

**WYKAZ ZMIAN**  
**w Prospekcie Allianz Duo**  
**Funduszu Inwestycyjnego Otwartego**  
**wprowadzonych aktualizacją z dnia 4 października 2022 roku**

**1. W Rozdziale III „Dane o Funduszu” w pkt 2 „Dane o Subfunduszach”:**

- 1) Zmieniono: ppkt 2.2.4 lit. d; ppkt 2.3.4 lit. d; ppkt 2.4.4 lit. d; ppkt 2.5.4 lit. d; ppkt 2.6.4 lit. d; ppkt 2.8.5 lit. d; ppkt 2.9.4 lit. d; ppkt 2.10.5 lit. d; ppkt 2.11.4 lit. d; ppkt 2.12.4 lit. d; ppkt 2.13.4 lit. d; ppkt 2.14.4 lit. d, ppkt 2.15.4 lit. d;
- 2) Zmieniono ppkt 2.10.6. lit. c.

**2. W Rozdziale XVI „Informacje dodatkowe” dodano pkt 6 w brzmieniu:**

**„6. Informacje przekazywane na podstawie art. 28 ust. 2 oraz art. 29 ust. 2 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2016/1011 z dnia 8 czerwca 2016 r. w sprawie indeksów stosowanych jako wskaźniki referencyjne w instrumentach finansowych i umowach finansowych lub do pomiaru wyników funduszy inwestycyjnych i zmieniającego dyrektywy 2008/48/WE i 2014/17/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 596/2014 („Rozporządzenie 2016/1011”)**

Mając na uwadze obowiązki określone przepisami art. 28 ust. 2 oraz art. 29 ust. 2 Rozporządzenia 2016/1011, Towarzystwo informuje że:

- 1) został opracowany i wdrożony pisemny plan określający działania, które Towarzystwo podjęłoby na wypadek istotnych zmian lub zaprzestania opracowywania danego wskaźnika referencyjnego stosowanego, odpowiednio, w celu pomiaru wyników inwestycyjnych funduszy inwestycyjnych zarządzanych przez Towarzystwo z wykorzystaniem indeksu lub kombinacji indeksów w celu śledzenia stopy zwrotu takiego wskaźnika referencyjnego lub kombinacji takich wskaźników (o ile ma to zastosowanie w przypadku danego funduszu) lub obliczania opłat za wyniki (tj. wynagrodzenia zmiennego Towarzystwa za zarządzanie danym funduszem inwestycyjnym, w tym w odniesieniu do Subfunduszy, o ile takie wynagrodzenie zostało określone w Statucie Funduszu);
- 2) w celach wskazanych w pkt 1 stosowane są w odniesieniu do Subfunduszy następujące wskaźniki referencyjne:

TWskażnik referencyjny	Czy wskaźnik referencyjny ustalany jest przez administratora wpisanego do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych? <sup>1</sup>	Wskazanie administratora wskaźnika referencyjnego	Subfundusze, w odniesieniu do których stosuje się dany wskaźnik referencyjny	Wskaźnik referencyjny stosowany jest na potrzeby: (A) pomiaru wyników inwestycyjnych Subfunduszu z wykorzystaniem indeksu lub kombinacji indeksów w celu śledzenia stopy zwrotu takiego wskaźnika referencyjnego lub kombinacji takich wskaźników; (B) określenia alokacji aktywów z portfela; (C) obliczania opłat za wyniki.
ICE BofA Poland Government Index	Nie <sup>2</sup>	ICE Data Indices, LLC	Allianz Optymalnego Wzrostu	(C)
			Allianz Obligacji Dynamiczny	(C)
FTSE Poland GBI 1 to 5 Year Local Terms	Nie <sup>2</sup>	FTSE International Limited	Allianz Kapitał Plus	(A), (C)
			Allianz Stabilnego Inwestowania	(A), (C)
			Allianz Zrównoważony	(A), (C)
FTSE Poland GBI LCL	Nie <sup>2</sup>	FTSE International Limited	Allianz Optymalnego Wzrostu	(C) <sup>6</sup>
			Allianz Obligacji Dynamiczny	(C) <sup>6</sup>
FTSE PLN 3 Month Eur Deposit Local Currency	Nie <sup>2</sup>	FTSE International Limited	Allianz Niskiego Ryzyka	(A)
			Allianz Dłużnych Papierów Korporacyjnych	(C)
			Allianz Polskich Akcji	(A), (C)
			Allianz Małych Spółek	(A), (C)
			Allianz Nowoczesnych Technologii	(A), (C)
			Allianz Dochodowy	(A), (C)
mWIG40TR	Tak <sup>4</sup>	GPW Benchmark S.A.	Allianz Małych Spółek	(A), (C)
WIBID 3M	Tak <sup>3</sup>	GPW Benchmark S.A.	Allianz Dochodowy	(C) <sup>5</sup>
			Allianz Małych Spółek	(C) <sup>5</sup>
			Allianz Nowoczesnych Technologii	(C) <sup>5</sup>
			Allianz Polskich Akcji	(C) <sup>5</sup>
			Allianz Dłużnych Papierów Korporacyjnych	(C) <sup>5</sup>
WIG	Tak <sup>4</sup>	GPW Benchmark S.A.	Allianz Kapitał Plus	(A), (C)
			Allianz Stabilnego Inwestowania	(A), (C)
			Allianz Zrównoważony	(A), (C)
			Allianz Polskich Akcji	(A), (C)
			Allianz Nowoczesnych Technologii	(A), (C)
			Allianz Optymalnego Wzrostu	(C)
WIG-techTR	Tak <sup>4</sup>	GPW Benchmark S.A.	Allianz Nowoczesnych Technologii	(A), (C)

