

**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 2020 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 USD PLN 19.06.2020 03.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-334	13 936	USD	55 138	PLN	2020-07-03
Pozycja krótka	FX Swap USD PLN 19.06.2020 03.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-10	2 350	USD	9 344	PLN	2020-07-03
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 16.06.2020 07.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-293	12 553	EUR	55 774	PLN	2020-07-07
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 17.06.2020 07.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-5	330	EUR	1 469	PLN	2020-07-07
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 25.06.2020 07.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-7	260	EUR	1 154	PLN	2020-07-07
Pozycja krótka	FX Swap ZAR PLN 24.06.2020 08.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-26	14 087	ZAR	3 206	PLN	2020-07-08
Pozycja krótka	FX Swap RUB PLN 18.06.2020 17.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-30	67 917	RUB	3 795	PLN	2020-07-17
Pozycja krótka	FX Swap EUR JPY 26.06.2020 27.07.2020	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	-24	1 148	EUR	138 101	JPY	2020-07-27
Pozycja krótka	FX Swap HUF PLN 29.06.2020 29.07.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	25	445 007	HUF	5 597	PLN	2020-07-29
Pozycja krótka	FX Swap CHF PLN 27.02.2020 26.02.2021	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-104	1 843	CHF	7 657	PLN	2021-02-26

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	GOLD 100 OZ FUTR Aug20	GCQO	sprawne zarządzanie portfelem	107	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Commodity Exchange, Inc.	Nie dotyczy	2020-08-31
Pozycja krótka	10 Year US Treasury Note Sep 20	TYU0	sprawne zarządzanie portfelem	11	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2020-09-21

Pozycja długa	IRS RUB 08.06.2022 (SW08062022N001)	IRS RUB 08.06.2022	sprawne zarządzanie portfelem	64	Płatności roczne wg stopy 4,93% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	290 000	2022-06-08
Pozycja długa	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	sprawne zarządzanie portfelem	716	Płatności roczne wg stopy 7,22% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N011)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	191	Płatności 1D wg stopy 6,435% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	7 497	2025-01-02
Pozycja krótka	IRS PLN 29.06.2025 (SW29062025N001)	IRS PLN 29.06.2025	sprawne zarządzanie portfelem	14	Płatności półroczne wg stopy PLNW6M Płatności roczne wg stopy 0,52%	13 900	2025-06-29
Pozycja długa	IRS MXN 18.05.2040 (SW18052040N001)	IRS MXN 18.05.2040	sprawne zarządzanie portfelem	47	Płatności 1D wg stopy 6,49% Płatności 1D wg stopy MXN-TIE	16 000	2040-05-18

**Instrumenty pochodne według stanu na dzień 31 grudnia 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 USD PLN 18.12.2019 08.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	101	3 876	USD	14 820	PLN	2020-01-08
Pozycja krótka	FX Swap EUR JPY 18.12.2019 08.01.2020	FX swap	sprawne zarządzanie portfelem	2	1 133	EUR	138 101	JPY	2020-01-08
Pozycja krótka	FX Swap ZAR PLN 13.12.2019 13.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-134	14 078	ZAR	3 677	PLN	2020-01-13
Pozycja krótka	FX Swap EUR PLN 17.12.2019 14.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	368	18 960	EUR	81 169	PLN	2020-01-14
Pozycja krótka	FX Swap HUF PLN 16.12.2019 16.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	34	414 681	HUF	5 397	PLN	2020-01-16
Pozycja krótka	FX Swap CHF PLN 23.12.2019 23.01.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-23	1 843	CHF	7 216	PLN	2020-01-23
Pozycja krótka	FX Swap ILS PLN 03.01.2019 03.02.2020	FX swap	ograniczenie ryzyka inwestycyjnego	-1 865	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 inwestycyjnego	993	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 inwestycyjnego	-87	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 krótka	10 Year US Treasury Note Mar 20	TYH0	sprawne zarządzanie portfelem	97	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Chicago Board of Trade	Nie dotyczy	2019-12-19
Pozycja krótka	EURO-BUND FUTURE MAR20	RXH0	sprawne zarządzanie portfelem	117	Codziennie na podstawie kursu rozliczeniowego podawanego przez Eurex Exchange	Nie dotyczy	2020-03-06
Pozycja długa	IRS RUB 30.04.2021 (SW30042021N001)	IRS RUB 30.04.2021	sprawne zarządzanie portfelem	1 056	Płatności roczne wg stopy 8,32% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	260 000	2021-04-30
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2023 (SW02012023N002)	IRS BRL 02.01.2023	sprawne zarządzanie portfelem	104	Płatności 1D wg stopy 5,98% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	18 885	2023-01-02
Pozycja długa	IRS RUB 03.10.2024 (SW03102024N001)	IRS RUB 03.10.2024	sprawne zarządzanie portfelem	183	Płatności roczne wg stopy 7,22% Płatności kwartalne wg stopy RUBOR3M	110 000	2024-10-03
Pozycja długa	IRS BRL 02.01.2025 (SW02012025N010)	IRS BRL 02.01.2025	sprawne zarządzanie portfelem	1	Płatności 1D wg stopy 6,40% Płatności 1D wg stopy BRL-DI-PRE	10 299	2025-01-02
Pozycja długa	IRS MXN 21.10.2039 (SW21102039N001)	IRS MXN 21.10.2039	sprawne zarządzanie portfelem	27	Płatności 1D wg stopy 7,195% Płatności 1D wg stopy MXN-TIIE	17 000	2039-10-21