

ANEKS NR 2  
DO PROSPEKTU EMISYJNEGO  
CERTYFIKATÓW INWESTYCYJNYCH SERII E, F, G, H  
PKO STRATEGII OBLIGACYJNYCH  
– FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY  
zatwierdzonego decyzją Komisji Nadzoru Finansowego  
z dnia 22 marca 2016 r.



Warszawa, 4 maja 2016 r.

PKO Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Chłodna 52, 00-872 Warszawa, informuje o dokonaniu następujących zmian prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii E, F, G i H PKO Strategii Obligacyjnych – fundusz inwestycyjny zamknięty.

1. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.7. w tabeli Wybrane Dane Finansowe, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

WYBRANE DANE FINANSOWE	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
<i>I. Przychody z lokat</i>	4 493	8 972
<i>II. Koszty funduszu netto</i>	2 049	4 314
<i>III. Przychody z lokat netto</i>	2 444	4 658
<i>IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat</i>	3 028	-6 854
<i>V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat</i>	-1 971	5 004
<i>VI. Wynik z operacji</i>	3 501	2 808
<i>VII. Zobowiązania</i>	158 160	730 549
<i>VIII. Aktywa</i>	540 655	1 336 176
<i>IX. Aktywa netto</i>	382 495	605 627
<i>X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych</i>	3 657 851	5 939 857
<i>XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny</i>	104,57	101,96
<i>XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny</i>	0,96	0,47

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”

2. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.7., w tabeli Rachunek Przepływów Pieniężnych, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

RACHUNEK PRZEPŁYWÓW PIENIĘŻNYCH	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
<i>Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej</i>	-3 389	-8 564
<i>Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej</i>	-32 006	-34 454
<i>Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych</i>	875	680
<i>Zmiana stanu środków pieniężnych netto</i>	-35 395	-43 018
<i>Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego</i>	40 380	45 901
<i>Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego</i>	5 860	3 563

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”

3. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.7., w tabeli Rachunek Wyniku z Operacji dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

<i>RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI</i> <i>(w tys. złotych)</i>		<i>za I kwartał 2016 r.</i>	<i>za I kwartał 2015 r.</i>
I.	<i>PRZYCHODY Z LOKAT</i>	<i>4 493</i>	<i>8 972</i>
II.	<i>KOSZTY FUNDUSZU</i>	<i>2 049</i>	<i>4 314</i>
III.	<i>KOSZTY POKRYWANE PRZEZ TOWARZYSTWO</i>	<i>0</i>	<i>0</i>
IV.	<i>KOSZTY FUNDUSZU NETTO (II-III)</i>	<i>2 049</i>	<i>4 314</i>
V.	<i>PRZYCHODY Z LOKAT NETTO (I-IV)</i>	<i>2 444</i>	<i>4 658</i>
VI.	<i>ZREALIZOWANY I NIEZREALIZOWANY ZYSK (STRATA)</i>	<i>1 057</i>	<i>-1 850</i>
VII.	<i>WYNIK Z OPERACJI (V+/-VI)</i>	<i>3 501</i>	<i>2 808</i>

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”.

4. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.7., w tabeli Zestawienie Lokat, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

<i>ZESTAWIENIE LOKAT</i>						
<i>Składniki lokat</i>	<i>za I kwartał 2016 r.</i>			<i>za I kwartał 2015 r.</i>		
	<i>Wartość według ceny nabycia w tys. złotych</i>	<i>Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych</i>	<i>Udział w aktywach ogółem (%)</i>	<i>Wartość według ceny nabycia w tys. złotych</i>	<i>Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych</i>	<i>Udział w aktywach ogółem (%)</i>
<i>Akcje</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Warranty subskrypcyjne</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Prawa do akcji</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Prawa poboru</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Kwity depozytowe</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Listy zastawne</i>	<i>2 500</i>	<i>2 503</i>	<i>0,46</i>	-	-	-
<i>Dłużne papiery wartościowe</i>	<i>480 247</i>	<i>491 963</i>	<i>91,01</i>	<i>905 728</i>	<i>920 451</i>	<i>68,88</i>
<i>Instrumenty pochodne</i>	-	<i>-699</i>	<i>-0,13</i>	<i>Nie dotyczy</i>	<i>3 614</i>	<i>0,27</i>
<i>Udziały w spółkach z o.o.</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Jednostki uczestnictwa</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Certyfikaty inwestycyjne</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Wierzytelności</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Weksle</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Depozyty</i>	<i>40 000</i>	<i>40 002</i>	<i>7,40</i>	-	-	-
<i>Waluty</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Nieruchomości</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Statki morskie</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Inne</i>	-	-	-	-	-	-
<i>Razem</i>	<b><i>522 747</i></b>	<b><i>533 769</i></b>	<b><i>98,74</i></b>	<i>905 728</i>	<i>924 065</i>	<i>69,15</i>