<sup>1</sup> <https://registers.esma.europa.eu/publication/>

<sup>2</sup> Spółka FTSE International Limited z siedzibą w Londynie, w Wielkiej Brytanii oraz ICE Data Indices, LLC z siedzibą w Nowym Jorku, w Stanach Zjednoczonych Ameryki (USA) nie są uwzględnione w ramach prowadzonego przez ESMA rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych. Z uwagi na wystąpienie Wielkiej Brytanii z Unii Europejskiej, kraj ten na potrzeby stosowania regulacji przewidzianych w ramach Rozporządzenia 2016/1011 uznaje się za państwo trzecie. Jednakże na podstawie postanowień [umowy o wystąpieniu Zjednoczonego Królestwa Wielkiej Brytanii i Irlandii Północnej z Unii Europejskiej i Europejskiej Wspólnoty Energii Atomowej](#), co potwierdza również treść [Komunikatu ESMA](#), dozwolone jest stosowanie przez podmioty z Unii Europejskiej (UE) wskaźników referencyjnych ustalanych przez administratorów z siedzibą w Wielkiej Brytanii (odnosi się to do FTSE International Limited – UK based administrators) oraz indeksów opracowywanych przez administratorów z państw trzecich (w tym z USA), które przed wystąpieniem Wielkiej Brytanii z Unii Europejskiej zostały uznane lub zatwierdzone przy udziale

waściwych organów z tego państwa na podstawie przepisów Rozporządzenia 2016/1011 (odnosi się to do ICE Data Indices, LLC – UK recognised or endorsed third country benchmarks), jeśli wskaźniki te były już uprzednio stosowane w UE w instrumentach finansowych, umowach finansowych lub do pomiaru wyników funduszy inwestycyjnych, nawet jeśli wskaźniki te oraz ich administratorzy nie zostali wpisani do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych prowadzonego przez ESMA. Możliwość taka odnosi się do okresu przejściowego, który po przedłużeniu, upływa z dniem 31 grudnia 2023 r.

<sup>3</sup> Wedle informacji udostępnionych przez GPW Benchmark spółka ta otrzymała zezwolenie na prowadzenie działalności administratora wskaźników referencyjnych stopy procentowej, w tym opracowywania Stawek Referencyjnych WIBID® i WIBOR®, co zapewnia ciągłość stosowania wskazanych stawek referencyjnych przez podmioty, które stosują je w umowach i instrumentach finansowych.

<sup>4</sup> Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA) wpisał spółkę GPW Benchmark S.A. do rejestru administratorów i wskaźników referencyjnych, o którym mowa w art. 36 Rozporządzenia 2016/1011. Od dnia 1 grudnia 2019 r. GPW Benchmark S.A. pełni funkcję administratora indeksów giełdowych z Głównego Rynku GPW, NewConnect oraz rynku Treasury BondSpot Poland (TBSP), w tym m.in.: mWIG40TR, WIG oraz WIG-techTR.

<sup>5</sup> Stawka WIBID 3M wyznaczana dla kwotowanych na rynku międzybankowym depozytów w złotych o terminie zapadalności wynoszącym trzy miesiące stosowana będzie w przypadku likwidacji indeksu FTSE PLN 3 Month Eur Deposit Local Currency lub zaprzestania jego opracowywania jako wskaźnika referencyjnego, który może być stosowany w Unii Europejskiej zgodnie z art. 29 ust. 1 Rozporządzenia 2016/1011.

<sup>6</sup> Indeks FTSE Poland GBI LCL, ustalany w oparciu o dane dotyczące rentowności polskich obligacji skarbowych o stałym oprocentowaniu, stosowany będzie w przypadku likwidacji indeksu ICE BofA Poland Government Index lub zaprzestania jego opracowywania jako wskaźnika referencyjnego, który może być stosowany w Unii Europejskiej zgodnie z art. 29 ust. 1 Rozporządzenia 2016/1011.

