

NOTA 6 Instrumenty pochodne

W przypadku walutowych niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych, wykazane w tabeli przyszłe płatności Funduszu i kontrahenta są wyliczane na podstawie kursu ustalonego przez strony kontraktu w trakcie zawierania transakcji.

Instrumenty pochodne według stanu na dzień 30 czerwca 2019 r.

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	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	FX Swap EUR PLN 25.06.2019 02.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	171	20 319	EUR	86 567	PLN	2019-07-02
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 26.06.2019 02.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	3	1 401	EUR	5 958	PLN	2019-07-02
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 21.06.2019 05.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	501	6 761	USD	25 734	PLN	2019-07-05
Pozycja krótka	FX Swap ZAR PLN 21.06.2019 05.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-8	1 819	ZAR	472	PLN	2019-07-05
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 21.06.2019 05.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	8	110	USD	419	PLN	2019-07-05
Pozycja krótka	FX Swap ZAR PLN 24.06.2019 05.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-4	3 035	ZAR	795	PLN	2019-07-05
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 28.06.2019 05.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	6	360	USD	1 349	PLN	2019-07-05
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 25.06.2019 09.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-1	350	USD	1 305	PLN	2019-07-09
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 02.07.2019 09.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-1	10 700	EUR	45 470	PLN	2019-07-09
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 02.07.2019 09.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-1	10 840	EUR	46 055	PLN	2019-07-09
Pozycja krótka	FX Swap EUR JPY 26.06.2019 10.07.2019	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-15	1 130	EUR	138 101	JPY	2019-07-10
Pozycja krótka	FX Swap HUF PLN 28.06.2019 29.07.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	42	970 093	HUF	12 801	PLN	2019-07-29
Pozycja krótka	FX Swap CHF PLN 21.05.2019 21.08.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-9	1 861	CHF	7 148	PLN	2019-08-21
Pozycja krótka	FX Swap ILS PLN 03.01.2019 03.02.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-747	25 479	ILS	26 154	PLN	2020-02-03
Pozycja długa	FX Swap ILS PLN 22.03.2019 03.02.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-118	27 027	PLN	25 479	ILS	2020-02-03
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 06.06.2019 05.06.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	546	8 000	USD	30 285	PLN	2020-06-05

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	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 długa	10 Year US Treasury Note Sep 19	TYU9	sprawne zarządzanie portfelem	-752	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-09-19
Pozycja krótka	10 Year US Treasury Note Sep 19	TYU9	sprawne zarządzanie portfelem	403	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-09-19
Pozycja długa	5-Year US Treasury Note Sep19	FVU9	sprawne zarządzanie portfelem	-12	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-09-30
Pozycja krótka	90DAY_EURO\$_FUTR_Dec19	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	-7 704	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja długa	90DAY_EURO\$_FUTR_Dec19	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	-96	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja długa	IRS RUB 30.04.2021 (SW30042021N001)	IRS RUB 30.04.2021	sprawne zarządzanie portfelem	121	Płatności roczne wg stopy 8,32% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	260 000	2021-04-30
Pozycja długa	IRS MXN 09.05.2039 (SW09052039N001)	IRS MXN 09.05.2039	sprawne zarządzanie portfelem	333	Płatności 1D wg stopy 8,45% Płatności 1D wg stopy MXN-TIIE	32 000	2039-05-09

Instrumenty pochodne według stanu na dzień 31 grudnia 2018 r.

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	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 USD PLN 04.01.2019	Forward	ograniczenie ryzyka walutowego	-1	200	USD	751	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	Forward CZK PLN 23.01.2019	Forward	sprawne zarządzanie portfelem	-24	44 000	CZK	7 339	PLN	2019-01-23

Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 31.12.2018 02.01.2019	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	75	4 000	EUR	17 197	PLN	2019-01-02
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 11.12.2018 04.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	45	13 664	USD	51 417	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 21.12.2018 04.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-22	918	USD	3 428	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX Swap RON PLN 21.12.2018 04.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-27	6 960	RON	6 396	PLN	2019-01-04
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 07.12.2018 07.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	25	943	USD	3 569	PLN	2019-01-07
Pozycja krótka	FX Swap EUR JPY 19.12.2018 09.01.2019	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	114	1 366	EUR	175 392	JPY	2019-01-09
Pozycja krótka	FX Swap JPY PLN 10.12.2018 10.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-19	31 455	JPY	1 055	PLN	2019-01-10
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 21.12.2018 11.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-150	11 754	EUR	50 423	PLN	2019-01-11
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 14.12.2018 14.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-2	1 682	EUR	7 235	PLN	2019-01-14
Pozycja krótka	FX Swap HUF PLN 29.10.2018 29.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-6	181 173	HUF	2 424	PLN	2019-01-29
Pozycja krótka	FX Swap HUF PLN 23.11.2018 29.01.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	3	103 648	HUF	1 393	PLN	2019-01-29
Pozycja krótka	FX Swap CHF PLN 21.11.2018 21.02.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	31	1 861	CHF	7 160	PLN	2019-02-21
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 07.12.2018 07.06.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-17	2 190	EUR	9 488	PLN	2019-06-07
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 07.12.2018 07.06.2019	FX swap	ograniczenie ryzyka walutowego	-26	3 186	EUR	13 800	PLN	2019-06-07

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	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	BRENT CRUDE FUTR Apr19	COJ9	sprawne zarządzanie portfelem	109	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez ICE Futures Europe Commodities	Nie dotyczy	2019-02-28
Pozycja krótka	EURO BUXL 30Y BND Mar19	UBH9	sprawne zarządzanie portfelem	-142	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07

Pozycja długa	EURO BUXL 30Y BND Mar19	UBH9	sprawne zarządzanie portfelem	305	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja długa	EURO-BUND FUTURE MAR19	RXH9	sprawne zarządzanie portfelem	65	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja krótka	EURO-BUND FUTURE MAR19	RXH9	sprawne zarządzanie portfelem	-82	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2019-03-07
Pozycja długa	10 Year US Treasury Note Mar 19	TYH9	sprawne zarządzanie portfelem	1 182	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja krótka	10 Year US Treasury Note Mar 19	TYH9	sprawne zarządzanie portfelem	-1 317	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja długa	Ultra Long Term US Treasury Bond Mar19	WNH9	sprawne zarządzanie portfelem	41	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-20
Pozycja długa	5-Year US Treasury Note Mar19	FVH9	sprawne zarządzanie portfelem	46	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-29
Pozycja krótka	5-Year US Treasury Note Mar19	FVH9	sprawne zarządzanie portfelem	-52	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-03-29
Pozycja długa	90DAY_EURO\$_FUTR_Dec19	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	1 178	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja krótka	90DAY_EURO\$_FUTR_Dec19	EDZ9	sprawne zarządzanie portfelem	-7 650	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Mercantile Exchange	Nie dotyczy	2019-12-18
Pozycja krótka	3MO EURO EUROIBOR 12/14/2020	ERZ0	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 (SW11122028N001)	IRS ZAR 03.01.2019	sprawne zarządzanie portfelem	133	Płatności kwartalne wg stopy ZARL3M Płatności kwartalne wg stopy 8,48%	25000	43468
Pozycja długa	IRS ILS 23.11.2021 (SW23112021N001)	IRS ILS 23.11.2021	sprawne zarządzanie portfelem	45	Płatności kwartalne wg stopy ILSL3M Płatności roczne wg stopy 1,445%	60000	44523
Pozycja długa	IRS PLN 20.11.2023 (SW20112023N001)	IRS PLN 20.11.2023	sprawne zarządzanie portfelem	-161	Płatności roczne wg stopy 2,5125% Płatności półroczne wg stopy PLNW6M	8400	45250
Pozycja długa	IRS PLN 26.11.2023 (SW26112023N001)	IRS PLN 26.11.2023	sprawne zarządzanie portfelem	-159	Płatności roczne wg stopy 2,445% Płatności półroczne wg stopy PLNW6M	10000	45256

Typ zajętej pozycji	Nazwa instrumentu pochodnego	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	S&P500_EMINI__OPTN_Mar19P (EMNIOP0MAR19)	OPCJA	sprawne zarządzanie portfelem	172	Nie dotyczy	Nie dotyczy	2019-03-15