

Portfel Funduszu na dzień 30 czerwca 2020 roku cechował się koncentracją branżową. Fundusz posiadał największe zaangażowania w sektory: deweloperski, paliwowo-energetyczny, pożyczkowy, hotelarski i chemiczny. Papiery wartościowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność deweloperską stanowią na dzień 30 czerwca 2020r. ok. 44,4% wartości aktywów netto Funduszu. Papiery wartościowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność w sektorze paliwowo-energetycznym stanowią na dzień 30 czerwca 2020r. ok. 12,2% wartości aktywów netto Funduszu. Z kolei papiery wartościowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność w sektorze pożyczkowym stanowią na dzień 30 czerwca 2020r. ok. 10,9% wartości aktywów netto Funduszu. Papiery wartościowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność w sektorze hotelarskim stanowią na dzień 30 czerwca 2020r. ok. 2,8% wartości aktywów netto Funduszu. Papiery wartościowe emitowane przez podmioty prowadzące działalność w sektorze chemicznym stanowią na dzień 30 czerwca 2020r. ok. 2,7% wartości aktywów netto Funduszu. Ze względu na trudności w przypisaniu niektórych emitentów do konkretnego sektora podane wielkości są orientacyjne.

6. INSTRUMENTY POCHODNE

		2020-06-30							
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	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
Niewystandaryzowane instrumenty pochodne									
Forward									
Forward EUR/PLN, 2020.07.16 (-)	Krótką	Forward	Zabezpieczenie przed ryzykiem walutowym	76	-	2020-07-16	1.000.000,00 EUR po kursie walutowym 4.5432000000 PLN	2020-07-16	2020-07-16
		2019-12-31							
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	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
Niewystandaryzowane instrumenty pochodne									
Forward									
Forward EUR/PLN, 2020.01.16 (-)	Krótką	Forward	Zabezpieczenie przed ryzykiem walutowym	55	-	2020-01-16	1.002.895,00 EUR po kursie walutowym 4.3168000000 PLN	2020-01-16	2020-01-16