

PEKAO TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH SPÓŁKA AKCYJNA

02-674 Warszawa, ul. Marynarska 15

OGŁASZA

PÓŁROCZNE SPRAWOZDANIE JEDNOSTKOWE*

**PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
subfunduszu w PEKAO FUNDUSZU INWESTYCYJNYM OTWARTYM**

ZA OKRES PÓŁROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 30 CZERWCA 2019 ROKU

* Sprawozdanie jednostkowe jest załącznikiem do połączonego sprawozdania funduszu Pekao Fundusz Inwestycyjny Otwarty

Oświadczenie Zarządu Pekao TFI S.A.

Zarząd Pekao TFI S.A., zgodnie z wymogami art. 52 *Ustawy* z dnia 29 września 1994 roku o *rachunkowości* (t.j. Dz.U. z 2019. poz. 351) przedstawia półroczne jednostkowe sprawozdanie finansowe subfunduszu

Pekao Konserwatywny Plus (wydzielonego w Pekao Fundusz Inwestycyjny Otwarty)

na które składają się:

1. zestawienie lokat subfunduszu według stanu na dzień 30 czerwca 2019 o wartości 2 945 542 tys. zł;
2. bilans subfunduszu na dzień 30 czerwca 2019 wykazujący wartość aktywów netto subfunduszu w kwocie 1 969 828 tys. zł;
3. rachunek wyniku z operacji subfunduszu za okres od 1 stycznia 2019 do 30 czerwca 2019 wykazujący wynik z operacji w kwocie 19 605 tys. zł;
4. połączone zestawienie zmian w aktywach netto subfunduszu;
5. (i) noty objaśniające;
(ii) informację dodatkową.

Zgodnie z przepisami (*Ustawa* o rachunkowości oraz *Rozporządzenie* Ministra Finansów z dnia 24 grudnia 2007 r. w sprawie szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych [Dz.U. nr 249, poz. 1859]), Zarząd Pekao Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych zapewnił sporządzenie sprawozdania jednostkowego Subfunduszu za okres półroczny (od 1 stycznia 2019) kończący się 30 czerwca 2019, przedstawiającego prawidłowy i rzetelny obraz sytuacji majątkowej i finansowej Subfunduszu na dzień bilansowy oraz jego wyniku z operacji.

Zarząd Pekao Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. potwierdza przestrzeganie przy sporządzaniu niniejszego sprawozdania przepisów *Ustawy* o rachunkowości oraz wspomnianego wyżej *Rozporządzenia*.

Zarząd Pekao TFI SA:

Jacek Janiuk

Prezes Zarządu

Jacek Babiński

Wiceprezes Zarządu

Grzegorz Barański

Wiceprezes Zarządu

Osoba, której powierzono prowadzenie ksiąg rachunkowych

Zbigniew Czumaj

***Główny Księgowy Funduszy
Dyr. Departamentu Księgowości
Funduszy***

Pekao Towarzystwo
Funduszy Inwestycyjnych S.A.

ul. Marynarska 15
budynek New City
02-674 Warszawa
www.pekaotfi.pl
e-mail: fundusz@pekaotfi.pl

Tel. (+48) 22 640 40 00
Fax (+48) 22 640 40 05
Infolinia: 801 641 641
lub (+48) 22 640 40 40

Spis treści

Zestawienie lokat

Bilans

Rachunek wyniku z operacji

Zestawienie zmian w aktywach netto

Noty objaśniające

Nota - 1 Polityka rachunkowości Funduszu

Przepisy prawne regulujące rachunkowość Funduszu i Subfunduszu

Zasady ogólne / jednakowe dla wszystkich funduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA

Zasady ujawniania i prezentacji informacji w sprawozdaniu finansowym

Ujmowanie operacji dotyczących Subfunduszu w księgach rachunkowych

Wycena aktywów i pasywów Subfunduszu

Wartości szacunkowe

Ustalanie Wartości Aktywów Netto i wyniku z operacji

Zasady szczególne – dotyczące Funduszu / Subfunduszu

Wprowadzone w okresie sprawozdawczym zmiany stosowanych zasad rachunkowości, metod wyceny oraz sposobu sporządzania sprawozdania finansowego

Nota - 2 Należności Subfunduszu

Nota - 3 Zobowiązania Subfunduszu

Nota - 4 Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Nota - 5 Ryzyka

Nota - 6 Instrumenty pochodne

Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych

Nota - 7 Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu

Nota - 8 Kredyty i pożyczki

Nota - 9 Waluty i różnice kursowe

Nota - 10 Dochody i ich dystrybucja

Nota - 11 Koszty Subfunduszu

Nota - 12 Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa

Informacje dodatkowe

A Informacje o znaczących zdarzeniach, dotyczących lat ubiegłych, ujętych w sprawozdaniu finansowym

B Informacje o znaczących zdarzeniach po dniu bilansowym

C Dokonane korekty błędów podstawowych

D Inne informacje

Nazwa Subfunduszu, Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu i ich zbywanie, zarządzający

