



23.02.2022 r.

Suplement nr 2 do PROSPEKTU CERTYFIKATÓW INWESTYCYJNYCH SERII A, B, C, D, E, F, G, H, I, J PZU FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO ZAMKNIĘTEGO LEGATO, zatwierdzonego przez Komisję Nadzoru Finansowego decyzją z dnia 14 lipca 2021 r. („prospekt”)

Niniejszy suplement do Prospektu został sporządzony zgodnie z art. 23 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1129 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie prospektu, który ma być publikowany w związku z ofertą publiczną papierów wartościowych lub dopuszczeniem ich do obrotu na rynku regulowanym oraz uchylenia Dyrektywy 2003/71/WE („Rozporządzenie Prospektowe”) w zw. z art. 51 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o ofercie publicznej i warunkach wprowadzania instrumentów finansowych do zorganizowanego systemu obrotu oraz o spółkach publicznych („Ustawa o Ofercie”).

Suplement został zatwierdzony decyzją Komisji Nadzoru Finansowego z dnia 22 lutego 2022 r.

Terminy pisane wielką literą w niniejszym dokumencie mają znaczenie nadane im w Prospekcie. Odwołania do stron odnoszą się do stron Prospektu opublikowanego w dniu 15 lipca 2021 r.

Niniejszy suplement został sporządzony w związku z opublikowaniem w dniu 11 lutego 2022 r. raportu okresowego Funduszu za IV kwartał 2021 r.

W związku z powyższym, suplementem nr 2 wprowadza się następujące zmiany do prospektu:

- 1. W Rozdziale I – PODSUMOWANIE- w sekcji KLUCZOWE INFORMACJE NA TEMAT EMITENTA pkt 2 o tytule „Jakie są kluczowe informacje finansowe dotyczące Emitenta?”(str. 14) otrzymuje następujące brzmienie:**
 - 1) w tabeli pierwszej na stronie 14 – zamieszcza się Wybrane Dane Finansowe z danymi za IV kwartał 2021 r.:**

| <i>„Wybrane Dane Finansowe</i> | <i>Za IV kwartał 2021 r.</i> |
|---|------------------------------|
| Zobowiązania | 135 tys. zł |
| Aktywa | 22 640 tys. zł |
| Aktywa netto | 22 505 tys. zł |
| Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI | 800 % |
| Liczba zarejestrowanych certyfikatów Inwestycyjnych | 226 219 |
| Wartość aktywów netto na certyfikat | 99,48 zł |

| | |
|---|-----------|
| inwestycyjny | |
| Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny | -0,83 zł” |

pod tabelą dodaje się akapit o następującej treści:

„Źródło: Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres 01.10.2021 – 31.12.2021 (dane nieaudytowane).”.

2) w tabeli drugiej na stronie 14 – zamieszcza się Rachunek Wyniku z Operacji z danymi za IV kwartał 2021 r.

| „Rachunek Wyniku z Operacji (dane w tys. zł) | za IV kwartał 2021 r. | Narastająco IV kwartał 2021r. 18.08.2021- 31.12.2021 |
|---|--------------------------------------|---|
| I. Przychody z lokat | 36 | 53 |
| II. Koszty funduszu | 130 | 129 |
| III. Koszty pokrywane przez towarzystwo | 0 | 0 |
| IV. Koszty funduszu netto (II-III) | 130 | 129 |
| V. Przychody z lokat netto (I-IV) | -94 | -76 |
| VI. Zrealizowany i nierealizowany zysk (strata) | -94 | -81 |
| VII. Wynik z operacji | -188 | -157 |
| Opłata za wynik (naliczona/zapłacona) | 0 | 0 |
| Opłata za zarządzanie inwestycjami (naliczona/zapłacona) | 25 | 23 |
| Wszelkie inne istotne opłaty (naliczone/ zapłacone) na rzecz usługodawców | 0 | 0” |

pod tabelą dodaje się akapit o następującej treści:

„Źródło: Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres 01.10.2021 – 31.12.2021 (dane nieaudytowane).”.

2. W Rozdziale IV – DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI w pkt 7.1. – Kondycja finansowa (str. 36) dodaje się opis w brzmieniu:

„W związku z niepewnością wynikającą z rozszerzającego się na świecie nowego wariantu wirusa, w grudniu 2021 r. podchodzono aktywnie do zarządzania ryzykiem funduszu. W obliczu rosnącej zmienności na rynkach, w połowie miesiąca zastosowano strategię zabezpieczającą ryzyko poprzez kontrakty terminowe m.in. na ropę naftową, rynki akcji czy 2-letnie obligacje skarbowe USA. Odreagowanie rynków w drugiej połowie miesiąca spowodowało uruchomienie zleceń stop loss, których zadaniem jest obrona aktywów przed gwałtownymi zmianami na wycenach. Zlecenia te ograniczyły straty do relatywnie niewielkich rozmiarów. Ponadto na przestrzeni miesiąca budowano portfel obligacji rynków wschodzących o krótkiej zapadalności, co zauważalnie poprawiło podstawową rentowność funduszu bez istotnego zwiększenia ryzyka stopy procentowej lub kredytowego. Wynik z operacji w całym 4 kwartale 2021 był ujemny i wyniósł -188 tys. zł. Aktywa netto na koniec czwartego kwartału 2021 r. wynosiły 22 505 tys. zł. Liczba zarejestrowanych Certyfikatów na koniec czwartego kwartału wyniosła 226 219.”.

