

NOTA-2 NALEŻNOŚCI FUNDUSZU	2021-06-30	2020-12-31
1. Z tytułu zbytych lokat	0	0
2. Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
3. Z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0	0
4. Z tytułu dywidendy	1 534	31
5. Z tytułu odsetek	0	0
6. Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0	0
7. Z tytułu udzielonych pożyczek	0	0
8. Pozostałe	6	0

NOTA-3 ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	2021-06-30	2020-12-31
1. Z tytułu nabytych aktywów	0	0
2. Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	0	0
3. Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
4. Z tytułu wpłat na certyfikaty inwestycyjne	0	0
5. Z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0	0
6. Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0	0
7. Z tytułu wypłaty przychodów funduszu	0	0
8. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0	0
9. Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów	0	0
10. Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów	0	0
11. Z tytułu gwarancji lub poręczeń	0	0
12. Z tytułu rezerw	265	200
13. Pozostałe	1	1

NOTA-4 PIENIĘŻNE I ICH EKWIWALENTY	Waluta	2021-06-30		2020-12-31	
		Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
I. Struktura środków pieniężnych na rachunkach bankowych - Banki	PLN	806	806	710	710
DOM MAKLERSKI BANKU OCHRONY ŚRODOWISKA S.A.	PLN	253	253	289	289
MBANK S.A.	PLN	553	553	421	421
II. Średni w okresie sprawozdawczym poziom środków pieniężnych:	PLN	859	859	621	621
III. Ekwiwalenty środków pieniężnych w podziale na ich rodzaje	PLN	0	0	0	0

NOTA-5 I. RYZYKO STOPY PROCENTOWEJ - RYZYKO WARTOŚCI GODZIWEJ (*)	2021-06-30		2020-12-31	
	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem
Środki pieniężne i ekwiwalenty	806	0,47%	710	0,55%
Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	0	0	0	0
Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku	0	0	0	0

(\*) Jako aktywa obciążone ryzykiem wartości godziwej wynikającym ze stopy procentowej traktuje się środki pieniężne, depozyty oraz stałokuponowe i zerokuponowe dłużne instrumenty finansowe.

NOTA-5 II. RYZYKO STOPY PROCENTOWEJ - RYZYKO PRZEPLYWU ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH (**)(***)	2021-06-30		2020-12-31	
	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem
Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	0	0	0	0
Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku	0	0	0	0
Zobowiązania	0	0	0	0

(\*\*) Jako aktywa obciążone ryzykiem przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej traktuje się zmiennokuponowe dłużne instrumenty finansowe oraz instrumenty pochodne na stopę procentową których wycena na dzień bilansowy jest dodatnia.

(\*\*\*) Jako zobowiązania obciążone ryzykiem przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej traktuje się instrumenty pochodne na stopę procentową których wycena na dzień bilansowy jest ujemna, oraz inne zobowiązania o zmiennym oprocentowaniu.

NOTA-5 III. RYZYKO KREDYTOWE - RYZYKO NIEDOTRZYMANIA ZOBOWIĄZAŃ PRZEZ DRUGĄ STRONĘ TRANSAKCJI	2021-06-30		2020-12-31	
	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem
Kwoty odzwierciedlające maksymalne obciążenie ryzykiem kredytowym w przypadku gdyby strony transakcji nie wypełniały swoich obowiązków, przy czym nie uwzględnia się wartości godziwych dodatkowych zabezpieczeń (****)	2 346	1,35%	741	0,57%
Środki na rachunkach bankowych	806	0,47%	710	0,55%
Należności	1 540	0,89%	31	0,02%
Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka kredytowego w poszczególnych kategoriach lokat w podziale na kategorie bilansowe (*****)	0	0	0	0

(\*\*\*\*) Za maksymalne obciążenie ryzykiem kredytowym traktuje się poziom 100% wartości bilansowej brutto środków pieniężnych, depozytów, należności, dłużnych instrumentów finansowych i niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych których wycena na dzień bilansowy jest dodatnia oraz transakcji typu buy-sell-back.

(\*\*\*\*\*) Za znaczącą koncentrację ryzyka kredytowego traktuje się poziom 10% udziału lokat w/u danego emitenta w aktywach ogółem.

NOTA-5 IV. RYZYKO WALUTOWE (*****)	2021-06-30			2020-12-31		
	Wartość na dzień bilansowy w walucie składnika w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem	Wartość na dzień bilansowy w walucie składnika w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem
Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka walutowego w poszczególnych kategoriach lokat w podziale na kategorie bilansowe (*****)	0	0	0	0	0	0

(\*\*\*\*\*) Za znaczącą koncentrację ryzyka walutowego traktuje się poziom 10% udziału lokat w danej walucie w aktywach ogółem.

NOTA-6 INSTRUMENTY POCODNE	2021-06-30								
	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
Kontrakt Futures indeks giełdowy MWIG40 BMU1 2021.09.18 (PLOGF0022335)	Długa	Futures	sprawne zarządzanie portfelem inwestycyjnym	0	0	Każdego dnia roboczego	0	2021-09-17	2021-09-17

NOTA-6 INSTRUMENTY POCODNE	2020-12-31								
	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
Kontrakt Futures indeks giełdowy MWIG40 FW40H21 2021.03.19 (PLOGF0021097)	Długa	Futures	sprawne zarządzanie portfelem inwestycyjnym	0	0	Każdego dnia roboczego	0	2021-03-19	2021-03-19

NOTA-7 TRANSAKCJE PRZY ZOBOWIĄZANIU SIĘ FUNDUSZU LUB DRUGIEJ STRONY DO ODKUPU	2021-06-30	2020-12-31
<b>I. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu, w tym:</b>	0	0
1. Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na fundusz praw własności i ryzyk	0	0
2. Transakcje, w wyniku których nie następuje przeniesienie na fundusz praw własności i ryzyk	0	0
<b>II. Transakcje przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu, w tym:</b>	0	0
1. Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na drugą stronę praw własności i ryzyk	0	0
2. Transakcje, w wyniku których nie następuje przeniesienie na drugą stronę praw własności i ryzyk	0	0
<b>III. Należności z tytułu papierów wartościowych pożyczonych od funduszu w trybie przepisów rozporządzenia o pożyczkach papierów wartościowych</b>	0	0
<b>IV. Zobowiązania z tytułu papierów wartościowych pożyczonych przez fundusz w trybie przepisów rozporządzenia o pożyczkach papierów wartościowych</b>	0	0