Metryka Subfunduszu

Zestawienie lokat

Tabela główna

Tabele uzupełniające

Tabele dodatkowe

Bilans

Rachunek wyniku z operacji

Zestawienie zmian w aktywach netto

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - Tabela Główna

SKŁADNIKI LOKAT	30.06.2019			31.12.2018		
	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Akcje	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Warranty subskrypcyjne	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Prawa do akcji	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Prawa poboru	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Kwity depozytowe	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Listy zastawne	47 879	47 951	1.60%	57 898	58 804	2.81%
Dłużne papiery wartościowe	2 792 782	2 834 424	94.43%	1 858 983	1 877 443	89.83%
Instrumenty pochodne	0	-4 840	-0.18%	0	-312	0.01%
Udziały w spółkach z o. o.	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Jednostki uczestnictwa	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Tytuły uczestnictwa zagraniczne	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Wierzytelności	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Weksle	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Depozyty	67 567	68 007	2.26%	40 083	40 359	1.93%
Waluty	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Nieruchomości	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Statki morskie	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Inne	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Suma:	2 908 228	2 945 542	98.11%	1 956 964	1 976 294	94.58%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

LISTY ZASTAWNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu	Warunki oprocentowania	Rodzaj listu	Podstawa emisji	Wartość nominalna	Liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Aktywny rynek nieregulowany											0	0	0.00%
Aktywny rynek regulowany											0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku											47 879	47 951	1.60%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00482)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	10.09.2020	2.82%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1000	40000	40 000	40 062	1.34%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA (PLBPHHP00176)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	24.09.2021	0.52%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1000	1850	7 879	7 889	0.26%
Suma:											47 879	47 951	1.60%

DLUŻNE PAPIERY WARTOŚCIOWE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu	Warunki oprocentowania	Wartość nominalna	Liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
O terminie wykupu do 1 roku									226 776	221 589	7.35%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									226 776	221 589	7.35%
Aktywny rynek nieregulowany									17 310	17 238	0.57%
DS1019 PL0000105441	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.10.2019	5.50 (Stały kupon)	1000	1	1	1	0.00%
PZU Finance AB XS1082661551	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PZU Finance AB	Szwecja	03.07.2019	1.38 (Stały kupon)	1000	3500	15 161	15 092	0.50%
PS0420 PL0000108510	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.04.2020	1.50 (Stały kupon)	1000	1	1	1	0.00%
GLOBE TRADE CENTRE SA Seria PLGTC102019B PLGTC0000219	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Giełda Papierów Wartościowych ASO (Catalyst)	GLOBE TRADE CENTRE SA	Polska	31.10.2019	3.75 (Zmienny kupon)	1000	500	2 147	2 144	0.07%
Nienotowane na aktywnym rynku									209 466	204 351	6.78%
ACTION SA w restrukturyzacji Seria ACT01 040717 PLACTIN00034	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ACTION SA w restrukturyzacji	Polska	04.07.2017	3.19 (Zmienny kupon)	10000	1000	9 992	3 991	0.13%
AB SA Seria AB01 120819 PLAB00000035	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	AB SA	Polska	12.08.2019	3.39 (Zmienny kupon)	10000	50	500	507	0.02%
SYGNITY SA Seria 1/2014 PLCMPLD00172	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SYGNITY SA	Polska	19.12.2017	4.41 (Zmienny kupon)	9431	150	1 415	888	0.03%
TAURON POLSKA ENERGIA SA Seria TPEA1119 PLTAURN00037	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	TAURON POLSKA ENERGIA SA	Polska	04.11.2019	2.69 (Zmienny kupon)	100000	30	3 007	3 018	0.10%
DOM DEVELOPMENT SA Seria DOMDE5120620 PLDMDVL00053	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	DOM DEVELOPMENT SA	Polska	12.06.2020	3.69 (Zmienny kupon)	10000	250	2 500	2 508	0.08%
CAPITAL PARK SA Seria K PLCPPRK00136	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	CAPITAL PARK SA	Polska	27.04.2020	4.10 (Stały kupon)	100	7000	3 019	3 001	0.10%
J.W. CONSTRUCTION HOLDING SA Seria JWC0520 PLJWC0000118	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.W. CONSTRUCTION HOLDING SA	Polska	29.05.2020	4.79 (Zmienny kupon)	500	2500	1 250	1 260	0.04%
ATAL S.A. Seria AF PLATAL000103	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ATAL S.A.	Polska	02.10.2019	3.49 (Zmienny kupon)	1000	5120	5 120	5 163	0.17%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL008 270320	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	27.03.2020	2.34 (Zmienny kupon)	10000	3000	30 000	30 006	1.00%
Santander Bank Polska (Emitent) Seria BPW H PLBZ00000291	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	27.09.2019	2.25 (Stały kupon)	1000	45000	45 000	46 018	1.53%
Archicom Spółka Akcyjna Seria M2/2017 PLARHCM00057	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Archicom Spółka Akcyjna	Polska	10.03.2020	4.14 (Zmienny kupon)	1000	1900	1 902	1 925	0.06%
GLOBE TRADE CENTRE SA Seria PLGTC032021 PLGTC0000235	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GLOBE TRADE CENTRE SA	Polska	31.03.2020	3.75 (Stały kupon)	1000	500	2 141	2 147	0.07%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