3. W Rozdziale IV – DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI w pkt 7.2. – Wyniki działalności operacyjnej (str. 36) zamieszcza się w tabeli Rachunek Wyniku z Operacji z danymi za IV kwartał 2021 r. w brzmieniu:

| „Rachunek Wyniku z Operacji (dane w tys. zł) | za IV kwartał 2021 r. | Narastająco IV kwartał 2021r. 18.08.2021- 31.12.2021 |
|---|--------------------------------------|---|
| | | |

| | | |
|--|------|------|
| I. Przychody z lokat | 36 | 53 |
| II. Koszty funduszu | 130 | 129 |
| III. Koszty pokrywane przez towarzystwo | 0 | 0 |
| IV. Koszty funduszu netto (II-III) | 130 | 129 |
| V. Przychody z lokat netto (I-IV) | -94 | -76 |
| VI. Zrealizowany i nierealizowany zysk (strata) | -94 | -81 |
| VII. Wynik z operacji | -188 | -157 |
| Oплата za wynik (naliczona/zapłacona) | 0 | 0 |
| Oплата za zarządzanie inwestycjami (naliczona/zapłacona) | 25 | 23 |
| Wszelkie inne istotne opłaty (naliczone/zapłacone) na rzecz usługodawców | 0 | 0" |

pod tabelą dodaje się akapit o następującej treści:

„Źródło: Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres 01.10.2021 – 31.12.2021 (dane nieaudytowane).”.

4. W Rozdziale IV – DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI w pkt 12.2. – Śródroczne i inne informacje finansowe (str. 37) dodaje się informację o raporcie za IV kwartał 2021 r. w brzmieniu:

„Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. obejmujący dane finansowe Funduszu za okres od dnia 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. (dane nieaudytowane) opublikowany w dniu 11 lutego 2022 r. na stronie internetowej www.pzu.pl włączono do Prospektu poprzez odesłanie:

1. Raport kwartalny Funduszu za IV kwartał 2021 r.
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536031>
2. Wprowadzenie do sprawozdania finansowego PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536033>
3. Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536032>
4. Nota 1 Polityka rachunkowości PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536030>,

5. W Rozdziale IV – DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI w pkt 20.1. – Wybrane dane finansowe Funduszu (str. 57) dodaje się informację o raporcie za IV kwartał 2021 r. w brzmieniu:

1) zamieszcza się w tabeli pierwszej na stronie 57 - Wybrane Dane Finansowe z danymi za IV kwartał 2021 r.:

| „Wybrane Dane Finansowe | Za IV kwartał 2021 r. |
|---|-----------------------|
| Zobowiązania | 135 tys. zł |
| Aktywa | 22 640 tys. zł |
| Aktywa netto | 22 505 tys. zł |
| Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI | 800 % |
| Liczba zarejestrowanych certyfikatów Inwestycyjnych | 226 219 |
| Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 99,48 zł |
| Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny | -0,83 zł" |

pod tabelą dodaje się akapit o następującej treści:

„Źródło: Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres 01.10.2021 – 31.12.2021 (dane nieaudytowane).”.

2) zamieszcza się w tabeli drugiej na stronie 57 - Rachunek Wyniku z Operacji z danymi za IV kwartał 2021 r.

| „Rachunek Wyniku z Operacji (dane w tys. zł) | za IV kwartał 2021 r. | Narastająco IV kwartał 2021r. 18.08.2021- 31.12.2021 |
|--|--------------------------------------|---|
| I. Przychody z lokat | 36 | 53 |
| II. Koszty funduszu | 130 | 129 |
| III. Koszty pokrywane przez towarzystwo | 0 | 0 |
| IV. Koszty funduszu netto (II-III) | 130 | 129 |
| V. Przychody z lokat netto (I-IV) | -94 | -76 |
| VI. Zrealizowany i nierealizowany zysk (strata) | -94 | -81 |
| VII. Wynik z operacji | -188 | -157 |
| Opłata za wynik (naliczona/zapłacona) | 0 | 0 |
| Opłata za zarządzanie inwestycjami (naliczona/zapłacona) | 25 | 23 |
| Wszelkie inne istotne opłaty (naliczone/zapłacone) na rzecz usługodawców | 0 | 0” |

pod tabelą dodaje się akapit o następującej treści:

„Źródło: Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres 01.10.2021 – 31.12.2021 (dane nieaudytowane).”.

6. W Rozdziale IV – DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI w pkt 20.2. – Analiza portfela inwestycyjnego Funduszu (str. 57) dodaje się akapit w brzmieniu:

„Na dzień 31 grudnia 2021 r. Aktywa Funduszu wynosiły 22 640 tys. zł., na co składały się głównie dłużne papiery wartościowe (69,35% Aktywów Funduszu).

Szczegółowy skład portfela przedstawia raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres od 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. dostępny na stronie internetowej <https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536031>

Raport kwartalny za IV kwartał 2021 r. za okres od 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. włączono do Prospektu przez odesłanie.”.

7. W Rozdziale VII – ZAŁĄCZNIKI – dodaje się pkt 10 – Wykaz informacji włączonych przez odesłanie (str. 331) w brzmieniu:

„Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. obejmujący dane finansowe Funduszu za okres od dnia 1 października 2021 r. do 31 grudnia 2021 r. (dane nieaudytowane) opublikowany w dniu 11 lutego 2022 r. na stronie internetowej www.pzu.pl włączono do Prospektu poprzez odesłanie:

1. Raport kwartalny Funduszu za IV kwartał 2021 r.
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536031>
2. Wprowadzenie do sprawozdania finansowego PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536033>
3. Informacja dodatkowa do sprawozdania finansowego PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536032>
4. Nota 1 Polityka rachunkowości PZU FIZ Legato
<https://www.pzu.pl/fileserver/item/1536030>.”