rodzaje aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji,
- maksymalny odsetek zarządzanych aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji,
- szacowany odsetek zarządzanych aktywów, które będą przedmiotem poszczególnych rodzajów tych transakcji,
- kryteria wyboru kontrahentów (w tym status prawny, kraj pochodzenia, minimalny rating kredytowy),
- akceptowalne zabezpieczenia: opis akceptowalnych zabezpieczeń w odniesieniu do rodzajów aktywów, wystawcy, terminu zapadalności, płynności, a także zasad dywersyfikacji i korelacji zabezpieczeń,
- wycena zabezpieczeń: opis stosowanej metody wyceny zabezpieczeń i jej uzasadnienie oraz informacja, czy stosowana jest codzienna wycena według wartości rynkowej i codzienne zmienne depozyty zabezpieczające,
- zarządzanie ryzykiem: opis ryzyk związanych z transakcjami finansowanymi z użyciem papierów wartościowych i swapami przychodu całkowitego, jak również ryzyk związanych z zarządzaniem zabezpieczeniami, takich jak: ryzyko operacyjne, ryzyko płynności, ryzyko kontrahenta, ryzyko przechowywania i ryzyka prawne, a także, w stosownych przypadkach, ryzyk wynikających z ponownego wykorzystania tych zabezpieczeń,
- opis sposobu przechowywania aktywów podlegających transakcjom finansowanym z użyciem papierów wartościowych i swapom przychodu całkowitego oraz otrzymanych zabezpieczeń (np. u depozytariusza funduszu),
- opis wszelkich ograniczeń (regulacyjnych lub dobrowolnych) dotyczących ponownego wykorzystania zabezpieczeń,
- zasady dotyczące podziału zysków z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego: opis tego, jaki odsetek dochodów generowanych przez transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapów przychodu całkowitego jest przekazywany do przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania, a także opis kosztów i opłat przypisanych zarządzającemu lub stronom trzecim (np. tzw. "agent lender"). Prospekt emisyjny lub informacje ujawniane inwestorom wskazują również, czy są to jednostki powiązane z zarządzającym.

Stosowanie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, według stanu na dzień bilansowy:

Dane ogólne:

- kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów,

W przypadku, gdy istnieją przypadki udzielenia (na datę bilansową) pożyczek papierów wartościowych wraz z szczegółowymi danymi tych umów są zaprezentowane w tabeli 1 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 8)

W tabeli 2 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7)
- kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania.

Dane dotyczące koncentracji:

- 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy),

ND
- 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia).

Podmioty, z którymi na datę bilansową zawarte są kontrakty w tabeli 2 poniżej, wraz z informacją w zakresie wolumenu transakcji pozostających do rozliczenia (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7)

Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego - w podziale na poniższe kategorie:

- rodzaj i jakość zabezpieczeń,

Nie jest stosowana obecnie polityka zabezpieczenia takich transakcji. Instrumenty finansowe będące przedmiotem transakcji stanowią odpowiedni poziom zabezpieczenia jej pełnego wykonania, a ponadto z kontrahentami podpisywane są odpowiednie umowy zabezpieczające. W szczególnej tabeli (poniżej) zaprezentowane zostały oznaczenia odpowiednich instrumentów finansowych.

W przypadku części umów ramowych (zgodnie ze standardami międzynarodowymi) uzgodniona jest wymiana depozytów zabezpieczających – w pieniądzu.

ND
- okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności,

PLN – w przypadku polskich kontrahentów
EUR – w przypadku umów ramowych z podmiotami zagranicznymi
- waluta zabezpieczeń,

Szczegółowe informacje co do transakcji BSB i SBB pozostających do rozliczenia (na datę bilansową) zawarte są w tabeli 2 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7), w tym ze wskazaniem okresu do zapadalności
- okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte,

Informacje co do transakcji pożyczek papierów wartościowych pozostających do rozliczenia (na datę bilansową) zawarte są w tabeli 1 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 5) – przy zawieraniu tych transakcji nie był wskazany termin zwrotu takiej pożyczki

Podmioty wskazane w Tabelach 1, 2 poniżej, odpowiednio z:
- kraj, w którym kontrahenci mają siedzibę,

- rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne).

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom,

- zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych.

Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego:

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego:

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach.

Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. "agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego.

Wskazane w powyższej tabeli, jako 'ND' dane nie są dostępne i nie ma obowiązku ich ujawniania w niniejszym sprawozdaniu lub nie dotyczą.

Odpowiednio: odwołania powyżej do Not odnoszą się do odpowiednich 'Not objaśniających' w sprawozdaniach finansowych jednostkowych dla każdego subfunduszu.