MBANK HIPOTECZNY SA Serie BRE [K31]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	14.08.2019	2.16 (Zmienny kupon)	100000	200	20 000	20 102	0.67%
GLOBE TRADE CENTRE SA Serie PLGTC062020 PLGTC0000243	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GLOBE TRADE CENTRE SA	Polska	14.06.2020	3.75 (Stały kupon)	1000	1150	4 940	4 892	0.16%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA Serie O-PBH-001 PLBPHHP00226	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	18.09.2019	2.17 (Zmienny kupon)	10000	2500	25 000	25 019	0.83%
Ronson Europe N.V. Serie M PLRNSER00136	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Ronson Europe N.V.	Holandia	25.02.2020	5.44 (Zmienny kupon)	1000	1000	996	1 016	0.03%
mLeasing Sp z o.o. Serie 030/2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mLeasing Sp z o.o.	Polska	27.09.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	100	9 890	9 947	0.33%
BZ WBK Faktor Sp. z o.o. Serie D PLBZFKT00043	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BZ WBK Faktor Sp. z o.o.	Polska	18.10.2019	2.09 (Zmienny kupon)	1000	21000	21 000	21 014	0.70%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Serie PEKAL027 0111019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	01.10.2019	0.00 (Zerowy kupon)	10000	2000	19 790	19 893	0.66%
Ronson Europe N.V. Serie N PLRNSER00128	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Ronson Europe N.V.	Holandia	16.09.2019	5.39 (Zmienny kupon)	1000	2000	2 004	2 036	0.07%
O terminie wykupu powyżej 1 roku									2 566 006	2 612 835	87.08%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									2 566 006	2 612 835	87.08%
Aktywny rynek nieregulowany									2 060 211	2 102 274	70.07%
WS0922 PL0000102646	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	23.09.2022	5.75 (Stały kupon)	1000	285000	320 762	332 883	11.10%
DS1020 PL0000106126	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.10.2020	5.25 (Stały kupon)	1000	1	1	1	0.00%
Polski Skarb Panstwa US857524AA08	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	21.04.2021	5.13 (Stały kupon)	1000	6750	27 154	26 776	0.89%
Polski Skarb Panstwa US857524AB80	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	23.03.2022	5.00 (Stały kupon)	1000	26378	107 120	107 221	3.57%
PKO FINANCE AB XS0783934085	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PKO FINANCE AB	Szwecja	26.09.2022	4.63 (Stały kupon)	1000	9775	38 293	38 970	1.30%
Polski Skarb Panstwa US731011AT95	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	17.03.2023	3.00 (Stały kupon)	1000	8512	30 117	32 940	1.10%
Polski Skarb Panstwa US857524AC63	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	22.01.2024	4.00 (Stały kupon)	1000	13800	54 069	56 438	1.88%
WZ0124 PL0000107454	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2024	1.79 (Zmienny kupon)	1000	72125	71 362	72 364	2.41%
MFINANCE FRANCE SA XS1143974159	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	MFINANCE FRANCE SA	Francja	26.11.2021	2.00 (Stały kupon)	1000	5323	23 736	23 908	0.80%
DS0726 PL0000108866	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.07.2026	2.50 (Stały kupon)	1000	60000	59 580	62 417	2.08%
WZ0126 PL0000108817	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2026	1.79 (Zmienny kupon)	1000	98992	95 719	98 191	3.27%
PS0421 PL0000108916	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.04.2021	2.00 (Stały kupon)	1000	60000	60 426	60 661	2.02%
PS0721 PL0000109153	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	26.07.2021	1.75 (Stały kupon)	1000	150000	150 360	152 880	5.10%
Polski Skarb Panstwa US731011AU68	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	06.04.2026	3.25 (Stały kupon)	1000	13000	47 775	51 787	1.73%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

