

**NOTA 6 Instrumenty pochodne**

W przypadku walutowych niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych, wykazane w tabeli przyszłe płatności Funduszu i kontrahenta są wyliczane na podstawie kursu ustalonego przez strony kontraktu w trakcie zawierania transakcji.

**Instrumenty pochodne według stanu na dzień 31 grudnia 2020 r.**

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)	Wartość przyszłych płatności funduszu (w tys.)		Wartość przyszłych płatności kontrahenta (w tys.)	Data zapadalności
					USD	EUR		
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 04.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-108	4 600	17 075	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 15.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-1 708	11 100	49 251	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 15.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-204	1 350	5 994	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 16.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-32	200	886	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 18.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-109	680	3 013	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 18.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-77	700	2 538	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 21.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-15	200	903	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 22.12.2020 11.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-4	50	225	PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 30.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-55	565	2 539	PLN	2021-01-11
Pozycja długa	FX Swap USD PLN 30.12.2020 11.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	1	1 031	276	USD	2021-01-11
Pozycja długa	FX Swap JPY EUR 10.12.2020 12.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-15	1 094	138 101	JPY	2021-01-12
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 22.12.2020 13.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-2 724	24 500	88 805	PLN	2021-01-13
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 17.12.2020 15.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-385	4 700	17 173	PLN	2021-01-15
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 21.12.2020 15.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-52	450	1 629	PLN	2021-01-15
Pozycja krótka	FX Swap ZAR PLN 18.12.2020 21.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-62	6 244	1 519	PLN	2021-01-21
Pozycja krótka	FX Swap CHF PLN 27.02.2020 26.02.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-171	1 843	7 657	PLN	2021-02-26

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)	Terminy i warunki przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności (w tys. zł)	Data zapadalności
Pozycja krótka	EURO-BUND FUTURE MAR21	RXH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-182	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2021-03-08
Pozycja krótka	S&P500 EMINI FUT MAR21	ESH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-140	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2021-03-19
Pozycja długa	E-Mini Russ 2000 Mar21	RTYH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	65	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2021-03-19
Pozycja długa	EURO STOXX BANK Mar21	CAH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	84	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2021-03-19
Pozycja krótka	Euro STOXX 50 Index FUTURE Mar21	VGH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-135	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2021-03-19
Pozycja krótka	10 Year US Treasury Note Mar 21	TYH1	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-352	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2021-03-22
Pozycja długa	IRS RUB 08.06.2022 (SW08062022N001)	IRS RUB 08.06.2022	sprawne zarządzanie portfelem	307	Płatności roczne wg stopy 4,93% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	290 000	2022-06-08
Pozycja długa	IRS ZAR 02.12.2022 (SW02122022N001)	IRS ZAR 02.12.2022	sprawne zarządzanie portfelem	-314	Płatności kwartalne wg stopy 3,82% Płatności kwartalne wg stopy ZARL3M	212 000	2022-12-02
Pozycja długa	IRS PLN 12.12.2022 (SW12122022N001)	IRS PLN 12.12.2022	sprawne zarządzanie portfelem	-154	Płatności roczne wg stopy 0,378% Płatności kwartalne wg stopy PLINW3M	69 000	2022-12-12
Pozycja długa	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	321	Płatności roczne wg stopy 7,22% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N011)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	384	Płatności 1D wg stopy 6,435% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	7 497	2025-01-02
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N012)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	31	Płatności 1D wg stopy 5,385% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-	13 113	2025-01-02



Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)	Terminy i warunki przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności (w tys. zł)	Data zapadalności
Pozycja krótka	10 Year US Treasury Note Mar 20	TYH0	sprawne zarządzanie portfelem	97	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-12-19
Pozycja krótka	EURO-BUND FUTURE MAR20	PXH0	sprawne zarządzanie portfelem	117	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2020-03-06
Pozycja długa	IRS RUB 30.04.2021 (SW30042021N001)	IRS RUB 30.04.2021	sprawne zarządzanie portfelem	1 056	Płatności roczne wg stopy 8,32% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	260 000	2021-04-30
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2023 (SW02012023N002)	IRS BRL 02.01.2023	sprawne zarządzanie portfelem	104	Płatności 1D wg stopy 5,98% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	18 885	2023-01-02
Pozycja długa	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	sprawne zarządzanie portfelem	183	Płatności roczne wg stopy 7,22% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N010)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	1	Płatności 1D wg stopy 6,40% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	10 299	2025-01-02
Pozycja długa	IRS MXN 21.10.2039 (SW21102039N001)	IRS MXN 21.10.2039	sprawne zarządzanie portfelem	27	Płatności 1D wg stopy 7,195% Płatności 1D wg stopy MXN-TTIE	17 000	2039-10-21