

ANEKS NR 8
DO PROSPEKTU EMISYJNEGO
CERTYFIKATÓW INWESTYCYJNYCH SERII A, B, C, D
PKO STRATEGII OBLIGACYJNYCH
– FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY
zatwierdzonego decyzją Komisji Nadzoru Finansowego
z dnia 29 stycznia 2014 r. (DFI/II/4034/129/14/U/13/14/13-13/AG)



Warszawa, 31.10.2014 r.

PKO Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Puławska 15, 02-515 Warszawa (Towarzystwo), informuje o dokonaniu następujących zmian prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii A, B, C i D PKO Strategii Obligacyjnych – fundusz inwestycyjny zamknięty.

1. Rozdział I. PODSUMOWANIE, B – Emitent i gwarant, pkt B.7., o następującej treści:

„Wybrane najważniejsze historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu w tys. zł., z wyjątkiem liczby zarejestrowanych Certyfikatów oraz WANC i wyniku z operacji na Certyfikatach, podanych w zł.

	18.03.2014-30.06.2014
I. Przychody z lokat	4 044
II. Koszty funduszu netto	3 502
III. Przychody z lokat netto	542
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	2 878
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	1 782
VI. Wynik z operacji	5 202
VII. Zobowiązania	946
VIII. Aktywa	537 858
IX. Aktywa netto	536 912
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	5 307 011
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	101,17
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	0,98

Źródło: Sprawozdanie finansowe Funduszu za okres od 18 marca do 30 czerwca 2014 r. (dane audytowane). Fundusz został zarejestrowany w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych w dniu 18 marca 2014 r.

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	18.03.2014-30.06.2014
I. Przychody z lokat	4 044
II. Koszty Funduszu	3 502
III. Koszty pokrywane przez Towarzystwo	0
IV. Koszty Funduszu netto (II-III)	3 502
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	542
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	4 660
VII. Wynik z operacji (V+/-VI)	5 202

Źródło: Sprawozdanie finansowe Funduszu za okres od 18 marca do 30 czerwca 2014 r. (dane audytowane). Fundusz został zarejestrowany w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych w dniu 18 marca 2014 r.

Dotychczas nie wystąpiły znaczące zmiany w sytuacji finansowej Funduszu.

RACHUNEK PRZEPŁYWÓW PIENIĘŻNYCH	18.03.2014-30.06.2014
Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	-481 494
Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	532 779
Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	-59

Zmiana stanu środków pieniężnych netto	51 285
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	0
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego	51 226

Źródło: Sprawozdanie finansowe Funduszu za okres od 18 marca do 30 czerwca 2014 r. (dane audytowane). Fundusz został zarejestrowany w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych w dniu 18 marca 2014 r.

Od dnia rejestracji Funduszu w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych, Fundusz podejmuje czynności mające na celu dostosowanie struktury portfela inwestycyjnego Funduszu do wymagań określonych w Ustawie o Funduszach Inwestycyjnych oraz Statucie.”

otrzymuje brzmienie:

„Wybrane najważniejsze historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu w tys. zł., z wyjątkiem liczby zarejestrowanych Certyfikatów oraz WANC i wyniku z operacji na Certyfikacie, podanych w zł.

	18.03.2014-30.09.2014
I. Przychody z lokat	7 683
II. Koszty funduszu netto	6 198
III. Przychody z lokat netto	1 485
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	1 879
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	3 498
VI. Wynik z operacji	6 862
VII. Zobowiązania	1 344
VIII. Aktywa	608 566
IX. Aktywa netto	607 222
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	5 983 368
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	101,48
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	1,15

Źródło: Raport kwartalny za III kw. 2014 r. (dane nieaudytowane). Fundusz został zarejestrowany w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych w dniu 18 marca 2014 r.

Dotychczas nie wystąpiły znaczące zmiany w sytuacji finansowej Funduszu.

