

**Informacja o zmianach w treści prospektów informacyjnych funduszy inwestycyjnych
zarządzanych przez PKO Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.
dokonanych w dniu 28 kwietnia 2024 r.**

I. GAMMA PARASOL BIZNES – SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY INFORMUJE O NASTĘPUJĄCYCH ZMIANACH W TREŚCI PROSPEKTU INFORMACYJNEGO:

1. na stronie tytułowej datę „15 kwietnia 2024 r.” zastępuje się datą „28 kwietnia 2024 r.”,
2. w rozdziale III ust. 18. pkt 18.3. otrzymuje brzmienie:

„Od dnia 28 kwietnia 2024 roku wzorcem (benchmarkiem) stanowiącym odniesienie dla oceny realizacji celu inwestycyjnego Subfunduszu, a w szczególności uzyskanej stopy zwrotu z inwestycji jest średnia ważona procentowej zmiany indeksu GPWB-BWZ z wagą 80% oraz procentowej zmiany indeksu GPWB-B1Y3Y z wagą 20%, powiększona o 0,45% w skali roku, gdzie:

- o GPWB-B1Y3Y oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN i uwzględniający przepływy z tytułu kuponów dochodowy indeks odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o terminie zapadalności większym niż rok oraz mniejszym niż 3 lata (Bloomberg Ticker: GPWB1Y3Y),*
- o GPWB-BWZ oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o zmiennym oprocentowaniu i terminie zapadalności powyżej 6 miesięcy (Bloomberg Ticker: GPWB-BWZ).*

Od dnia 21 stycznia 2019 roku do dnia 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca (benchmarku) służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu.

Od dnia 2 listopada 2016 roku do dnia 20 stycznia 2019 roku wzorcem (benchmarkiem) stanowiącym odniesienie dla oceny realizacji celu inwestycyjnego Subfunduszu, a w szczególności uzyskanej stopy zwrotu z inwestycji była stopa zwrotu z indeksu WIBID3M powiększona o 0,25% w skali roku i pomniejszona o przypadające na dany okres koszty stałe Subfunduszu (w tym opłata za zarządzanie Subfunduszem).

Do dnia 1 listopada 2016 roku wzorcem (benchmarkiem) stanowiącym odniesienie dla oceny realizacji celu inwestycyjnego Subfunduszu, a w szczególności uzyskanej stopy zwrotu z inwestycji była stopa zwrotu z indeksu WIBID3M pomniejszona o przypadające na dany okres koszty stałe Funduszu (w tym opłata za zarządzanie Funduszem).”

3. w rozdziale III ust. 18.4. otrzymuje brzmienie:

„Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od dnia 28 kwietnia 2024 roku.”

II. PKO PARASOŁOWY – FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY INFORMUJE O NASTĘPUJĄCYCH ZMIANACH W TREŚCI PROSPEKTU INFORMACYJNEGO:

1. na stronie tytułowej w pkt 5. datę „15 kwietnia 2024 r.” zastępuje się datą „28 kwietnia 2024 r.”,
2. w rozdziale III podrozdziale IIIu ust. 6. pkt 6.3. -6.3.5. otrzymują brzmienie:

”6.3.4. od dnia 21 stycznia 2019 roku do dnia 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa,

6.3.5. od dnia 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu GPWB-BWZ z wagą 60% oraz procentowej zmiany indeksu GPWB-B1Y3Y z wagą 40%, gdzie:

- GPWB-B1Y3Y oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN i uwzględniający przepływy z tytułu kuponów dochodowy indeks odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o terminie zapadalności większym niż rok oraz mniejszym niż 3 lata (Bloomberg Ticker: GPWB1Y3Y),*
- GPWB-BWZ oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o zmiennym oprocentowaniu i terminie zapadalności powyżej 6 miesięcy (Bloomberg Ticker: GPWB-BWZ).”*

3. w rozdziale III podrozdziale IIIu ust. 6. pkt 6.4. otrzymuje brzmienie:

„6.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 6.2.

Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od dnia 28 kwietnia 2024 roku.”