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”.

5. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.7., na końcu dodaje się akapit w następującym brzmieniu:

„W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz zrealizował wysoki zysk z tytułu zbycia lokat, co przełożyło się to na dodatni wynik z operacji w kwocie 0,96 zł na Certyfikat Inwestycyjny. Fundusz wypracował w pierwszym kwartale 2016 r. przychody netto w wysokości 2 444 tys. zł. oraz zwiększył zaangażowanie w dłużne papiery wartościowe do 91,01% aktywów ogółem. W pierwszym kwartale 2016 r. odnotowano ujemne przepływy w kapitale z uwagi na wykupy Certyfikatów Inwestycyjnych. W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz nie przeprowadzał kolejnych emisji Certyfikatów Inwestycyjnych.”

6. Rozdział I. PODSUMOWANIE pkt B.45. na końcu dodaje się kolejne akapity w następującym brzmieniu:

„Na dzień 31 marca 2016 r. Aktywa Netto Funduszu wynosiły 382 495 tys. zł na co składały się głównie dłużne papiery wartościowe notowane oraz nienotowane na aktywnym rynku oraz środki pieniężne. Dłużne papiery wartościowe stanowiły 91,01% Aktywów Funduszu natomiast środki pieniężne stanowiły 1,08% Aktywów Funduszu. Dłużne papiery wartościowe o wykupie do 1 roku stanowiły 24,01% udziału w aktywach ogółem, natomiast dłużne papiery wartościowe o wykupie powyżej 1 roku stanowiły 66,99% udział w aktywach ogółem. Jedną z największych pozycji w portfelu stanowiły obligacje skarbowe Rumunii i stanowiły 9,14% udziału w aktywach ogółem. Instrumenty pochodne obejmowały niewystandaryzowane instrumenty pochodne, w tym IRS i FX SWAP. Zestawienie lokat na dzień 31 marca 2016 r.

Zestawienie lokat na dzień 31 marca 2016 r.

	Wartość według ceny nabycia w tys. złotych	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych	Udział w aktywach ogółem (%)
Listy zastawne	2 500	2 503	0,46
Dłużne papiery wartościowe	480 247	491 963	91,01
Instrumenty pochodne	nie dotyczy	-699	-0,13
Depozyty	40 000	40 002	7,40

Szczegółowy skład portfela przedstawia raport kwartalny Funduszu dostępny na stronie [www.pkotfi.pl](http://www.pkotfi.pl) (dane nie audytowane).”

7. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.2., w tabeli Wybrane Dane Finansowe, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

WYBRANE DANE FINANSOWE	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
I. Przychody z lokat	4 493	8 972
II. Koszty funduszu netto	2 049	4 314
III. Przychody z lokat netto	2 444	4 658
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	3 028	-6 854
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	-1 971	5 004
VI. Wynik z operacji	3 501	2 808
VII. Zobowiązania	158 160	730 549
VIII. Aktywa	540 655	1 336 176
IX. Aktywa netto	382 495	605 627
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	3 657 851	5 939 857
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	104,57	101,96
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	0,96	0,47

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:

„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”

8. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.2., w tabeli Rachunek Przepływów Pieniężnych, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

RACHUNEK PRZEPŁYWÓW PIENIĘŻNYCH	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	-3 389	-8 564
Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	-32 006	-34 454
Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	875	680

Zmiana stanu środków pieniężnych netto	-35 395	-43 018
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	40 380	45 901
Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego	5 860	3 563

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”.

9. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.2., w tabeli Rachunek Wyniku z Operacji dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI (w tys. złotych)	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
I. PRZYCHODY Z LOKAT	4 493	8 972
II. KOSZTY FUNDUSZU	2 049	4 314
III. KOSZTY POKRYWANE PRZEZ TOWARZYSTWO	0	0
IV. KOSZTY FUNDUSZU NETTO (II-III)	2 049	4 314
V. PRZYCHODY Z LOKAT NETTO (I-IV)	2 444	4 658
VI. ZREALIZOWANY I NIEZREALIZOWANY ZYSK (STRATA)	1 057	-1 850
VII. WYNIK Z OPERACJI (V+/-VI)	3 501	2 808

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:  
„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”.

10. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.2., w tabeli Zestawienie Lokat, dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

ZESTAWIENIE LOKAT						
Składniki lokat	za I kwartał 2016 r.			za I kwartał 2015 r.		
	Wartość według ceny nabycia w tys. złotych	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych	Udział w aktywach ogółem (%)	Wartość według ceny nabycia w tys. złotych	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych	Udział w aktywach ogółem (%)
Akcje	-	-	-	-	-	-
Warranty subskrypcyjne	-	-	-	-	-	-
Prawa do akcji	-	-	-	-	-	-
Prawa poboru	-	-	-	-	-	-
Kwity depozytowe	-	-	-	-	-	-
Listy zastawne	2 500	2 503	0,46	-	-	-
Dłużne papiery wartościowe	480 247	491 963	91,01	905 728	920 451	68,88
Instrumenty pochodne	-	-699	-0,13	Nie dotyczy	3 614	0,27
Udziały w spółkach z o.o.	-	-	-	-	-	-
Jednostki uczestnictwa	-	-	-	-	-	-
Certyfikaty inwestycyjne	-	-	-	-	-	-
Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	-	-	-	-	-	-
Wierzytelności	-	-	-	-	-	-
Weksle	-	-	-	-	-	-
Depozyty	40 000	40 002	7,40	-	-	-
Waluty	-	-	-	-	-	-

Nieruchomości	-	-	-	-	-	-
Statki morskie	-	-	-	-	-	-
Inne	-	-	-	-	-	-
Razem	<b>522 747</b>	<b>533 769</b>	<b>98,74</b>	<b>905 728</b>	<b>924 065</b>	<b>69,15</b>

,a w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:

„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”.

11. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.2., na końcu dodaje się akapit w następującym brzmieniu:

„W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz zrealizował wysoki zysk z tytułu zbycia lokat, co przełożyło się to na dodatni wynik z operacji w kwocie 0,96 zł na Certyfikat Inwestycyjny. Fundusz wypracował w pierwszym kwartale 2016 r. przychody netto w wysokości 2 444 tys. zł. oraz zwiększył zaangażowanie w dłużne papiery wartościowe do 91,01% aktywów ogółem. W pierwszym kwartale 2016 r. odnotowano ujemne przepływy w kapitale z uwagi na wykupy Certyfikatów Inwestycyjnych. W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz nie przeprowadzał kolejnych emisji Certyfikatów Inwestycyjnych.”.

12. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.3., na końcu dodaje się kolejne akapity w następującym brzmieniu:

„Na dzień 31 marca 2016 r. Aktywa Netto Funduszu wynosiły 382 495 tys. zł na co składały się głównie dłużne papiery wartościowe notowane oraz nienotowane na aktywnym rynku oraz środki pieniężne. Dłużne papiery wartościowe stanowiły 91,01% Aktywów Funduszu natomiast środki pieniężne stanowiły 1,08% Aktywów Funduszu. Dłużne papiery wartościowe o wykupie do 1 roku stanowiły 24,01% udziału w aktywach ogółem, natomiast dłużne papiery wartościowe o wykupie powyżej 1 roku stanowiły 66,99% udział w aktywach ogółem. Jedną z największych pozycji w portfelu stanowiły obligacje skarbowe Rumunii i stanowiły 9,14% udziału w aktywach ogółem. Instrumenty pochodne obejmowały niewystandaryzowane instrumenty pochodne, w tym IRS i FX SWAP. Zestawienie lokat na dzień 31 marca 2016 r.