ORLEN CAPITAL AB XS1429673327	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	ORLEN CAPITAL AB	Szwecja	07.06.2023	2.50 (Stały kupon)	1000	5000	22 660	22 874	0.76%
WZ1122 PL0000109377	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.11.2022	1.79 (Zmienny kupon)	1000	11500	11 468	11 528	0.38%
PS0422 PL0000109492	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.04.2022	2.25 (Stały kupon)	1000	215000	218 050	219 076	7.30%
PS0123 PL0000110151	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.01.2023	2.50 (Stały kupon)	1000	120000	122 282	124 054	4.14%
ALIOR BANK SA Seria K PLALIOR00219	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Gielda Papierów Wartościowych ASO (Catalyst)	ALIOR BANK SA	Polska	20.10.2025	4.49 (Zmienny kupon)	1000	4000	4 000	4 194	0.14%
Ministry of Finance - Republic of Croatia XS0607904264	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Republic of Croatia	Chorwacja	24.03.2021	6.38 (Stały kupon)	1000	7000	28 324	28 247	0.94%
WZ0524 PL0000110615	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.05.2024	1.79 (Zmienny kupon)	1000	292100	289 153	290 835	9.69%
Ministry of Finance - Czech Republic CZ0001005367	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic	Czechy	23.02.2021	0.75 (Stały kupon)	10000	17000	28 073	28 170	0.94%
Polski Skarb Państwa XS1015428821	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	15.01.2024	3.00 (Stały kupon)	1000	4800	23 098	23 683	0.79%
Polski Skarb Państwa XS0841073793	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	09.07.2024	3.38 (Stały kupon)	1000	15000	74 569	77 054	2.57%
Polski Skarb Państwa XS0479333311	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	20.01.2025	5.25 (Stały kupon)	1000	8000	44 222	44 959	1.50%
mBank SA (Emitent) Seria EMTN XS1876097715	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	mBank SA (Emitent)	Polska	05.09.2022	1.06 (Stały kupon)	1000	4800	20 571	20 955	0.70%
Santander Bank Polska (Emitent) XS1849525057	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	20.09.2021	0.75 (Stały kupon)	1000	8250	35 506	35 702	1.19%
Polski Skarb Państwa XS1288467605	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	09.09.2025	1.50 (Stały kupon)	1000	4000	17 779	18 810	0.63%
CESKE DRAHY XS1991190361	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	CESKE DRAHY	Czechy	23.05.2026	1.50 (Stały kupon)	1000	900	3 823	3 949	0.13%
PS1024 PL0000111720	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	25.10.2024	2.25 (Stały kupon)	1000	30000	30 159	30 747	1.02%
Aktywny rynek regulowany									1 942	1 947	0.06%
WZ0528 PL0000110383	Aktywny rynek regulowany	Warsaw Stock Exchange	Polski Skarb Państwa	Polska	25.05.2028	1.79 (Zmienny kupon)	1000	2000	1 942	1 947	0.06%
Nienotowane na aktywnym rynku									503 853	508 614	16.95%
KRUK SA Seria Z1 PLKRK0000341	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	08.06.2021	4.82 (Zmienny kupon)	1000	1400	1 400	1 405	0.05%
AB SA Seria AB02 290720 PLAB00000043	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	AB SA	Polska	29.07.2020	3.29 (Zmienny kupon)	10000	800	8 000	8 056	0.27%
KRUK SA Seria AA1 PLKRK0000374	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	15.11.2021	4.72 (Zmienny kupon)	1000	5000	5 000	5 047	0.17%
KRUK SA Seria AC1 PLKRK0000408	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	09.05.2022	4.97 (Zmienny kupon)	1000	5000	5 000	5 043	0.17%
ORBIS SA Seria ORB B 290721 PLORBIS00055	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ORBIS SA	Polska	29.07.2021	2.84 (Zmienny kupon)	1000	7500	7 500	7 660	0.26%
ROBYG SA Seria S PLROBYG00230	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ROBYG SA	Polska	23.07.2021	4.69 (Zmienny kupon)	1000	8000	8 016	8 364	0.28%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Santander Bank Polska (Emitent) Seria E PLBZ00000226	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	03.12.2026	2.76 (Zmienny kupon)	1000	5500	24 687	23 434	0.78%
KRUK SA Seria AA4 PLKRK0000465	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	18.10.2022	4.97 (Zmienny kupon)	1000	7000	7 000	7 122	0.24%
ECHO INVESTMENT SA Seria 1/2016 PLECHPS00209	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ECHO INVESTMENT SA	Polska	18.11.2020	4.79 (Zmienny kupon)	10000	300	3 000	3 016	0.10%