4. w rozdziale III podrozdziale IIIac ust. 6. pkt. 6.3. ppkt 6.3.1.-6.3.2. otrzymują brzmienie:

„6.3.1. do dnia 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa,

6.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu GPWB-BWZ z wagą 80% oraz procentowej zmiany indeksu GPWB-B1Y3Y z wagą 20%, powiększoną o 0,45% w skali roku, gdzie:

- GPWB-B1Y3Y oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN i uwzględniający przepływy z tytułu kuponów dochodowy indeks odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o terminie zapadalności większym niż rok oraz mniejszym niż 3 lata (Bloomberg Ticker: GPWB1Y3Y),
- GPWB-BWZ oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o zmiennym oprocentowaniu i terminie zapadalności powyżej 6 miesięcy (Bloomberg Ticker: GPWB-BWZ).”

5. w rozdziale III podrozdziale IIIac ust. 6. pkt. 6.4. otrzymuje brzmienie:

„6.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 6.2.

Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od dnia 28 kwietnia 2024 roku”

III. PKO PORTEFELE INWESTYCYJNE – SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY INFORMUJE O NASTĘPUJĄCYCH ZMIANACH W TREŚCI PROSPEKTU INFORMACYJNEGO:

1. na stronie tytułowej datę „15 kwietnia 2024 r.” zastępuje się datą „ 28 kwietnia 2024 r.”,
2. w rozdziale IV podrozdziale IV A ust. 5. dodaje się pkt 5.3., zmieniając tym samym numerację pkt 5.3.-5.4. odpowiednio na 5.4.-5.5., nadając pkt 5.3. i 5.4. następujące brzmienie:

„5.3. Za wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa związane z Subfunduszem, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany również benchmarkiem:

5.3.1. do 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa;

5.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu ICE BofA Poland Government Index z wagą 95%, procentowej zmiany indeksu MSCI World USD z wagą 3% oraz procentowej zmiany indeksu WIG20TR z wagą 2%, gdzie:

- ICE BofA Poland Government Index oznacza kalkulowany przez firmę ICE Data Indices LLC liczony w PLN i uwzględniający przepływy z tytułu kuponów indeks odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych (Bloomberg Ticker: GOPL Index),

- WIG20TR oznacza liczony w PLN dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dwudziestu największych spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie (Bloomberg Ticker: WIG20TR Index),

- MSCI World USD oznacza kalkulowany przez firmę MSCI Inc. i liczony w USD dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynkach rozwiniętych (Bloomberg Ticker: M1WO Index).

5.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 5.2.

Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od 28 kwietnia 2024 roku.”

3. w rozdziale IV podrozdziale IV B ust. 5. dodaje się pkt 5.3., zmieniając tym samym numerację pkt 5.3.-5.4. odpowiednio na 5.4.-5.5., nadając pkt 5.3. i 5.4. następujące brzmienie:

- „5.3. Za wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa związane z Subfunduszem, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany również benchmarkiem:
- 5.3.1. do 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa;
- 5.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu GPWB-B1Y4Y z wagą 80%, procentowej zmiany indeksu MSCI World USD z wagą 13% oraz procentowej zmiany indeksu WIG30TR z wagą 7%, gdzie:
- GPWB-B1Y4Y oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o stałym oprocentowaniu oraz obligacji zerokuponowych i terminie zapadalności większym niż rok oraz mniejszym niż 4 lata (Bloomberg Ticker: GPWB1Y4Y Index),
 - MSCI World USD oznacza kalkulowany przez firmę MSCI Inc. i liczony w USD dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynkach rozwiniętych (Bloomberg Ticker: M1WO Index),
 - WIG30TR oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji trzydziestu największych spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie (Bloomberg Ticker: WIG30TR Index);
- 5.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 5.2.
- Nie dotyczy – Subfunduszu stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od 28 kwietnia 2024 roku.”

