



14.08.2017 r.

Komunikat TFI PZU SA w sprawie zmiany statutu **PZU Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Globalnych Inwestycji**

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych PZU Spółka Akcyjna, działając na podstawie art. 24 ust. 5 ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi ogłasza o następujących zmianach statutu PZU SFIO Globalnych Inwestycji:

I. W rozdziale I – Postanowienia ogólne:

1. w art. 5:

1) po pkt 4 dodaje się pkt 4a w brzmieniu:

„4a)) CCP

– oznacza to podmiot, o którym mowa w art. 2 pkt 1 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (Dz. Urz. UE L201 z 27.07.2012, str. 1, z późn. zm.), prowadzący działalność na podstawie zezwolenia, o którym mowa w art. 14 tego rozporządzenia, albo uznany przez Europejski Organ Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych na podstawie art. 25 tego rozporządzenia,”.

2) pkt 15b otrzymuje poniższe brzmienie i po pkt 15b dodaje się pkt 15c w poniższym brzmieniu:

„15b) Rozporządzeniu

– oznacza to rozporządzenie wydane przez właściwego ministra na podstawie delegacji określonej w art. 116 d Ustawy dotyczące zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne,

15c) Rozporządzeniu w sprawie instrumentów pochodnych lub Rozporządzeniu

– oznacza to rozporządzenie wydane przez właściwego ministra na podstawie delegacji określonej w art. 116 d Ustawy dotyczące zawierania przez specjalistyczny fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne,”.

2. w art. 6 skreśla się ust. 2a.

II. W rozdziale V – PZU Akcji Rynków Rozwiniętych:

1. w art. 29:

1) w ust. 10 pkt 3 otrzymuje brzmienie:

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych PZU Spółka Akcyjna, Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy, KRS 19102, NIP 527-22-28-027, kapitał zakładowy: 13 000 000 zł wpłacony w całości, al. Jana Pawła II 24, 00-133 Warszawa, pzu.pl, infolinia: 801 102 102

„3) bazę instrumentów pochodnych, w tym niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych, stanowią instrumenty finansowe, o których mowa w ust. 3 pkt 1-4, stopy procentowe, kursy walut lub indeksy, o których mowa w Rozporządzeniu w sprawie instrumentów pochodnych, oraz”.

2) po ust. 15 dodaje się ust. 16 -18 w brzmieniu:

„16. Umowy, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne mogą być zawierane wyłącznie gdy:

- 1) stroną transakcji jest:*
 - a) bank krajowy,*
 - b) Instytucja Kredytowa,*
 - c) bank zagraniczny,*
 - d) inny niż wskazany w lit a)-c) kontrahent podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym w państwie, w którym ma swoją siedzibę;*
- 2) instrumenty te mogą zostać w dowolnym czasie sprzedane przez Subfundusz lub pozycja w nich zajęta może być w dowolnym czasie zlikwidowana lub zamknięta transakcją równoważącą.*

17. Fundusz zawierając na rzecz Subfunduszu transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne ustala wartość ryzyka kontrahenta zgodnie z przepisami Rozporządzenia.

18. Wartość ryzyka danego kontrahenta w odniesieniu do wszystkich transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawartych z tym kontrahentem, nie może przekroczyć :

- 1) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku transakcji rozliczanych przez CCP,*
- 2) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku gdy kontrahentem jest instytucja kredytowa, bank krajowy lub bank zagraniczny,*
- 3) 5% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadkach innych niż wskazane w pkt. 1 i 2. ”.*

2. w art. 30 po ust. 11 dodaje się ust. 11.a i 11.b w brzmieniu:

„11.a Maksymalne zaangażowanie Subfunduszu w instrumenty pochodne wyznacza się w każdym dniu roboczym, co najmniej raz dziennie z zastosowaniem metody określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013.

11.b Wartość maksymalnego zaangażowania Subfunduszu w instrumenty pochodne nie może w żadnym momencie przekroczyć maksymalnego limitu ekspozycji AFI określonego w przepisach wydanych na podstawie art. 48c ust. 3 Ustawy pomniejszonego o inne pozycje wpływające zgodnie z Ustawą na zwiększenie tej ekspozycji. ”.

III. W rozdziale VI – PZU Akcji Rynków Wschodzących:

1. w art. 37:

1) w ust. 10 pkt 3 otrzymuje brzmienie:

„3) bazę instrumentów pochodnych, w tym niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych, stanowią instrumenty finansowe, o których mowa w ust. 3 pkt 1-4, stopy procentowe, kursy walut lub indeksy, o których mowa w Rozporządzeniu w sprawie instrumentów pochodnych, oraz”.

