

## NOTA 6 Instrumenty pochodne

W przypadku walutowych niewystandardzowanych 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.

<b>Typ zajętej pozycji</b>	<b>Nazwa instrumentu pochodnego</b>	<b>Rodzaj instrumentu pochodnego</b>	<b>Cel otwarcia pozycji</b>	<b>Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)</b>	<b>Wartość przyszłych płatności funduszu (w tys.)</b>	<b>Wartości przyszłych płatności kontrahenta (w tys.)</b>	<b>Data zapadalności</b>
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 04.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-108	4 600 USD	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 EUR	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 EUR	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 EUR	886 PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 18.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-109	680 EUR	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 USD	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 EUR	903 PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 22.12.2020 11.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-4	50 EUR	225 PLN	2021-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 30.12.2020 11.01.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-55	565 EUR	2 939 PLN	2021-01-11
Pozycja dłużna	FX Swap USD PLN 30.12.2020 11.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	1	1 031 PLN	276 USD	2021-01-11
Pozycja dłużna	FX Swap JPY EUR 10.12.2020 12.01.2021	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-15	1 094 EUR	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 USD	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 USD	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 USD	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 ZAR	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 CHF	7 657 PLN	2021-02-26

<b>Typ zajętej pozycji</b>	<b>Nazwa instrumentu pochodnego</b>	<b>Rodzaj instrumentu pochodnego</b>	<b>Cel otwarcia pozycji</b>	<b>Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)</b>	<b>Terminy i warunki przyszłych strumieni pieniężnych</b>	<b>Kwota będąca podstawa przyszłych płatności (w tys. zł)</b>	<b>Data zapadalności</b>
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 dłużna	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 dłuża	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 dłuża	IRS RUB 08.06.2022 (SW08062022N001)	IRS RUB 08.06.2022	sprawne zarządzanie portfelem	307	Platności roczne wg stopy RUBOR3M	290 000	2022-06-08
Pozycja dłuża	IRS ZAR 02.12.2022 (SW02122022N001)	IRS ZAR 02.12.2022	sprawne zarządzanie portfelem	-314	Platności kwartalne wg stopy ZARL3M	212 000	2022-12-02
Pozycja dłuża	IRS PLN 12.12.2022 (SW12122022N001)	IRS PLN 12.12.2022	sprawne zarządzanie portfelem	-154	Platności roczne wg stopy PLNW3M	69 000	2022-12-12
Pozycja dłuża	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	321	Platności roczne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja dłuża	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N011)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	384	Platności 1D wg stopy 6,435% Platności 1D wg stopy BRL-DIRE	7 497	2025-01-02
Pozycja dłuża	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N012)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	31	Platności 1D wg stopy 5,385% Platności 1D wg stopy BRL-DIRE	13 113	2025-01-02

				PRE		
Pozycja dłużna	IRS CZK 26.11.2030 (SW2611203N001)	IRS CZK 26.11.2030	sprawne zarządzanie portfelem	36	Platności roczne wg stopy 1,42% Platności półroczne wg stopy PRIBO6M	2030-11-26
Pozycja dłużna	IRS MXN 28.11.2030 (SW2811203N001)	IRS MXN 28.11.2030	sprawne zarządzanie portfelem	53	Platności 4T wg stopy 5,465% Platności 4T wg stopy MXN-TTE	2030-11-28
Pozycja dłużna	IRS ZAR 02.12.2030 (SW0212203N001)	IRS ZAR 02.12.2030	sprawne zarządzanie portfelem	277	Platności kwartalne wg stopy 6,85% Platności kwartalne wg stopy ZAR1.3M	2030-12-02
Pozycja dłużna	IRS USD 11.12.2030 (SW1112203N001)	IRS USD 11.12.2030	sprawne zarządzanie portfelem	-18	Platności półroczne wg stopy 0,953% Platności kwartalne wg stopy USD1.3M	2030-12-11

**Instrumenty pochodne według stanu na dzień 31 grudnia 2019 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.)	Wartości przyszłych płatności kontrahenta (w tys.)	Data zapadalności
Pozycja krótką	FX Swap USD PLN 18.12.2019 08.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	101	3 876 USD	14 820 PLN	2020-01-08
Pozycja krótką	FX Swap EUR JPY 18.12.2019 08.01.2020	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	2	1 133 EUR	138 101 JPY	2020-01-08
Pozycja krótką	FX Swap ZAR PLN 13.12.2019 13.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-134	14 078 ZAR	3 677 PLN	2020-01-13
Pozycja krótką	FX Swap EUR PLN 17.12.2019 14.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	368	18 960 EUR	81 169 PLN	2020-01-14
Pozycja krótką	FX Swap HUF PLN 16.12.2019 16.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	34	414 681 HUF	5 397 PLN	2020-01-16
Pozycja krótką	FX Swap CHF PLN 23.12.2019 23.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-23	1 843 CHF	7 216 PLN	2020-01-23
Pozycja krótką	FX Swap ILS PLN 03.01.2019 03.02.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-1 865	25 479 ILS	26 154 PLN	2020-02-03
Pozycja dłużna	FX Swap ILS PLN 22.03.2019 03.02.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	993	27 027 PLN	25 479 ILS	2020-02-03
Pozycja krótką	FX Swap USD PLN 06.06.2019 05.06.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-87	8 000 USD	30 285 PLN	2020-06-05

<b>Typ zajętej pozycji</b>	<b>Nazwa instrumentu pochodnego</b>	<b>Rodzaj instrumentu pochodnego</b>	<b>Cel otwarcia pozycji</b>	<b>Wartość otwartej pozycji (w tys. zł)</b>	<b>Terminy i warunki przyszłych strumieni pieniężnych</b>	<b>Kwota będąca podstawa przyszłych płatności (w tys. zł)</b>	<b>Data zapadalności</b>
Pozycja krótką	10 Year US Treasury Note Mar 20	TYH0	sprawne zarządzanie portfelem	97	Codziennie na podstawie kursu roliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-12-19
Pozycja krótką	EURO-BUND FUTURE MAR20	RXH0	sprawne zarządzanie portfelem	117	Codziennie na podstawie kursu roliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2020-03-06
Pozycja dłuża	IRS RUB 30.04.2021 (SW30042021N001)	IRS RUB 30.04.2021	sprawne zarządzanie portfelem	1 056	Platności roczne wg stopy 8,32% Platności kwartałne wg stopy RUBOR3M	26 000	2021-04-30
Pozycja dłuża	IRS BRL 02.01.2023 (SW02012023N002)	IRS BRL 02.01.2023	sprawne zarządzanie portfelem	104	Platność 1D wg stopy 5,98% Platności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	18 885	2023-01-02
Pozycja dłuża	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	sprawne zarządzanie portfelem	183	Platności roczne wg stopy 7,22% Platności kwartałne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja dłuża	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N010)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	1	Platności 1D wg stopy 6,40% Platności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	10 299	2025-01-02
Pozycja dłuża	IRS MXN 21.10.2039 (SW21102039N001)	IRS MXN 21.10.2039	sprawne zarządzanie portfelem	27	Platności 1D wg stopy 7,195% Platności 1D wg stopy MXN-TIE	17 000	2039-10-21