RACHUNEK PRZEPIŹYWÓW PIENIĘŻNYCH	18.03.2014-30.09.2014
Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	-561 961
Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	601 823
Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	-1
Zmiana stanu środków pieniężnych netto	39 862
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	0
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego	39 861

Źródło: Raport kwartalny za III kw. 2014 r. (dane nieaudytowane). Fundusz został zarejestrowany w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych w dniu 18 marca 2014 r.”

2. Rozdział I. PODSUMOWANIE, B – Emitent i gwarant, pkt B.45., o następującej treści:

„Na dzień 30 czerwca 2014 r. środki pieniężne lub ich ekwiwalenty miały 9,52% udziału w Aktywach Funduszu. Pozostała część Aktywów Funduszu została ulokowana w dłużne Papiery Wartościowe, transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu oraz instrumenty pochodne. Od dnia rejestracji Funduszu w Rejestrze Funduszy Inwestycyjnych, to jest od dnia 18 marca 2014 r., Fundusz podejmuje czynności mające na celu dostosowanie struktury portfela inwestycyjnego Funduszu do wymagań określonych w Ustawie o Funduszach Inwestycyjnych oraz Statucie.”

otrzymuje brzmienie:

„Na dzień 30 września 2014 r. Aktywa Funduszu wynosiły 605.566 tys. zł, na co składały się środki pieniężne i ich ekwiwalenty o wartości 39.891 tys. zł, transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu o wartości 405.561 tys. zł, dłużne Papiery Wartościowe o wartości 162.994 tys. zł oraz składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku o wartości 138 tys. zł.

Z dłużnych Papierów Wartościowych 100.000 tys. zł ulokowane było w polskie obligacje skarbowe o zmiennych kuponie opartym o stawkę 6-cio miesięcznego WIBORu, 11.768 tys. zł ulokowane w obligacje mBanku denominowane w złotym polskim, pozostała kwota ulokowana była w płynnych obligacjach denominowanych w euro i dolarze amerykańskim wyemitowanych przez korporacje z rynków krajów rozwijających lub kraje z regionu Europy Centralno-Wschodniej. Lokaty w dłużne Papiery Wartościowe denominowane w euro i dolarze amerykańskim finansowane były transakcjami wymiany walutowej FX swap.

Zwraca się uwagę, że Fundusz jest zarządzany aktywnie, a skład portfela inwestycyjnego Funduszu może podlegać zmianom, tak, że skład portfela inwestycyjnego Funduszu w dniu przeprowadzania kolejnych emisji Certyfikatów może różnić się od składu portfela inwestycyjnego Funduszu na dzień 30 września 2014 r. opisanego w niniejszym punkcie.

(Dane nieaudytowane).”.

3. Rozdział I. PODSUMOWANIE, B – Emitent i gwarant, pkt B.46., w tabeli dodaje się informacje o następującej treści:

<i>„Dzień Wyceny</i>	<i>WANC</i>
<i>2014-10-27</i>	<i>101,60”</i>

4. Rozdział I. PODSUMOWANIE, C – Emitent i gwarant, pkt C.3., informacja o następującej treści:

„Dotychczas wykupiono 42.355 (czterdzieści dwa tysiące trzysta pięćdziesiąt pięć) Certyfikatów.”

otrzymuje brzmienie:

„Dotychczas wykupiono 227.960 (dwieście dwadzieścia siedem tysięcy dziewięćset sześćdziesiąt) Certyfikatów.”

5. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, na końcu pkt 2.2. dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

6. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, na końcu pkt 2.3. dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

7. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.4., w tabeli dodaje się informacje o następującej treści:

<i>„Dzień Wyceny</i>	<i>WANC</i>
<i>2014-10-27</i>	<i>101,60”</i>

8. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, na końcu pkt 2.5. dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za

okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

9. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, na końcu pkt 2.6. dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

10. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.15., o następującej treści:

„Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 18 marca 2014 roku do dnia 31 marca 2014 roku, raport kwartalny Funduszu od dnia 1 kwietnia 2014 roku do dnia 30 czerwca 2014 oraz podlegające weryfikacji przez biegłego rewidenta sprawozdanie finansowe Funduszu za okres od dnia 18 marca 2014 roku do dnia 30 czerwca 2014 roku zawierające śródroczne informacje finansowe Funduszu zostały włączone do Prospektu przez odesłanie i są dostępne na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

otrzymuje brzmienie:

„Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 18 marca 2014 roku do dnia 31 marca 2014 roku, raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 kwietnia 2014 roku do dnia 30 czerwca 2014, raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku oraz podlegające weryfikacji przez biegłego rewidenta sprawozdanie finansowe Funduszu za okres od dnia 18 marca 2014 roku do dnia 30 czerwca 2014 roku zawierające śródroczne informacje finansowe Funduszu zostały włączone do Prospektu przez odesłanie i są dostępne na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

11. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, w pkt 11.7. przed informacją o kapitalizacji Funduszu dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

12. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 11.7., w tabeli dodaje się informacje o następującej treści:

„Informacje o kapitalizacji Funduszu.

Kapitalizacja Funduszu na dzień	Kapitał wpłacony	Kapitał wypłacony
2014-10-27	604.645.106,76 zł	23.120.250,75 zł”

13. Rozdział VI. DANE O EMISJI, pkt 2.1., dodaje się informacje o następującej treści:

„Na dzień 27 października 2014 r. Wartość Aktywów Netto Funduszu wynosiła 589.048.046,83 zł.”

14. Rozdział VI. DANE O EMISJI, w pkt 2.2. przed informacją o kapitalizacji Funduszu dodaje się akapit następującej treści:

„Historyczne informacje finansowe dotyczące Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku zostały włączone do Prospektu przez odesłanie do raportu kwartalnego Funduszu za okres od dnia 1 lipca 2014 roku do dnia 30 września 2014 roku, który został udostępniony na stronie internetowej: www.pkotfi.pl.”

15. Rozdział VI. DANE O EMISJI, pkt 2.2., w tabeli dodaje się informacje o następującej treści:

„Informacje o kapitalizacji Funduszu.

Kapitalizacja Funduszu na dzień	Kapitał wpłacony	Kapitał wypłacony
2014-10-27	604.645.106,76 zł	23.120.250,75 zł”

16. Rozdział VI. DANE O EMISJI, pkt 7.2., akapit pierwszy o następującej treści:

„Łączne szacunkowe koszty emisji Certyfikatów serii C przy minimalnej wielkości emisji równej 10.000.000 (dziesięć milionów) zł kształtują się na szacunkowym poziomie około 200.000 (dwieście tysięcy) zł W przypadku maksymalnej wielkości emisji równej 1.000.000.000 (jeden miliard) zł mogą szacunkowo wynieść około 700.000 (siedemset tysięcy) zł.”

otrzymuje brzmienie:

„Łączne szacunkowe koszty emisji Certyfikatów serii D przy minimalnej wielkości emisji równej 10.000.000 (dziesięć milionów) zł kształtują się na szacunkowym poziomie około 200.000 (dwieście tysięcy) zł W przypadku maksymalnej wielkości emisji równej 1.000.000.000 (jeden miliard) zł mogą szacunkowo wynieść około 700.000 (siedemset tysięcy) zł.”

INFORMACJA O PRAWIE DO UCHYLENIA SIĘ OD SKUTKÓW PRAWNYCH ZŁOŻONYCH ZAPISÓW

Zgodnie z art. 51a ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o ofercie publicznej i warunkach wprowadzania instrumentów finansowych do zorganizowanego systemu obrotu oraz o spółkach publicznych (Dz. U. z 2013 poz. 1382), w związku z udostępnieniem niniejszego Aneksu nr 8 do prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii A, B, C i D PKO Strategii Obligacyjnych – fundusz inwestycyjny zamknięty osoby, które złożyły zapisy na certyfikaty inwestycyjne serii D funduszu przed udostępnieniem tego aneksu, mogą uchylić się od skutków prawnych złożonych zapisów. Uchylenie się od skutków prawnych złożonych zapisów następuje przez oświadczenie złożone na piśmie w terminie dwóch dni roboczych od dnia udostępnienia niniejszego aneksu, tj. do dnia 12 listopada 2014 r.