EUROPEAN INVESTMENT BANK XS1492818866	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	EUROPEAN INVESTMENT BANK	Luksemburg	25.08.2026	2.75 (Stały kupon)	1000	45000	45 180	47 266	1.58%
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent) Seria OP0827 PLPKO0000099	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent)	Polska	30.08.2027	3.34 (Zmienny kupon)	100000	27	2 700	2 780	0.09%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) Seria BGK1021S015A PL0000500229	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	03.10.2021	2.21 (Zmienny kupon)	1000	8000	8 000	8 042	0.27%
BANK MILLENNIUM SA (Emitent) Seria R PLBIG0000453	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK MILLENNIUM SA (Emitent)	Polska	07.12.2027	4.09 (Zmienny kupon)	500000	19	9 500	9 693	0.32%
J.W. CONSTRUCTION HOLDING SA Seria JWC1120 PLJWC0000126	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.W. CONSTRUCTION HOLDING SA	Polska	16.11.2020	4.79 (Zmienny kupon)	900	2500	2 250	2 268	0.08%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria A PLPEKAO00289	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	29.10.2027	3.31 (Zmienny kupon)	1000	12300	12 300	12 509	0.42%
Ronson Europe N.V. Seria R PLRNSER00177	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Ronson Europe N.V.	Holandia	24.05.2021	4.64 (Zmienny kupon)	1000	2500	2 499	2 525	0.08%
CAPITAL PARK SA Seria M PLPCPRK00151	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	CAPITAL PARK SA	Polska	21.12.2020	4.10 (Stały kupon)	100	11000	4 621	4 683	0.16%
Everest Capital Sp. z o.o. Seria K PLEVRCP00053	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Everest Capital Sp. z o.o.	Polska	08.06.2021	6.79 (Zmienny kupon)	1000	1700	1 700	1 707	0.06%
LOKUM DEWELOPER SA Seria E PLLKMDW00080	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	LOKUM DEWELOPER SA	Polska	18.06.2021	4.89 (Zmienny kupon)	1000	3000	3 000	3 005	0.10%
DEKPOL SA Seria F1	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	DEKPOL SA	Polska	04.01.2022	5.22 (Zmienny kupon)	1000	196	196	196	0.01%
EUROPEAN INVESTMENT BANK XS1791421479	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	EUROPEAN INVESTMENT BANK	Luksemburg	25.02.2025	1.99 (Zmienny kupon)	1000	50000	49 857	50 216	1.67%
GIEŁDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA Seria C PLGPW0000066	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GIEŁDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA	Polska	06.10.2022	3.19 (Stały kupon)	100	149553	15 189	15 280	0.51%
GLOBE TRADE CENTRE SA Seria PLGTC032021 PLGTC0000276	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GLOBE TRADE CENTRE SA	Polska	05.03.2021	3.70 (Zmienny kupon)	1000	1700	7 122	7 314	0.24%
ROBYG SA Seria PA PLROBYG00255	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ROBYG SA	Polska	29.03.2023	4.49 (Zmienny kupon)	1000	6295	6 295	6 367	0.21%
VOLKSWAGEN BANK POLSKA S.A. Seria VWBS00160300 PLVWGBP00191	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	VOLKSWAGEN BANK POLSKA S.A.	Polska	26.10.2020	2.82 (Stały kupon)	100000	50	5 000	5 025	0.17%
ATAL S.A. Seria AH PLATAL000111	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ATAL S.A.	Polska	26.04.2021	3.49 (Zmienny kupon)	1000	2450	2 450	2 465	0.08%
Everest Capital Sp. z o.o. Seria L PLEVRCP00061	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Everest Capital Sp. z o.o.	Polska	09.09.2021	6.79 (Zmienny kupon)	1000	1400	1 400	1 416	0.05%
LC CORP SA Seria LCC011280222 PLLCCRPO0132	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	LC CORP SA	Polska	28.02.2022	4.99 (Zmienny kupon)	1000	5895	5 891	5 990	0.20%
PRIME CAR MANAGEMENT SA Seria 1/2017 PLPRMCM00055	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PRIME CAR MANAGEMENT SA	Polska	21.12.2020	3.42 (Zmienny kupon)	100000	100	10 000	10 008	0.33%
Ronson Europe N.V. Seria T PLRNSER00185	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Ronson Europe N.V.	Holandia	09.05.2022	5.29 (Zmienny kupon)	1000	2500	2 500	2 519	0.08%
UNIBEP SA Seria E PLUNBEP00080	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	UNIBEP SA	Polska	07.06.2021	5.29 (Zmienny kupon)	100	22000	2 200	2 207	0.07%
DEKPOL SA Seria F2	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	DEKPOL SA	Polska	04.01.2022	5.22 (Zmienny kupon)	1000	1000	1 000	1 000	0.03%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