2) po ust. 15 dodaje się ust. 16 -18 w brzmieniu:

„16. Umowy, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne mogą być zawierane wyłącznie gdy:

- 1) stroną transakcji jest:*
 - a) bank krajowy,*
 - b) Instytucja Kredytowa,*

- c) bank zagraniczny,
 - d) inny niż wskazany w lit a)-c) kontrahent podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym w państwie, w którym ma swoją siedzibę;
- 2) instrumenty te mogą zostać w dowolnym czasie sprzedane przez Subfundusz lub pozycja w nich zajęta może być w dowolnym czasie zlikwidowana lub zamknięta transakcją równoważącą.

17. Fundusz zawierając na rzecz Subfunduszu transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne ustala wartość ryzyka kontrahenta zgodnie z przepisami Rozporządzenia.

18. Wartość ryzyka danego kontrahenta w odniesieniu do wszystkich transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawartych z tym kontrahentem, nie może przekroczyć :

- 1) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku transakcji rozliczanych przez CCP,
- 2) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku gdy kontrahentem jest instytucja kredytowa, bank krajowy lub bank zagraniczny,
- 3) 5% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadkach innych niż wskazane w pkt. 1 i 2. ”.

2. w art. 38 po ust. 11 dodaje się ust. 11.a i 11.b w brzmieniu:

„11.a Maksymalne zaangażowanie Subfunduszu w instrumenty pochodne wyznacza się w każdym dniu roboczym, co najmniej raz dziennie z zastosowaniem metody określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013.

11.b Wartość maksymalnego zaangażowania Subfunduszu w instrumenty pochodne nie może w żadnym momencie przekroczyć maksymalnego limitu ekspozycji AFI określonego w przepisach wydanych na podstawie art. 48c ust. 3 Ustawy pomniejszonego o inne pozycje wpływające zgodnie z Ustawą na zwiększenie tej ekspozycji.”.

IV. W rozdziale VII – PZU Akcji Spółek Dywidendowych:

1. w art. 45:

1) w ust. 8 pkt 3 otrzymuje brzmienie:

„3) bazę instrumentów pochodnych, w tym niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych, stanowią instrumenty finansowe, o których mowa w ust. 3 pkt 1-4, stopy procentowe, kursy walut lub indeksy, o których mowa w Rozporządzeniu w sprawie instrumentów pochodnych, oraz”.

2) po ust. 13 dodaje się ust. 14 -16 w brzmieniu:

„14. Umowy, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne mogą być zawierane wyłącznie gdy:

1) stroną transakcji jest:

- a) bank krajowy,
- b) Instytucja Kredytowa,
- c) bank zagraniczny,
- d) inny niż wskazany w lit a)-c) kontrahent podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym lub kapitałowym w państwie, w którym ma swoją siedzibę;

2) instrumenty te mogą zostać w dowolnym czasie sprzedane przez Subfundusz lub pozycja w nich zajęta może być w dowolnym czasie zlikwidowana lub zamknięta transakcją równoważącą.

17. Fundusz zawierając na rzecz Subfunduszu transakcje, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne ustala wartość ryzyka kontrahenta zgodnie z przepisami Rozporządzenia.

18. Wartość ryzyka danego kontrahenta w odniesieniu do wszystkich transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawartych z tym kontrahentem, nie może przekroczyć :

- 1) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku transakcji rozliczanych przez CCP,

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych PZU Spółka Akcyjna, Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy, KRS 19102, NIP 527-22-28-027, kapitał zakładowy: 13 000 000 zł wpłacony w całości, al. Jana Pawła II 24, 00-133 Warszawa, pzu.pl, infolinia: 801 102 102

- 2) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku gdy kontrahentem jest instytucja kredytowa, bank krajowy lub bank zagraniczny,
- 3) 5% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadkach innych niż wskazane w pkt. 1 i 2. ”.

2. w art. 46 po ust. 11 dodaje się ust. 11.a i 11.b w brzmieniu:

„11.a Maksymalne zaangażowanie Subfunduszu w instrumenty pochodne wyznacza się w każdym dniu roboczym, co najmniej raz dziennie z zastosowaniem metody określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013.

11.b Wartość maksymalnego zaangażowania Subfunduszu w instrumenty pochodne nie może w żadnym momencie przekroczyć maksymalnego limitu ekspozycji AFI określonego w przepisach wydanych na podstawie art. 48c ust. 3 Ustawy pomniejszonego o inne pozycje wpływające zgodnie z Ustawą na zwiększenie tej ekspozycji.”.

V. W rozdziale VIII – PZU Dłużny Rynków Wschodzących:

1. w art. 53:

- 1) zdanie wprowadzające w ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. „Z zastrzeżeniem ograniczeń wynikających z Ustawy, Statutu oraz Rozporządzenia Aktywa Subfunduszu mogą być lokowane w:”.

