



Warszawa, 22 sierpnia 2017 r.

PKO Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Chłodna 52, 00-872 Warszawa, informuje o dokonaniu następujących zmian prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii E - J PKO Absolutnej Stopy Zwrotu Europa Wschód - Zachód - fundusz inwestycyjny zamknięty.

1. Rozdział VI. DANE O EMISJI, w pkt 9 w części zatytułowanej „*Na podstawie art. 14 ust. 1 i 2 rozporządzenia 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 (Dz.Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015) przekazuje się Inwestorom i Uczestnikom następujące informacje*”:
 - a) w ust. 3 pkt 2) o treści:

„2) Maksymalny odsetek zarządzanych aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji.
Maksymalny odsetek Aktywów Funduszu, które mogą być przedmiotem TFUPW wynosi 300% wartości Aktywów Funduszu.”

otrzymuje brzmienie:

„2) Maksymalny odsetek zarządzanych aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji.
Maksymalny odsetek Aktywów Funduszu, które mogą być przedmiotem TFUPW wynosi 400% wartości Aktywów Funduszu.”;
 - b) w ust. 3 pkt 3) o treści:

„3) Szacowany odsetek zarządzanych aktywów, które będą przedmiotem poszczególnych rodzajów tych transakcji.
Towarzystwo szacuje, że przedmiotem TFUPW dokonywanych przez Fundusz może być od 20 do 50% wartości Aktywów Funduszu.”

otrzymuje brzmienie:

„3) Szacowany odsetek zarządzanych aktywów, które będą przedmiotem poszczególnych rodzajów tych transakcji.
Towarzystwo szacuje, że:

 - a. przedmiotem transakcji takich jak udzielanie lub zaciąganie pożyczek papierów wartościowych może być do 50% wartości Aktywów Netto Funduszu,
 - b. przedmiotem transakcji typu buy-sell back i sell-buy back będzie do 400% wartości Aktywów Netto Funduszu,
 - c. przedmiotem transakcji typu repo i reverse repo będzie do 400% wartości Aktywów Netto Funduszu.”;
 - c) w ust. 4 akapit drugi o treści:

„Kontrahentami Funduszu w transakcjach TFUPW będą podmioty z siedzibą w krajach należących do OECD, w Państwach Członkowskich nie należących do OECD, w Rzeczypospolitej Polskiej oraz w Rosji.”

otrzymuje brzmienie:

„Kontrahentami Funduszu w transakcjach TFUPW będą podmioty z siedzibą w Rzeczypospolitej Polskiej, innym Państwie Członkowskim oraz w państwach należących do OECD innych niż Rzeczypospolita Polska i Państwo Członkowskie.”;

d) w ust. 5 akapit pierwszy o treści:

„Akceptowanym zabezpieczeniem TFUPW mogą być środki pieniężne, dłużne Papiery Wartościowe, w szczególności dłużne Papiery Wartościowe emitowane przez Skarb Państwa lub NBP oraz akcje emitentów z siedzibą w krajach należących do OECD, w Państwach Członkowskich nie należących do OECD, w Rzeczypospolitej Polskiej oraz w Rosji.”

otrzymuje brzmienie:

„Akceptowalnym zabezpieczeniem TFUPW mogą być środki pieniężne, dłużne Papiery Wartościowe, w szczególności dłużne Papiery Wartościowe emitowane przez Skarb Państwa lub NBP oraz akcje emitentów z siedzibą w Rzeczypospolitej Polskiej, innym Państwie Członkowskim, w państwach należących do OECD innych niż Rzeczypospolita Polska i Państwo Członkowskie.”

e) w ust. 7 pkt 8) o treści:

„8) ryzyko stosowania dźwigni finansowej – ponowne wykorzystanie Papierów Wartościowych przyjętych jako zabezpieczenie transakcji powoduje zwiększenie dźwigni finansowej, mechanizm dźwigni finansowej powoduje zwielokrotnienie zysków albo strat z transakcji.”

otrzymuje brzmienie:

„8) ryzyko stosowania dźwigni finansowej – ponowne wykorzystanie Papierów Wartościowych przyjętych jako zabezpieczenie transakcji powoduje zwiększenie Dźwigni Finansowej AFI, mechanizm Dźwigni Finansowej AFI powoduje zwielokrotnienie zysków albo strat z transakcji.”

2. W załączniku Definicje i skróty dodaje się definicje Rozporządzenia SFTR o następującej treści:

„Rozporządzenie 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 (Dz.Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015).”

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 2016, poz. 1639 z późn. zm.), w związku z udostępnieniem niniejszego Aneksu nr 1 do prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii E, F, G, H, I i J PKO Absolutnej Stopy Zwrotu Europa Wschód - Zachód - fundusz inwestycyjny zamknięty osoby, które złożyły zapisy na certyfikaty inwestycyjne serii E 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 24 sierpnia 2017 r.