

OGŁOSZENIE O ZMIANIE W TREŚCI STATUTU (NR 10/2023)

Data zmian: 25 sierpnia 2023 r.

Dotyczy:

PKO Parasolowy – fundusz inwestycyjny otwarty



PKO Parasolowy – fundusz inwestycyjny otwarty informuje o następujących zmianach w treści statutu:

1. artykuły 399 i 400 otrzymują następujące brzmienie:

„Artykuł 399 Polityka inwestycyjna Subfunduszu

1. Subfundusz jest klasyfikowany jako tzw. light green, zgodnie z art. 8 Rozporządzenia SFDR. Subfundusz w ramach stosowanej polityki inwestycyjnej promuje aspekty środowiskowe lub społeczne poprzez lokowanie aktywów głównie w Instrumenty Dłużne służące finansowaniu zrównoważonego rozwoju. Podczas doboru tego typu instrumentów w szczególności pod uwagę brany jest sposób wykorzystywania środków pozyskanych przez podmioty w ramach ich emisji. Aktywa Subfunduszu lokowane są także w instrumenty finansowe kwalifikowane jako zrównoważone inwestycje, w rozumieniu art. 2 pkt 17 Rozporządzenia SFDR.

2. Podstawowymi rodzajami lokat Subfunduszu są:

a) Instrumenty Dłużne, w szczególności będące przedmiotem oferty publicznej lub dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub państwie członkowskim oraz będące przedmiotem obrotu na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub innym państwie członkowskim lub na Innych Rynkach Zorganizowanych, w tym w Instrumenty Dłużne służące finansowaniu zrównoważonego rozwoju, emitowane przez podmioty, które przeznaczają pozyskany w ten sposób kapitał na inwestycje związane z działalnością proekologiczną lub społeczną;

b) jednostki uczestnictwa innych funduszy inwestycyjnych otwartych mających siedzibę na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej, tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne (w rozumieniu Ustawy) oraz tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające kryteria określone w Ustawie, jeżeli, zgodnie ze statutem lub innym właściwym dokumentem, realizują one swój cel inwestycyjny poprzez lokowanie w kategorii lokat, o których mowa w lit. a), głównie w obligacje skarbowe i korporacyjne.

3. Proporcja pomiędzy poszczególnymi rodzajami lokat będzie uzależniona od decyzji Towarzystwa popartych analizami oraz danymi otrzymanymi ze źródeł zewnętrznych, z uwzględnieniem zasad dywersyfikacji lokat oraz innych ograniczeń inwestycyjnych określonych w Ustawie, przy czym całkowita wartość inwestycji Subfunduszu w kategorii lokat, o których mowa w ust. 1 i 2 oraz depozyty o terminie zapadalności dłuższym niż 7 dni, z wyłączeniem papierów wartościowych będących przedmiotem transakcji buy/sell back, sell/buy back, repo oraz reverse-repo, nie może być niższa niż 60% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu. Pozostała część Aktywów Subfunduszu może być lokowana w kategorii lokat, o których mowa w art. 401 Statutu.

4. Przedmiot lokat Subfunduszu, o których mowa w ust. 1 i 2, podlega wewnętrznej klasyfikacji ze względu na promowane przez Subfundusz aspekty środowiskowe lub społeczne oraz ze względu na wypełnianie wymogów zrównoważonych inwestycji, w rozumieniu art. 2 pkt 17 Rozporządzenia SFDR. Udział lokat - z wyłączeniem papierów wartościowych będących przedmiotem transakcji buy/sell back, sell/buy back, repo oraz reverse-repo, które:

a) przyczyniają się do promowania aspektów środowiskowych lub społecznych wynosi nie mniej niż 50% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu,

b) spełniają wymogi zrównoważonych inwestycji w rozumieniu art. 2 pkt 17 Rozporządzenia SFDR wynosi nie mniej niż 40% Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.

5. Fundusz może zawierać na rzecz Subfunduszu umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne będące przedmiotem obrotu na rynku regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub państwie członkowskim, na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub innym państwie członkowskim, lub na Innych Rynkach Zorganizowanych, a także niewystandaryzowane instrumenty pochodne.

Artykuł 400 Kryteria doboru lokat Subfunduszu

Podstawowym kryterium doboru lokat jest analiza ryzyka stopy procentowej. Ponadto, przy dokonywaniu inwestycji w poszczególne rodzaje lokat brane są pod uwagę następujące kryteria:

1. w odniesieniu do lokat w Instrumenty Dłużne służące finansowaniu zrównoważonego rozwoju:

- oznaczenie emisji jako służącej finansowaniu zrównoważonego rozwoju przez emitenta,
- ocena podmiotów trzecich, co do wypełniania przez daną emisję warunków, jakie powinny spełniać Instrumenty Dłużne służące finansowaniu zrównoważonego rozwoju,
- sposób i przeznaczenie wydatkowania środków pozyskanych w ramach emisji,
- ocena przestrzegania przez emitenta wytycznych zamieszczonych w Zasadach Zielonych Obligacji (Green Bond Principles – GBP) stworzonych przez Międzynarodowe Stowarzyszenie Rynku Kapitałowego (International Capital Market Association – ICMA),
- ocena perspektyw rozwoju emitenta,

- f) poziom ryzyka inwestycyjnego,
- g) poziom ryzyka walutowego, w przypadku lokat na rynkach zagranicznych,
- h) płynność Aktywów Subfunduszu,
- i) poziom ryzyka niewypłacalności emitenta, poziom ryzyka spadku wartości lokaty w szczególności w efekcie oceny bieżącego i prognozowanego poziomu stóp procentowych i inflacji;

2. w odniesieniu do lokat w pozostałe Instrumenty Dłużne:

- a) ocena perspektyw rozwoju emitenta,
- b) poziom ryzyka inwestycyjnego,
- c) poziom ryzyka walutowego, w przypadku lokat na rynkach zagranicznych,
- d) płynność Aktywów Subfunduszu,
- e) poziom ryzyka niewypłacalności emitenta,
- f) poziom ryzyka spadku wartości lokaty w szczególności w efekcie oceny bieżącego i prognozowanego poziomu stóp procentowych i inflacji;

3. w odniesieniu do lokat w jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych mających siedzibę na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej, a także w tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne oraz instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą:

- a) zbieżność prowadzonej przez dany podmiot polityki inwestycyjnej ze strategią inwestycyjną Subfunduszu,
- b) poziom ryzyka inwestycyjnego,
- c) poziom ryzyka walutowego, w przypadku lokat na rynkach zagranicznych,
- d) płynność Aktywów Subfunduszu,
- e) poziom kosztów obciążających uczestników danego podmiotu,
- f) poziom kosztów obciążających aktywa danego podmiotu;

4. w odniesieniu do lokat w depozyty:

- a) ocena kondycji finansowej banku lub instytucji kredytowej zgodnie z przyjętą metodologią przyznawania limitów,
- b) posiadanie przez bank lub instytucję kredytową w dniu zawarcia lokaty bankowej ratingu na poziomie inwestycyjnym nadanym przez przynajmniej jedną uznaną międzynarodową agencję ratingową,
- c) stopa oprocentowania oraz okres zawarcia umowy depozytu."

Zmiany statutu Funduszu, o których mowa powyżej, wchodzą w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ich ogłoszenia