

OGŁOSZENIE Z DNIA 1 LIPCA 2026 ROKU
O ZMIANACH STATUTU
BNP Paribas PARASOL SPECJALISTYCZNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO
OTWARTEGO

BNP Paribas PARASOL Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty („Fundusz”), wpisany do Rejestru Funduszy Inwestycyjnych prowadzonego przez Sąd Okręgowy w Warszawie, VII Wydział Cywilny Rejestrowy, pod numerem RFi 970, informuje o dokonaniu zmian Statutu Funduszu, które wchodzi w życie w dniu ogłoszenia czyli **w dniu 1 lipca 2026 r:**

1. Artykuł 58 ust. 4 otrzymuje następujące nowe brzmienie:

„4. Wskaźnikiem Referencyjnym Subfunduszu jest indeks oparty o stawkę POLSTR O/N oraz zmiany indeksów giełdowych MWIG40 oraz SWIG80.”

2. Art. 58 ust. 5 otrzymuje następujące nowe brzmienie:

„5. Stopa zwrotu Wskaźnika Referencyjnego w dniu d obliczana jest według następującego wzoru:

$$WR_{St}(d) = WR(d) / WR(d-1) - 1$$

gdzie:

$$WR(d) = WR(d-1) \times [1 + 0,6 \times (SWIG80TR(d) / SWIG80TR(d-1) - 1) + 0,3 \times (MWIG40TR(d) / MWIG40TR(d-1) - 1) + 0,1 \times (POLSTR O/N(d) \times k / 365)]$$

gdzie:

WR(d) – wartość Wskaźnika Referencyjnego w dniu d;

d – kolejny Dzień Wyceny; przy czym d=0 oznacza ostatni Dzień Wyceny przypadający 5 lat przed Dniem Wyceny d, w przypadku, gdy nie jest to Dzień Wyceny odnosimy się do ostatniego Dnia Wyceny przed tą datą. Natomiast przed upływem pierwszego 5-letniego okresu odniesienia d=0 oznacza ostatni Dzień Wyceny przypadający przed Pierwszym Okresem Rozliczeniowym - zdefiniowanym w ust. 10 lit a) poniżej.

k – liczba dni między bieżącym, a poprzednim Dniem Wyceny;

POLSTR O/N(d) (Polish Short-Term Rate) rozumie się przez to średni poziom stopy procentowej ważonej wolumenem, rozumianym jako kwota nominalna, Transakcji Depozytowych w PLN (w złotych) zawartych na termin zapadalności O/N na hurtowym rynku pieniężnym w Dniu Wyceny poprzedzającym Dzień Wyceny (d). Administrator, którym jest GPW Benchmark S.A. określa POLSTR O/N jako indeks stopy procentowej, która jest bliska stopie wolnej od ryzyka, czyli stopę procentową mierzoną przy założeniu ograniczenia ryzyka rynkowego, w tym ryzyka oczekiwań rynkowych co do kształtowania

się stóp w przyszłości, a także ryzyka płynności i ryzyka kredytowego. Szczegółowe zasady obliczania i publikowania POLSTAR O/N są ujęte w Regulaminie Indeksu Stopy Procentowej POLSTR, przyjętym Uchwałą Zarządu GPW Benchmark S.A. nr 61/2025 z dnia 23.05.2025 r. z ewentualnymi późniejszymi zmianami);

SWIG80TR(d) –rozumie się przez to wartość indeksu 80 małych spółek notowanych na Głównym Rynku GPW, uwzględniającego zarówno czyste zmiany kursów jak i dochody wynikające z tytułu dywidend. Udział jednej spółki w indeksie ograniczony jest do 10%;

MWIG40TR(d) – rozumie się przez to wartość indeksu 40 średnich spółek notowanych na Głównym Rynku GPW, uwzględniającego zarówno czyste zmiany kursów jak i dochody wynikające z tytułu dywidend. Wartość bazową indeksu ustalono na dzień 31 grudnia 2009 r. na poziomie 2346,16 pkt.

UWAGA: POLSTR O/N jest nowym indeksem zastępującym WIBOR O/N a także jednym z najważniejszych elementów reformy wskaźników referencyjnych w Polsce – zastosowanie nowego indeksu zapewnia ekonomiczną równowagę wzoru przed i po zmianie.”

Pozostałe postanowienia Statutu pozostają bez zmian.

Tekst jednolity Statutu Funduszu, uwzględniający powyższe zmiany, został zamieszczony na stronie internetowej www.tfi.bnpparibas.pl.