DEKPOL SA Seria F3	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	DEKPOL SA	Polska	04.01.2022	5.22 (Zmienny kupon)	1000	1500	1 500	1 500	0.05%
Voxel Spółka Akcyjna Seria J PLVOXEL00097	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Voxel Spółka Akcyjna	Polska	05.07.2021	5.79 (Zmienny kupon)	1000	1500	1 500	1 542	0.05%
DEKPOL SA Seria F4	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	DEKPOL SA	Polska	04.01.2022	5.22 (Zmienny kupon)	1000	2000	2 000	2 001	0.07%
LC CORP SA Seria LCC006100521 PLLCCRP00082	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	LC CORP SA	Polska	10.05.2021	5.29 (Zmienny kupon)	1000	3000	3 006	3 027	0.10%
ALIOR BANK SA Seria J PLALIOR00201	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ALIOR BANK SA	Polska	11.08.2020	2.98 (Zmienny kupon)	1000	2000	2 003	2 025	0.07%
EUROPEAN INVESTMENT BANK XS0845917342	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	EUROPEAN INVESTMENT BANK	Luksemburg	25.10.2022	4.25 (Stały kupon)	10000	1202	12 805	13 042	0.43%
KRUK SA Seria AE1 PLKRK0000507	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	10.05.2022	3.59 (Zmienny kupon)	1000	1500	6 415	6 383	0.21%
BANK MILLENNIUM SA (Emitent) Seria W PLBIG0000461	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK MILLENNIUM SA (Emitent)	Polska	30.01.2029	4.09 (Zmienny kupon)	500000	36	18 000	18 773	0.63%
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL Seria E005 XS1610672963	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	08.05.2028	2.79 (Zmienny kupon)	100000	200	20 000	20 081	0.67%
Ronson Europe N.V. Seria U PLRNSER00193	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Ronson Europe N.V.	Holandia	31.01.2023	5.29 (Zmienny kupon)	1000	2000	2 000	2 043	0.07%
UNIBEP SA Seria F	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	UNIBEP SA	Polska	15.02.2022	5.29 (Zmienny kupon)	100	20000	1 994	2 034	0.07%
Archicom Spółka Akcyjna Seria M4/2019 AR230601	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Archicom Spółka Akcyjna	Polska	14.06.2023	5.02 (Zmienny kupon)	1000	8000	8 000	8 018	0.27%
ATAL S.A. Seria AP PLATAL000137	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ATAL S.A.	Polska	26.04.2021	3.69 (Zmienny kupon)	1000	1000	1 000	1 007	0.03%
GLOBE TRADE CENTRE SA Seria PLGTC042022 PLGTC0000292	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GLOBE TRADE CENTRE SA	Polska	18.04.2022	3.90 (Stały kupon)	1000	800	3 423	3 428	0.11%
KREDYT INKASO SA Seria F1 PLKRINK00253	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KREDYT INKASO SA	Polska	26.04.2023	6.69 (Zmienny kupon)	1000	12050	12 050	12 192	0.41%
KRUK SA Seria AE4 PLKRK0000556	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	27.03.2025	5.72 (Zmienny kupon)	1000	4000	4 000	4 002	0.13%
LC CORP SA Seria LCC220523OZ3	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	LC CORP SA	Polska	22.05.2023	5.52 (Zmienny kupon)	1000	5500	5 500	5 532	0.18%
MARVIPOL SA Seria Y PLMRVDV00037	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MARVIPOL SA	Polska	12.12.2022	6.04 (Zmienny kupon)	10000	1000	9 900	9 931	0.33%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria D PLPEKAO00313	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	04.06.2031	3.49 (Zmienny kupon)	500000	40	20 000	20 049	0.67%
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA Seria PGE002210526 PLPGER000069	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	Polska	21.05.2026	2.99 (Zmienny kupon)	1000	15000	15 000	15 049	0.50%
ENE SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENE SA	Polska	26.06.2024	2.99 (Zmienny kupon)	100000	310	31 004	31 015	1.03%
FAMUR SA Seria B PLFAMUR00053	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	FAMUR SA	Polska	27.06.2024	4.39 (Zmienny kupon)	1000	8000	8 000	8 003	0.27%
FABRYKI SPRZĘTU I NARZĘDZI GÓRNICZYCH GRUPA KAPITAŁOWA FASING SA Seria A PLFSING00036	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	FABRYKI SPRZĘTU I NARZĘDZI GÓRNICZYCH GRUPA KAPITAŁOWA FASING SA	Polska	27.06.2022	5.29 (Zmienny kupon)	1000	3000	3 000	3 001	0.10%
KRUK SA Seria AH1 PLKRK0000564	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	KRUK SA	Polska	28.06.2025	5.72 (Zmienny kupon)	1000	1300	1 300	1 300	0.04%
MBANK HIPOTECZNY SA Seria BRE [K36]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.06.2021	2.32 (Zmienny kupon)	100000	400	40 000	40 008	1.33%
Suma:									2 792 782	2 834 424	94.43%