Tabela 1: Informacje o udzielonych pożyczkach papierów wartościowych – na datę bilansową.

- Subfundusze nie udzielały ani nie miały na datę bilansową udzielonych pożyczek papierów wartościowych.
- Fundusz nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych (nie jest to dozwolone postanowieniami Ustawy ani Statutu).

Tabela 2: Informacje o zawartych transakcjach bsb/sbb/repo/reverse repo - na datę bilansową.

Transakcje typu Buy-sell back										
30.06.2022										
Lp.	Kontrahent	Rodzaj	Wycena w walucie (w tys.)	Waluta	Dni do zapadalności	% Aktywów	Instrument bazowy	ISIN	Wartość nominalna (instr. bazowy w tys.)	Wycena w tys. PLN
Pekao Obligacji – Dynamiczna Alokacja 2										
1,	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	4 088	PLN	1	0,60%	FP280301	PL0000500310	5 571	4 088
1, - pozycja.						0,60%		4 088		
Pekao Dynamicznych Spółek										
1,	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	2 394	PLN	1	1,06%	FP250701	PL0000500286	2 903	2 394
1, - pozycja.						1,06%		2 394		
Pekao Akcji – Aktywna Selekcja										
1,	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	7 293	PLN	1	1,59%	FP280301	PL0000500310	9 939	7 293
2,	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	2 999	PLN	1	0,65%	WZ0524	PL0000110615	3 018	2 999
2, - pozycje.						2,24%		10 292		

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Inne informacje - ujawniane na 30 czerwca 2022 roku

Pekao Konserwatywny											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	4 938	PLN	1	0,11%	FP310601	PL0000500328	5 303	4 938		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE				0,11%				4 938			
Pekao Konserwatywny Plus											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	7 462	PLN	1	0,21%	FP280301	PL0000500310	10 169	7 462		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE				0,21%				7 462			
Pekao Stabilnego Wzrostu											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	2 063	PLN	1	0,79%	FP280301	PL0000500310	2 812	2 063		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE				0,79%				2 063			
Pekao Zrównoważony											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	2 860	PLN	1	0,46%	FP310601	PL0000500328	3 072	2 860		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE				0,46%				2 860			
Pekao Megatrendy											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	3 000	PLN	1	2,88%	FP280301	PL0000500310	4 088	3 000		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE				2,88%				3 000			
Transakcje typu Sell-buy-back / repo											
30.06.2022											
Lp.	Kontrahent	Rodzaj	Wycena w walucie	Waluta	Dni do zapadalności	% Aktywów	Instrument bazowy	ISIN	Wartość nominalna (instr. bazowy w tys.)	Wycena w tys. PLN	
Pekao Obligacji – Dynamiczna Alokacja 2											
1,	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	64 628	PLN	13	9,54%	FP280301	PL0000500310	89 000	64 628	
2,	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	34 003	PLN	1	5,02%	WZ0524	PL0000110615	34 215	34 003	
3,	BNP Paribas	SBB	18 856	PLN	4	2,78%	PS1026	PL0000113460	25 000	18 856	
3, - pozycja. PODSUMOWANIE						17,34%				117 487	
Pekao Bazowy 15 Dywidendowy											
1, IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	6 501	PLN	1	11,41%	DS0725	PL0000108197	7 084	6 501		
1, - pozycja. PODSUMOWANIE						11,41%				6 501	
Pekao Konserwatywny											
1,	NWAI Dom Maklerski S.A.	SBB	109 265	PLN	5	2,38%	WZ0524	PL0000110615	110 000	109 265	
2,	Santander Bank Polska S.A. (kontrahent)	SBB	49 661	PLN	8	1,08%	WZ0524	PL0000110615	50 000	49 661	
3,	Santander Bank Polska S.A. (kontrahent)	SBB	145 773	PLN	8	3,18%	WZ1126	PL0000113130	150 000	145 773	
4,	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	131 130	PLN	6	2,86%	FP270401	PL0000500260	180 000	131 130	
5,	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	11 634	PLN	1	0,25%	WZ0524	PL0000110615	11 706	11 634	
6,	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	46 380	PLN	1	1,01%	WZ1131	PL0000113213	50 000	46 380	
7,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	178 991	PLN	1	3,91%	WZ0524	PL0000110615	180 000	178 991	
8,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	61 348	PLN	1	1,34%	WZ0524	PL0000110615	62 000	61 348	
9,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	145 750	PLN	1	3,18%	WZ1126	PL0000113130	150 000	145 750	
10,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	106 169	PLN	1	2,32%	WZ1126	PL0000113130	110 000	106 169	
11,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	144 008	PLN	1	3,14%	WZ1127	PL0000114559	150 000	144 008	
12,	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	114 500	PLN	1	2,50%	WZ1127	PL0000114559	120 000	114 500	
13,	mBank S.A...	SBB	178 816	PLN	8	3,90%	WZ0524	PL0000110615	180 000	178 816	
14,	J.P. Morgan AG	SBB	44 705	PLN	Bez terminu	0,98%	FP270401	PL0000500260	50 000	44 705	
15,	J.P. Morgan AG	SBB	59 007	PLN	Bez terminu	1,29%	FP280301	PL0000500310	75 000	59 007	
16,	J.P. Morgan AG	SBB	67 274	PLN	Bez terminu	1,47%	IZ0823	PL0000105359	50 000	67 274	
17,	J.P. Morgan AG	SBB	70 354	PLN	Bez terminu	1,54%	IZ0823	PL0000105359	54 000	70 354	
17, - pozycja. PODSUMOWANIE						36,33%				1 664 765	

