

NOTA 6 - INSTRUMENTY POCHODNE

BPH Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Bezpieczna Inwestycja 1
na dzień 30.06.2016

	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
FUTURES, Indeks WIG20, FW20U1620, 2016-09-16 (PLOGF0009316)	krótka	kontrakt terminowy	sprawne zarządzanie portfelem	526 tys. zł.	-	codziennie	524 tys. zł.	2016-09-16	-

Kwotę będącą podstawą przyszłych płatności stanowi wycena instrumentu na dzień 30/06/2016