Zestawienie lokat na dzień 31 marca 2016 r.

	Wartość według ceny nabycia w tys. złotych	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. złotych	Udział w aktywach ogółem (%)
Listy zastawne	2 500	2 503	0,46
Dłużne papiery wartościowe	480 247	491 963	91,01
Instrumenty pochodne	nie dotyczy	-699	-0,13
Depozyty	40 000	40 002	7,40

Szczegółowy skład portfela przedstawia raport kwartalny Funduszu dostępny na stronie [www.pkotfi.pl](http://www.pkotfi.pl) (dane nie audytowane).”.

13. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.5., w tabeli dodaje się kolumny z danymi za I kwartał 2016 r. oraz za I kwartał 2015 r.:

	za I kwartał 2016 r.	za I kwartał 2015 r.
<b>I. PRZYCHODY Z LOKAT</b>	<b>4 493</b>	<b>8 972</b>
Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0
Przychody odsetkowe	3 619	7 281
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0
Dodatnie saldo różnic kursowych	874	1 691
Pozostałe	0	0
<b>II. KOSZTY FUNDUSZU</b>	<b>2 049</b>	<b>4 314</b>
Wynagrodzenie dla towarzystwa	1 670	2 973
Wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0
Opłaty dla depozytariusza	26	33
Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	10	14
Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	0	13
Usługi w zakresie rachunkowości	0	0
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0
Usługi prawne	0	0
Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0
Koszty odsetkowe	270	1 216

<i>Koszty związane z posiadaniem nieruchomości</i>	0	0
<i>Ujemne saldo różnic kursowych</i>	0	0
<i>Pozostałe</i>	73	65
<b>III KOSZTY POKRYWANE PRZEZ TOWARZYSTWO</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>IV KOSZTY FUNDUSZU NETTO (II-III)</b>	<b>2 049</b>	<b>4 314</b>
<b>V. PRZYCHODY Z LOKAT NETTO (I-IV)</b>	<b>2 444</b>	<b>4 658</b>
<b>VI ZREALIZOWANY I NIEZREALIZOWANY ZYSK (STRATA)</b>	<b>1 057</b>	<b>-1 850</b>
<i>Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym:</i>	<i>3 028</i>	<i>-6 854</i>
<i>- z tytułu różnic kursowych</i>	<i>2 387</i>	<i>-3 064</i>
<i>Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:</i>	<i>-1 971</i>	<i>5 004</i>
<i>- z tytułu różnic kursowych</i>	<i>-1 484</i>	<i>3 219</i>
<b>VI I WYNIK Z OPERACJI (V+/-VI)</b>	<b>3 501</b>	<b>3 501</b>
<i>Wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny (w złotych)</i>	<i>0,96</i>	<i>0,96</i>
<i>Rozwodniony wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny (w złotych)</i>	<i>0,96</i>	<i>0,96</i>

14. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.5., po akapicie znajdującym się pod tabelą, komentującym wynik Funduszu, a przed akapitem „Źródło”, dodaje się kolejny akapit w następującym brzmieniu:

*„W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz zrealizował wysoki zysk z tytułu zbycia lokat, co przełożyło się to na dodatni wynik z operacji w kwocie 0,96 zł na Certyfikat Inwestycyjny. Fundusz wypracował w pierwszym kwartale 2016 r. przychody netto w wysokości 2 444 tys. zł. oraz zwiększył zaangażowanie w dłużne papiery wartościowe do 91,01% aktywów ogółem. W pierwszym kwartale 2016 r. odnotowano ujemne przepływy w kapitale z uwagi na wykupy Certyfikatów Inwestycyjnych. W pierwszym kwartale 2016 r. Fundusz nie przeprowadzał kolejnych emisji Certyfikatów Inwestycyjnych.”*

15. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.5., w akapicie „Źródło” na końcu dodaje się zdanie następującej treści:

*„Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. za okres od 2016-01-01 do 2016-03-31 (dane nieaudytowane).”*

16. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 2.15., dodaje się akapit następującej treści:

*„Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 stycznia 2016 r. do dnia 31 marca 2016 r. włączono do Prospektu przez odniesienie obejmujące historyczne informacje finansowe Funduszu za okres od dnia 1 stycznia 2016 r. do dnia 31 marca 2016 r. Raport kwartalny za I kwartał 2016 r. został opublikowany w dniu 29 kwietnia 2016 r. na stronie internetowej [www.pkotfi.pl](http://www.pkotfi.pl).”*

17. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 5.4., dodaje się kolejne akapity w następującym brzmieniu:

*„Na dzień 31.12.2015 r. kapitały własne Towarzystwa wyniosły:  
Wysokość składników kapitału własnego na dzień 31.12.2015 r.: 80.481.641,70 zł  
Kapitał zakładowy: 18.000.000,00 zł  
Należne lecz nie wniesione wpłaty na kapitał zakładowy: 0,00 zł  
Kapitał zapasowy: 6.517.000,00 zł  
Kapitał rezerwowy z aktualizacji wyceny: -504.302,62 zł  
Pozostałe kapitały rezerwowe: 0,00 zł  
Wynik finansowy netto z lat ubiegłych: 0,00 zł  
Bieżący wynik na działalności: 56.468.944,32 zł.”*

18. Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 5.5., w akapicie drugim sformułowanie:  
"datę przygotowania"

zastępuje się słowem:

*„Dzień”.*

Rozdział IV. DANE O FUNDUSZU I JEGO DZIAŁALNOŚCI, pkt 5.5., na końcu dodaje się kolejne akapity w następującym brzmieniu:

*„Zgodnie ze rocznym sprawozdaniem finansowym Towarzystwa za 2015 r. kapitały własne Towarzystwa wyniosły:  
31.12.2015 r. 80.481.641,70 zł*

*W 2015 r. poziom minimalnych kapitałów własnych Towarzystwa wymaganych przez art. 50 Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych wynosił:  
31.12.2015 r. 13.490 tys. zł*

*Kapitał własny Towarzystwa jest zgodny z wymogami Ustawy o Funduszach Inwestycyjnych i wg stanu na dzień 31 grudnia 2015 r. wynosił 80.481.641,70 zł. W opinii Towarzystwa na dzień zatwierdzenia aneksu nr 2 do Prospektu kapitały własne są wystarczające na pokrycie potrzeb Towarzystwa w zakresie prowadzonej działalności.”*

19. W załączniku nr 3, Wykaz informacji włączonych przez odesłanie, dodaje się pkt 8 w następującym brzmieniu:

*„8. Raport kwartalny Funduszu za okres od dnia 1 stycznia 2016 r. do 31 marca 2016 r.”.*

#### INFORMACJA O PRAWIE DO UCHYLENIA SIĘ OD SKUTKÓW PRAWNYCH ZŁOŻONYCH ZAPISÓW

*Zgodnie z art. 51a ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o ofercie publicznej i warunkach wprowadzania instrumentów finansowych do zorganizowanego systemu obrotu oraz o spółkach publicznych (Dz. U. z 2013 poz. 1382), w związku z udostępnieniem niniejszego Aneksu nr 2 do prospektu emisyjnego certyfikatów inwestycyjnych serii E, F, G i H PKO Strategii Obligacyjnych – fundusz inwestycyjny zamknięty osoby, które złożyły zapisy na certyfikaty inwestycyjne serii E Funduszu przed udostępnieniem tego aneksu, mogą uchylić się od skutków prawnych złożonych zapisów. Uchylenie się od skutków prawnych złożonych zapisów następuje przez oświadczenie złożone na piśmie w terminie dwóch dni roboczych od dnia udostępnienia niniejszego aneksu, tj. do dnia 13 maja 2016 r.*