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Inne informacje - ujawniane na 30 czerwca 2022 roku

Pekao Konserwatywny Plus										
1.	Santander Bank Polska S.A. (kontrahent)	SBB	194 365	PLN	8	5,59%	WZ1126	PL0000113130	200 000	194 365
2.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	54 532	PLN	1	1,57%	PF270601	PLPFR0000043	72 000	54 532
3.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	34 503	PLN	1	0,99%	WZ1126	PL0000113130	35 486	34 503
4.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	119 327	PLN	1	3,43%	WZ0524	PL0000110615	120 000	119 327
5.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	194 334	PLN	1	5,58%	WZ1126	PL0000113130	200 000	194 334
6.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	91 691	PLN	1	2,64%	WZ1126	PL0000113130	95 000	91 691
7.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	172 810	PLN	1	4,97%	WZ1127	PL0000114559	180 000	172 810
8.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	157 438	PLN	1	4,52%	WZ1127	PL0000114559	165 000	157 438
9.	mBank S.A...	SBB	119 210	PLN	8	3,43%	WZ0524	PL0000110615	120 000	119 210
10.	J.P. Morgan AG	SBB	89 628	PLN	Bez terminu	2,58%	PF270401	PL0000500260	100 000	89 628
11.	J.P. Morgan AG	SBB	67 274	PLN	Bez terminu	1,93%	IZ0823	PL0000105359	50 000	67 274
12.	J.P. Morgan AG	SBB	65 143	PLN	Bez terminu	1,87%	IZ0823	PL0000105359	50 000	65 143
12. - pozycji. PODSUMOWANIE						39,10%			1 360 255	
Pekao Obligacji Plus										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	23 237	PLN	13	1,36%	FP280301	PL0000500310	32 000	23 237
2.	BNP Paribas	SBB	26 021	PLN	4	1,53%	PS0527	PL0000114393	30 000	26 021
3.	BNP Paribas	SBB	42 867	PLN	5	2,52%	PS0527	PL0000114393	50 000	42 867
4.	BNP Paribas	SBB	18 856	PLN	4	1,11%	PS1026	PL0000113460	25 000	18 856
5.	BNP Paribas	SBB	99 324	PLN	5	5,83%	WZ0524	PL0000110615	100 000	99 324
6.	J.P. Morgan AG	SBB	23 637	PLN	Bez terminu	1,39%	PS1026	PL0000113460	30 000	23 637
6. - pozycji. PODSUMOWANIE						13,74%			233 942	
Pekao Stabilnego Wzrostu										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	8 130	PLN	1	3,12%	DS0727	PL0000109427	9 925	8 130
2.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	19 876	PLN	1	7,63%	WZ0524	PL0000110615	20 000	19 876
2. - pozycji. PODSUMOWANIE						10,75%			28 006	
Pekao Zrównoważony										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	14 002	PLN	1	2,25%	WZ0524	PL0000110615	14 089	14 002
2.	J.P. Morgan AG	SBB	19 929	PLN	Bez terminu	3,20%	DS0727	PL0000109427	20 000	19 929
2. - pozycji. PODSUMOWANIE						5,45%			33 931	

Wskazane w niniejszym zestawieniu kwoty oznaczają wartości w wycenie kontraktów na datę bilansową.

- Zagregowana wartość dla wszystkich subfunduszy dla kontraktów *bsb* 37 097 tys. zł
- Zagregowana wartość dla wszystkich subfunduszy dla kontraktów *sb* 3 444 887 tys. zł

Informacje o metodzie pomiaru całkowitej ekspozycji Funduszu

Towarzystwo, zgodnie z wymogami przepisów (art. 22 Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 2 lipca 2019 r. w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych [Dz.U., poz. 1312]) ujawnia w sprawozdaniu finansowym FIO aktualnie stosowaną metodę pomiaru całkowitej ekspozycji funduszu.