INSTRUMENTY POCHODNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent (wystawca)	Kraj siedziby emitenta (wystawcy)	Instrument bazowy	Liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
----------------------	--------------	-------------	--------------------	-----------------------------------	-------------------	--------	--------------------------------	---	-------------------------------------

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Wystandaryzowane instrumenty pochodne							0	0	0.00%
Aktywny rynek regulowany							0	0	0.00%
Aktywny rynek nieregulowany							0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku							0	0	0.00%
Niewystandaryzowane instrumenty pochodne							0	-4 840	-0.18%
Aktywny rynek regulowany							0	0	0.00%
Aktywny rynek nieregulowany							0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku							0	-4 840	-0.18%
Forward Waluta CZK FW907032 17.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	CZK	1	0	0	0.00%
Forward Waluta EUR FW907002 05.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	108	0.00%
Forward Waluta EUR FW907047 05.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	20	0.00%
Forward Waluta EUR FW907065 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	235	0.01%
Forward Waluta EUR FW907085 05.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	52	0.00%
Forward Waluta EUR FW907090 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	27	0.00%
Forward Waluta EUR FW907097 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	19	0.00%
Forward Waluta EUR FW907106 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907110 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	18	0.00%
Forward Waluta EUR FW907111 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907121 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907122 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	3	0.00%
Forward Waluta EUR FW907131 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907132 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	0	0.00%
Forward Waluta EUR FW907139 22.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	EUR	1	0	2	0.00%
Forward Waluta USD FW200601 25.06.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	USD	1	0	396	0.01%
Forward Waluta USD FW907118 12.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA	Polska	USD	1	0	570	0.02%
Forward Waluta USD FW908040 29.08.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1	0	846	0.03%
Forward Waluta USD FW909006 09.09.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1	0	263	0.01%
Forward Waluta USD FW909009 09.09.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	USD	1	0	75	0.00%
Forward Waluta USD FW910002 24.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	USD	1	0	1 666	0.06%
Interest Rate Swap CC19077 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	11 120	11 218	0.37%
Interest Rate Swap CC19077 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 120	-11 013	-0.37%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC19102 31.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	0	2 145	0.07%
Interest Rate Swap CC19102 31.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	0	-2 121	-0.07%
Interest Rate Swap CC20091 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-11 154	-11 047	-0.37%
Interest Rate Swap CC20091 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	11 154	11 210	0.37%
Interest Rate Swap CC20094 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 299	-4 243	-0.14%
Interest Rate Swap CC20094 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 299	4 301	0.14%
Interest Rate Swap CC20122 21.12.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	4 620	4 624	0.15%
Interest Rate Swap CC20122 21.12.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-4 620	-4 690	-0.16%
Interest Rate Swap CC21022 23.02.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	28 263	28 445	0.95%
Interest Rate Swap CC21022 23.02.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-28 263	-27 825	-0.93%
Interest Rate Swap CC210310 08.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	7 109	7 152	0.24%
Interest Rate Swap CC210310 08.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-7 109	-7 266	-0.24%
Interest Rate Swap CC210910 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 582	-8 512	-0.28%
Interest Rate Swap CC210910 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 582	8 628	0.29%
Interest Rate Swap CC210911 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-14 931	-14 706	-0.49%
Interest Rate Swap CC210911 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	14 931	15 011	0.50%
Interest Rate Swap CC21092 24.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	7 955	8 017	0.27%
Interest Rate Swap CC21092 24.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-7 955	-7 863	-0.26%
Interest Rate Swap CC21094 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 065	-11 946	-0.40%
Interest Rate Swap CC21094 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 065	12 130	0.40%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC21112 29.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 990	-5 968	-0.20%
Interest Rate Swap CC21112 29.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 990	6 002	0.20%
Interest Rate Swap CC21113 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 109	-8 954	-0.30%
Interest Rate Swap CC21113 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	9 109	9 125	0.30%
Interest Rate Swap CC21119 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-4 456	-4 436	-0.15%
Interest Rate Swap CC21119 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	4 456	4 466	0.15%
Interest Rate Swap CC21122 03.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	23 359	23 529	0.78%
Interest Rate Swap CC21122 03.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-23 359	-23 388	-0.78%
Interest Rate Swap CC220916 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 580	-8 580	-0.29%
Interest Rate Swap CC220916 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 580	8 592	0.29%
Interest Rate Swap CC22095 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 868	-9 857	-0.33%
Interest Rate Swap CC22095 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	9 868	9 928	0.33%
Interest Rate Swap CC23068 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 601	-4 584	-0.15%
Interest Rate Swap CC23068 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 601	4 608	0.15%
Interest Rate Swap CC23075 06.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-11 379	-11 404	-0.38%
Interest Rate Swap CC23075 06.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	11 379	11 478	0.38%
Interest Rate Swap CC240117 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	LIBOR USD STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-18 805	-18 766	-0.63%
Interest Rate Swap CC240117 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	18 805	19 023	0.63%
Interest Rate Swap CC240124 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 794	-4 796	-0.16%
Interest Rate Swap CC240124 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 794	4 829	0.16%
Interest Rate Swap CC24015 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	19 796	19 961	0.67%
Interest Rate Swap CC24015 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-19 796	-20 006	-0.67%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC24071 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	10 282	10 370	0.35%
Interest Rate Swap CC24071 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-10 282	-10 421	-0.35%
Interest Rate Swap CC240711 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-5 017	-5 064	-0.17%
Interest Rate Swap CC240711 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	5 017	5 060	0.17%
Interest Rate Swap CC240712 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-30 294	-30 378	-1.01%
Interest Rate Swap CC240712 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	30 294	30 554	1.02%
Interest Rate Swap CC240717 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-15 038	-14 993	-0.50%
Interest Rate Swap CC240717 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	15 038	15 167	0.51%
Interest Rate Swap CC24074 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	5 249	5 294	0.18%
Interest Rate Swap CC24074 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 249	-5 175	-0.17%
Interest Rate Swap CC24077 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 953	-9 956	-0.33%
Interest Rate Swap CC24077 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	9 953	10 039	0.33%
Interest Rate Swap CC25011 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	11 274	14 893	0.50%
Interest Rate Swap CC25011 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 274	-14 680	-0.49%
Interest Rate Swap CC250112 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 372	-14 973	-0.50%
Interest Rate Swap CC250112 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	11 372	14 946	0.50%
Interest Rate Swap CC25013 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	5 747	5 793	0.19%
Interest Rate Swap CC25013 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 747	-5 690	-0.19%
Interest Rate Swap CC25016 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 429	-11 460	-0.38%
Interest Rate Swap CC25016 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	11 429	11 521	0.38%
Interest Rate Swap CC25019 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-5 677	-7 479	-0.25%
Interest Rate Swap CC25019 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	5 677	7 452	0.25%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC25092 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-18 105	-18 567	-0.62%
Interest Rate Swap CC25092 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	18 105	18 210	0.61%
Interest Rate Swap CC26043 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-19 379	-20 635	-0.69%
Interest Rate Swap CC26043 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	19 379	19 465	0.65%
Interest Rate Swap CI20081R 03.08.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	483	0.02%
