

NOTA 6 INSTRUMENTY POCHODNE

Dane na dzień 31 grudnia 2018 r.

Typ zajętej pozycji	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 krótka	Forward	ograniczenie ryzyka walutowego	-1	200	USD	751	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	Forward	sprawne zarządzanie portfelem	-24	44 000	CZK	7 339	PLN	2019-01-23
Pozycja krótka	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	75	4 000	EUR	17 197	PLN	2019-01-02
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	45	13 664	USD	51 417	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-22	918	USD	3 428	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-27	6 960	RON	6 396	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	25	943	USD	3 569	PLN	2019-01-07
Pozycja krótka	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	114	1 366	EUR	175 392	JPY	2019-01-09
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-19	31 455	JPY	1 055	PLN	2019-01-10
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-150	11 754	EUR	50 423	PLN	2019-01-11
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-2	1 682	EUR	7 235	PLN	2019-01-14
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-6	181 173	HUF	2 424	PLN	2019-01-29
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	3	103 648	HUF	1 393	PLN	2019-01-29
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	31	1 861	CHF	7 160	PLN	2019-02-21
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-17	2 190	EUR	9 488	PLN	2019-06-07
Pozycja krótka	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-26	3 186	EUR	13 800	PLN	2019-06-07

Typ zajętej pozycji	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	COJ9	sprawne zarządzanie portfelem	109	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez ICE Futures Europe Commodities	Nie dotyczy	2019-02-28
Pozycja krótka	UBH9	sprawne zarządzanie portfelem	-142	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja długa	UBH9	sprawne zarządzanie portfelem	305	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego	Nie dotyczy	2019-03-07

				podawanego przez Eurex Exchange		
Pozycja długa	RXH9	sprawne zarządzanie portfelem	65	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja krótka	RXH9	sprawne zarządzanie portfelem	-82	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja długa	TYH9	sprawne zarządzanie portfelem	1 182	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja krótka	TYH9	sprawne zarządzanie portfelem	-1 317	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja długa	WNH9	sprawne zarządzanie portfelem	41	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja długa	FVH9	sprawne zarządzanie portfelem	46	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-29
Pozycja krótka	FVH9	sprawne zarządzanie portfelem	-52	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-29
Pozycja długa	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	1 178	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja krótka	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	-7 650	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja krótka	ERZO	sprawne zarządzanie portfelem	-291	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez ICE Futures Europe Financials	Nie dotyczy	2020-12-14
Pozycja długa	IRS ZAR 03.01.2019	sprawne zarządzanie portfelem	133	Płatności kwartalne wg stopy ZARL3M Płatności kwartalne wg stopy 8 48%	25 000	2019-01-03
Pozycja długa	IRS ILS 23.11.2021	sprawne zarządzanie portfelem	45	Płatności kwartalne wg stopy ILSL3M Płatności roczne wg stopy 1 445%	60 000	2021-11-23
Pozycja długa	IRS PLN 20.11.2023	sprawne zarządzanie portfelem	-161	Płatności roczne wg stopy 2 5125% Płatności półroczne wg stopy	8 400	2023-11-20

				PLNW6M		
Pozycja długa	IRS PLN 26.11.2023	sprawne zarządzanie portfelem	-159	Płatności roczne wg stopy 2.445% Płatności półroczne wg stopy PLNW6M	10 000	2023-11-26

Typ zajętej pozycji	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 wygaśnięcia
Pozycja długa	OPCJA	sprawne zarządzanie portfelem	172	Nie dotyczy	Nie dotyczy	2019-03-15