

NOTA 6 – INSTRUMENTY POCHODNE

na dzień 31.12.2016

	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Terminy i warunki przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności	Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
FUTURES, Indeks WIG20, FW20H1720, 2017-03-17 (PLOGF0010595)	krótka	kontrakt terminowy	sprawne zarządzanie portfelem	778	Wartość depozytu zabezpieczającego jest ustalane każdego dnia wyceny, na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez GPW w Warszawie	Płatności dokonywane codziennie w ramach uzupełniania depozytu zabezpieczającego	2017-03-17	2017-03-17