4. w rozdziale IV podrozdziale IV C ust. 5. dodaje się pkt 5.3., zmieniając tym samym numerację pkt 5.3.-5.4. odpowiednio na 5.4.-5.5., nadając pkt 5.3. i 5.4. następujące brzmienie:

- „5.3. Za wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa związane z Subfunduszem, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany również benchmarkiem:
- 5.3.1. do 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa;
- 5.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu Treasury BondSpot Poland Index z wagą 65%, procentowej zmiany indeksu MSCI World USD z wagą 25% oraz procentowej zmiany indeksu WIG30TR z wagą 10%, gdzie:
- Treasury BondSpot Poland Index oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o stałym oprocentowaniu oraz obligacji zerokuponowych (Bloomberg Ticker: TBSP Index),
 - MSCI World USD oznacza kalkulowany przez firmę MSCI Inc. i liczony w USD dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynkach rozwiniętych (Bloomberg Ticker: M1WO Index),
 - WIG30TR oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji trzydziestu największych spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie (Bloomberg Ticker: WIG30TR Index);
- 5.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 5.2.
- Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od 28 kwietnia 2024 roku.”

5. w rozdziale IV podrozdziale IV D ust. 5. dodaje się pkt 5.3., zmieniając tym samym numerację pkt 5.3.-5.4. odpowiednio na 5.4.-5.5., nadając pkt 5.3. i 5.4. następujące brzmienie:

- „5.3. Za wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa związane z Subfunduszem, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany również benchmarkiem:
- 5.3.1. do 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa;
- 5.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu Treasury BondSpot Poland Index z wagą 45%, procentowej zmiany indeksu MSCI World USD z wagą 35% oraz procentowej zmiany indeksu WIG30TR z wagą 20%, gdzie:
- Treasury BondSpot Poland Index oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o stałym oprocentowaniu oraz obligacji zerokuponowych (Bloomberg Ticker: TBSP Index),

- MSCI World USD oznacza kalkulowany przez firmę MSCI Inc. i liczony w USD dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynkach rozwiniętych (Bloomberg Ticker: M1WO Index),
 - WIG30TR oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji trzydziestu największych spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie (Bloomberg Ticker: WIG30TR Index);"
6. w rozdziale IV podrozdziale IV E ust. 5. dodaje się pkt 5.3., zmieniając tym samym numerację pkt 5.3.-5.4. odpowiednio na 5.4.-5.5., nadając pkt 5.3. i 5.4. następujące brzmienie:
- 5.3. Za wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa związane z Subfunduszem, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną Subfunduszu, zwany również benchmarkiem:
- 5.3.1. do 27 kwietnia 2024 roku Subfundusz nie stosował wzorca służącego do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa;
- 5.3.2. od 28 kwietnia 2024 roku przyjmuje się średnią ważoną procentowej zmiany indeksu Treasury BondSpot Poland Index z wagą 20%, procentowej zmiany indeksu MSCI World USD z wagą 55% oraz procentowej zmiany indeksu WIG30TR z wagą 25%, gdzie:
- Treasury BondSpot Poland Index oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks uwzględniający przepływy z tytułu kuponów i odzwierciedlający zachowanie rynku polskich obligacji skarbowych o stałym oprocentowaniu oraz obligacji zerokuponowych (Bloomberg Ticker: TBSP Index),
 - MSCI World USD oznacza kalkulowany przez firmę MSCI Inc. i liczony w USD dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji dużych i średnich spółek notowanych na rynkach rozwiniętych (Bloomberg Ticker: M1WO Index),
 - WIG30TR oznacza kalkulowany przez GPW Benchmark S.A. i liczony w PLN dochodowy indeks odzwierciedlający zmianę cen akcji trzydziestu największych spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie (Bloomberg Ticker: WIG30TR Index);
- 5.4. Średnia stopa zwrotu z benchmarku odpowiednio dla okresów, o których mowa w pkt 5.2.
- Nie dotyczy – Subfundusz stosuje wzorzec służący do oceny efektywności inwestycji w Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu, odzwierciedlający zachowanie się zmiennych rynkowych najlepiej oddających cel i politykę inwestycyjną od 28 kwietnia 2024 roku."