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

W dokumencie 'Inne informacje' dołączanym do rocznego sprawozdania finansowego ujawnia się także wartości ekspozycji, w tym dane wykorzystywane do obliczeń oraz najniższa, najwyższa i przeciętna wartość całkowitej ekspozycji w okresie sprawozdawczym.

Poza zgodnością z przepisami prawa oraz polityką inwestycyjną badana jest także zgodność wewnętrznych limitów – odrębnie dla każdego portfela lokat (funduszu, subfunduszu). Przyjęte metody oraz limity są zgodne z profilem ryzyka inwestycyjnego i polityką inwestycyjną.

lp	Nazwa subfunduszu	Całkowita ekspozycja			
		Metoda zaangażowania [%]			
		Dane za okres 1 półrocza 2022			
		na datę bilan- sową	średnia	minimum	maksimum
1.	Pekao FIO - z wydzielonymi subfunduszami:				
1.1.	Pekao Zrównoważony	23.78	19.99	13.83	25.95
1.2.	Pekao Obligacji Plus	43.93	46.92	31.14	57.46
1.3.	Pekao Konserwatywny	69.81	64.96	57.26	72.90
1.4.	Pekao Stabilnego Wzrostu	41.08	32.84	18.31	41.59
1.5.	Pekao Akcji - Aktywna Selekcja	0.12	0.29	-	0.77
1.6.	Pekao Dynamicznych Spółek	-	0.14	-	0.43
1.7.	Pekao Bazowy 15 Dywidendowy	18.39	22.69	11.64	37.13

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Inne informacje - ujawniane na 30 czerwca 2022 roku

1.8.	Pekao Obligacji - Dynamiczna Alokacja 2	48.70	49.50	32.99	70.51
1.9.	Pekao Konserwatywny Plus	72.37	69.07	55.04	77.81
1.10.	Pekao Megatrendy	0.36	1.08	0.04	6.21

Wskaźnikiem do oceny poziomu ryzyka portfela lokat jest SRRI ('*synthetic risk-reward indicator*' wskaźnika ryzyka i zysku). Wzór określenia wartości SRRI jest określony w przepisach i w szczególności odzwierciedla ryzyko w określonym czasie. Wskaźnik prezentowany jest dla każdego subfunduszu w dokumencie kluczowe informacje dla inwestora (KII) m.in. na stronie www.pekaotfi.pl. W przypadku zmiany stawki SRRI ma miejsce każdorazowo aktualizacja dokumentu KII.

Nazwa subfunduszu		SRRI
1.	Pekao Akcji - Aktywna Selekcja	6
2.	Pekao Bazowy 15 Dywidendowy	3
3.	Pekao Dynamicznych Spółek	6
4.	Pekao Konserwatywny	2
5.	Pekao Konserwatywny Plus	2
6.	Pekao Megatrendy	6
7.	Pekao Obligacji - Dynamiczna Alokacja 2	3
8.	Pekao Obligacji Plus	3
9.	Pekao Stabilnego Wzrostu	4
10.	Pekao Zrównoważony	5

Informacje dot. wynagrodzenia zmiennego za zarządzanie

Subfundusze – inne poza wskazanymi w poniższym zestawieniu - w roku sprawozdawczym nie były obciążane wynagrodzeniem zmiennym. Wynika to bezpośrednio z zapisów Statutu Funduszu.

W wybranych funduszach / subfunduszach w określonych w Statucie Funduszu sytuacjach wypłacane jest 'wynagrodzenie zmienne' uzależnione od wyników subfunduszu należne Towarzystwu. Zasady i kwoty wypłacone zostają omówione w Nocie 11 sprawozdania finansowego (jednostkowego dla wskazanego subfunduszu). Okresowo wynagrodzenie zmienne (zgodnie z uchwałą Zarządu w tej sprawie) może być nienaliczane. Stawki wynagrodzenia zmiennego (obowiązujące w okresie sprawozdawczym oraz na dzień bilansowy) oraz zasady jego ustalania są przedstawione w Nocie 11 sprawozdania jednostkowego.

Wynagrodzenie zmienne w roku sprawozdawczym dotyczyło subfunduszy (było wpisane w Statucie Funduszu):

subfundusz (fundusz)	Kwota w 1. półroczu 2022 [tys. zł]
1. Pekao Bazowy 15 Dywidendowy (Pekao FIO)	0
2. Pekao Megatrendy (Pekao FIO)	0

Dla wskazanych subfunduszy (dla których Statut przewiduje możliwość pobierania wynagrodzenia zmiennego) w roku sprawozdawczym obowiązywała decyzja o czasowym nienaliczaniu tego rodzaju wynagrodzenia.

----- ***** -----