

| NOTA-5 I. RYZYKO STOPY PROCENTOWEJ - RYZYKO WARTOŚCI GODZIWEJ (*) | 2020-06-30 | |
|---|--|--|
| | Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys. | Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem |
| Środki pieniężne i ekwiwalenty | 2 224 | 35,86% |
| Składniki lokat notowane na aktywnym rynku | - | - |
| Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku | - | - |
| Suma: | 2 224 | 35,86% |

(*) 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 (**) (***) | 2020-06-30 | |
|---|--|--|
| | Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys. | Procentowy udział w aktywach (w tys.) ogółem |
| Składniki lokat notowane na aktywnym rynku | - | - |
| Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku | - | - |
| Zobowiązania | - | - |
| Suma: | - | - |

(**) 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 TRANSAKЦИИ | 2020-06-30 | |
|---|--|--|
| | 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 (****) | 2 253 | 36,32% |
| Środki na rachunkach bankowych | 2 224 | 35,86% |
| Należności | 29 | 0,46% |
| Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka kredytowego w poszczególnych kategoriach lokat w podziale na kategorie bilansowe (*****) | 2 090 | 33,70% |
| DOM MAKLERSKI BANKU OCHRONY ŚRODOWISKA S.A. | 2 090 | 33,70% |
| Środki na rachunkach bankowych | 2 090 | 33,70% |

(****) 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 (*****) | 2020-06-30 | | |
|---|---|--|--|
| | 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 (*****) | - | - | - |
| Suma: | - | - | - |

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