- 2) po ust. 7 dodaje się ust. 7.a w brzmieniu:

„7.a Fundusz dokonuje na rzecz Subfunduszu lokat w instrumenty pochodne z uwzględnieniem zasad wynikających z Rozporządzenia.”.

- 3) w ust. 9 pkt 1 otrzymuje brzmienie:

„1) transakcje te zostały zawarte na podstawie umowy ramowej spełniającej kryteria określone w art. 85 ustawy z dnia 28 lutego 2003 r. Prawo upadłościowe (tj. Dz. U. z 2016 r., poz.2171, 2260, i 2261 oraz z 2017 r., poz. 791),”.

- 4) Akapit zamieszczony pod pkt 4 w ust. 9 oznacza się jako ust. 10 i ust. ten otrzymuje brzmienie:

„10. Dłużne papiery wartościowe lub instrumenty rynku pieniężnego mogą stanowić zabezpieczenie w związku z transakcjami, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne jeśli spełniają łącznie następujące warunki:

- 1) *ich emitentem jest Skarb Państwa, Narodowy Bank Polski, państwo członkowskie Unii Europejskiej, państwo należące do OECD, bank centralny państwa członkowskiego Unii Europejskiej lub Europejski Bank Centralny,*
- 2) *podaż i popyt umożliwiają ich nabywanie i zbywanie w sposób ciągły,*
- 3) *są zapisane na rachunku prowadzonym przez podlegający nadzorowi właściwego organu nadzoru nad rynkiem finansowym podmiot, który:*
 - a) *nie należy do grupy kapitałowej kontrahenta albo*
 - b) *należy do grupy kapitałowej kontrahenta, pod warunkiem, że zabezpieczenia przed skutkami niewypłacalności tego podmiotu kształtuje ryzyko posiadacza tych dłużnych papierów wartościowych lub instrumentów rynku pieniężnego na takim samym poziomie jak w przypadku zapisania dłużnego papieru wartościowego lub instrumentu rynku pieniężnego na rachunku prowadzonym przez podmiot, o którym mowa w lit. a,*
- 4) *ewentualne nabycie przez Fundusz praw z dłużnego papieru wartościowego lub instrumentu rynku pieniężnego w wyniku realizacji zabezpieczeń na dzień przyjęcia zabezpieczenia nie spowoduje naruszenia ograniczeń inwestycyjnych Funduszu.*

Fundusz jest zobowiązany do ustalania wartości dłużnych papierów wartościowych i instrumentów rynku pieniężnego stanowiących zabezpieczenie w związku z transakcjami, których przedmiotem są

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych PZU Spółka Akcyjna, Sąd Rejonowy dla m.st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy, KRS 19102, NIP 527-22-28-027, kapitał zakładowy: 13 000 000 zł wpłacony w całości, al. Jana Pawła II 24, 00-133 Warszawa, pzu.pl, infolinia: 801 102 102

niewystandaryzowane instrumenty pochodne, w każdym dniu roboczym, w którym odbywa się sesja na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie S.A., zgodnie z zasadami wyceny opisanymi w prospekcie informacyjnym Funduszu.”.

5) dotychczasowy ust. 10 otrzymuje numerację 11 i ustęp ten otrzymuje brzmienie:

„11. Wartość ryzyka danego kontrahenta w odniesieniu do wszystkich transakcji, których przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawartych z tym kontrahentem, nie może przekroczyć :

- 1) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku transakcji rozliczanych przez CCP,*
- 2) 10% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadku gdy kontrahentem jest instytucja kredytowa, bank krajowy lub bank zagraniczny,*
- 3) 5% wartości Aktywów Subfunduszu – w przypadkach innych niż wskazane w pkt. 1 i 2.”.*
- 4) niż wskazane w pkt. 1 i 2.”.*

2. w art. 54 po ust. 9 dodaje się ust. 10 i 11 w brzmieniu:

„10. Maksymalne zaangażowanie Subfunduszu w instrumenty pochodne wyznacza się w każdym dniu roboczym, co najmniej raz dziennie z zastosowaniem metody określonej w art. 8 Rozporządzenia 231/2013.

11. Wartość maksymalnego zaangażowania Subfunduszu w instrumenty pochodne nie może w żadnym momencie przekroczyć maksymalnego limitu ekspozycji AFI określonego w przepisach wydanych na podstawie art. 48c ust. 3 Ustawy pomniejszonego o inne pozycje wpływające zgodnie z Ustawą na zwiększenie tej ekspozycji.”.

Zmiany statutu Funduszu (za wyjątkiem zmian wskazanych w pkt I powyżej - w rozdziale I Statutu Funduszu o tytule – Postanowienia ogólne, które wchodzi w życie z dniem ogłoszenia tj. w dniu 14 sierpnia 2017 r.) wchodzi w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ich ogłoszenia tj. w dniu 14 listopada 2017 r.