

Nota-6 Instrumenty pochodne

| Typ zajętej pozycji | Rodzaj instrumentu pochodnego | Cel otwarcia pozycji | Wartość otwartej pozycji | Wartość i terminy przyszłych strumieni pieniężnych | Kwota będąca podstawą przyszłych płatności | Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego | Termin wykonania instrumentu pochodnego |
|---------------------|--|-------------------------------|--------------------------|---|--|--|---|
| Długa | Opcja Call na parę walut USD/JPY | Sprawne zarządzanie portfelem | 0 | Opcja daje prawo nabycia instrumentu bazowego w dniu 03-08-2016 po cenie wykonania uzgodnionej z kontrahentem. | Nie dotyczy | 2016-08-03 | 2016-08-03 |
| Długa | Opcja Call na Indeks DAX | Sprawne zarządzanie portfelem | 20 | Opcja daje prawo nabycia instrumentu bazowego w dniu 19-08-2016 po cenie wykonania uzgodnionej z kontrahentem. | Nie dotyczy | 2016-08-19 | 2016-08-19 |
| Krótką | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | -256 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 40 904 tys. BRL | 2018-01-02 | 2018-01-02 |
| Długa | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | 179 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 41 295 tys. BRL | 2018-01-02 | 2018-01-02 |
| Długa | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | 238 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 91 000 tys. ZAR | 2018-03-21 | 2018-03-21 |
| Długa | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | 233 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 91 000 tys. ZAR | 2018-03-21 | 2018-03-21 |
| Krótką | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | -486 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 25 400 tys. ZAR | 2026-03-18 | 2026-03-18 |

| | | | | | | | |
|--------|--|-------------------------------|------|---|-----------------|------------|------------|
| Krótką | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | -481 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 25 400 tys. ZAR | 2026-03-18 | 2026-03-18 |
| Długa | Kontrakt terminowy na stopę procentową | Sprawne zarządzanie portfelem | 575 | Instrument generuje przepływy pieniężne z częstotliwością określoną w umowie z kontrahentem, oparte na stawce z rynku międzybankowego i uzgodnionego z kontrahentem oprocentowania. | 76 000 tys. ILS | 2018-08-14 | 2018-08-14 |
| Krótką | Kontrakt terminowy na kurs waluty USD | Zabezpieczenie pozycji | -702 | Instrument generuje przepływy pieniężne w dniu 2016-07-05, oparte na kursie waluty uzgodnionym z kontrahentem. | -7 046 tys. USD | 2016-07-05 | 2016-07-05 |
| Krótką | Kontrakt terminowy na kurs waluty EUR | Zabezpieczenie pozycji | -428 | Instrument generuje przepływy pieniężne w dniu 2016-07-05, oparte na kursie waluty uzgodnionym z kontrahentem. | -6 865 tys. EUR | 2016-07-05 | 2016-07-05 |
| Długa | Kontrakt terminowy na kurs waluty CHF | Sprawne zarządzanie portfelem | -11 | Instrument generuje przepływy pieniężne w dniu 2016-07-07, oparte na kursie waluty uzgodnionym z kontrahentem. | 2 000 tys. CHF | 2016-07-07 | 2016-07-07 |
| Krótką | Kontrakt terminowy na kurs waluty EUR | Zabezpieczenie pozycji | 22 | Instrument generuje przepływy pieniężne w dniu 2016-07-05, oparte na kursie waluty uzgodnionym z kontrahentem. | -1 442 tys. EUR | 2016-07-05 | 2016-07-05 |
| Długa | Kontrakt terminowy na kurs waluty EUR | Sprawne zarządzanie portfelem | 7 | Instrument generuje przepływy pieniężne w dniu 2016-07-04, oparte na kursie waluty uzgodnionym z kontrahentem. | 1 620 tys. EUR | 2016-07-04 | 2016-07-04 |