

NOTA 6 – INSTRUMENTY POCHODNE

na dzień 30.06.2017

	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych	Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności	Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
FX Swap, EUR/PLN, 05/07/2017	sprzedaż waluty po ustalonym kursie	FX SWAP	ograniczenie ryzyka walutowego portfela papierów	0,06 tys. EUR	Subfundusz dostarcza walutę w wysokości 80 000 EUR	2017-07-05	80 000 EUR co stanowi równowartość na dzień rozliczenia	2017-07-05	2017-07-05