Interest Rate Swap CI20086R 03.08.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-342	-0.01%
Interest Rate Swap CI210319R 24.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-43	0.00%
Interest Rate Swap CI21032R 05.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-13	0.00%
Interest Rate Swap CI210418R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-192	-0.01%
Interest Rate Swap CI210421R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-465	-0.02%
Interest Rate Swap CI210427R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-135	0.00%
Interest Rate Swap CI210432R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	44	0.00%
Interest Rate Swap CI210436R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	34	0.00%
Interest Rate Swap CI210439R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	105	0.00%
Interest Rate Swap CI210441R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-153	-0.01%
Interest Rate Swap CI21049R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	15	0.00%
Interest Rate Swap CI21052R 14.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-8	0.00%
Interest Rate Swap CI21057R 31.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-109	0.00%
Interest Rate Swap CI210612R 21.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	2	0.00%
Interest Rate Swap CI210613R 25.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	0	0.00%
Interest Rate Swap CI210811R 09.08.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-129	0.00%
Interest Rate Swap CI210812R 05.08.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-131	0.00%
Interest Rate Swap CI21081R 05.08.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	242	0.01%
Interest Rate Swap CI21086R 09.08.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	281	0.01%
Interest Rate Swap CI220312R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-425	-0.01%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CI220313R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-151	-0.01%
Interest Rate Swap CI220316R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-235	-0.01%
Interest Rate Swap CI220323R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-63	0.00%
Interest Rate Swap CI220325R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-209	-0.01%
Interest Rate Swap CI220329R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-147	0.00%
Interest Rate Swap CI220332R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-71	0.00%
Interest Rate Swap CI220334R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-48	0.00%
Interest Rate Swap CI220337R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-43	0.00%
Interest Rate Swap CI22033R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-153	-0.01%
Interest Rate Swap CI22045R 19.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	-22	0.00%
Interest Rate Swap CI22055R 23.05.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-218	-0.01%
Interest Rate Swap CI220911R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-290	-0.01%
Interest Rate Swap CI220921R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-41	0.00%
Interest Rate Swap CI220922R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-22	0.00%
Interest Rate Swap CI220924R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-13	0.00%
Interest Rate Swap CI220927R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-12	0.00%
Interest Rate Swap CI22095R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-240	-0.01%
Interest Rate Swap CI22099R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Societe Generale	Polska	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-159	-0.01%
Interest Rate Swap CI230310R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-180	-0.01%
Interest Rate Swap CI230311R 24.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-426	-0.01%
Interest Rate Swap CI23031R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-358	-0.01%
Interest Rate Swap CI23042R 20.04.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-282	-0.01%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CI23045R 24.04.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-77	0.00%
Interest Rate Swap CI23049R 24.04.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-145	0.00%
Interest Rate Swap CI23064R 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR\Stopa zmienna EURIBOR	1	0	-141	0.00%
Interest Rate Swap CI240115R 24.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-257	-0.01%
Interest Rate Swap CI240116R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-1 059	-0.04%
Interest Rate Swap CI240128R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-62	0.00%
Interest Rate Swap CI240132R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-65	0.00%
Interest Rate Swap CI24017R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-216	-0.01%
Interest Rate Swap CI24019R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-218	-0.01%
Interest Rate Swap CI260411R 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-69	0.00%
Interest Rate Swap CI26046R 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-819	-0.03%
Interest Rate Swap CI26051R 25.05.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR\Stopa zmienna EURIBOR	1	0	-43	0.00%
Interest Rate Swap CI26061R 01.06.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-485	-0.02%
Interest Rate Swap CI270210R 23.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	123	0.00%
Interest Rate Swap CI27025R 22.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-140	0.00%
Interest Rate Swap CI27027R 23.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-114	0.00%
Interest Rate Swap CI27029R 22.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	153	0.01%
Interest Rate Swap IR21066R 07.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa zmienna WIBOR\Stopa stała WIBOR	1	0	11	0.00%
Interest Rate Swap IR21067R 10.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR\Stopa zmienna WIBOR	1	0	21	0.00%
Interest Rate Swap IR21076R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR\Stopa zmienna WIBOR	1	0	15	0.00%
Interest Rate Swap IR21079R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR\Stopa zmienna WIBOR	1	0	-19	0.00%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap IR22031R 07.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR	1	0	-257	-0.01%
Interest Rate Swap IR220410R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-51	0.00%
Interest Rate Swap IR220414R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	17	0.00%
Interest Rate Swap IR22045R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	5	0.00%
Interest Rate Swap IR22049R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-10	0.00%
Interest Rate Swap IR220911R 23.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	29	0.00%
Interest Rate Swap IR22098R 23.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	72	0.00%
Interest Rate Swap IR22107R 25.10.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-244	-0.01%
Interest Rate Swap IR230110R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-149	0.00%
Interest Rate Swap IR230112R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-115	0.00%
Interest Rate Swap IR230116R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-73	0.00%
Interest Rate Swap IR23014R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-99	0.00%
Interest Rate Swap IR23017R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-43	0.00%
Interest Rate Swap IR240411R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-301	-0.01%
Interest Rate Swap IR240427R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	838	0.03%
Interest Rate Swap IR24048R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-462	-0.02%
Interest Rate Swap IR24064R 05.06.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-48	0.00%
Interest Rate Swap IR24065R 06.06.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-50	0.00%
Interest Rate Swap IR24067R 25.06.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	70	0.00%
Interest Rate Swap IR24102R 25.10.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-42	0.00%
Interest Rate Swap IR250710R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-533	-0.02%
Interest Rate Swap IR250713R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	1 225	0.04%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap IR25076R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-673	-0.02%
Interest Rate Swap IR26074R 27.07.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-962	-0.03%
Interest Rate Swap IR26082R 25.08.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-754	-0.03%
Interest Rate Swap IR26086R 25.08.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-363	-0.01%
Interest Rate Swap IR280412R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-154	-0.01%
Interest Rate Swap IR280415R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-175	-0.01%
Interest Rate Swap IR280418R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	1 144	0.04%
Interest Rate Swap IR28045R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-814	-0.03%
Suma:							0	-4 840	-0.18%

DEPOZYTY	Nazwa banku	Kraj siedziby banku	Waluta	Warunki oprocentowania	Wartość wg ceny nabycia w danej walucie w tys.	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
W walutach państw należących do OECD						67 567		68 007	2.26%
Lokata terminowa 365 dniowa do 2019-07-04	mBank SA	Polska	PLN	2.20 (Stały kupon)	20 000	20 000	20 435	20 435	0.68%
Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1.75 (Stały kupon)	12 723	47 503	12 724	47 508	1.58%
Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	CZK	0.90 (Stały kupon)	384	64	384	64	0.00%
W walutach państw nienależących do OECD						0		0	0.00%
Suma:						67 567		68 007	2.26%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - Tabele Dodatkowe

GRUPY KAPITAŁOWE O KTÓRYCH MOWA W ART. 98 USTAWY	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Grupa Banco Santander	105 863	3.53%
Grupa Kapitałowa mBank S.A.	21 792	0.73%
Grupa ING	703	0.03%
Grupa Banku PKO BP	41 765	1.39%
Grupa PZU S.A. Zakład Ubezpieczeń SA	137 469	4.57%
Suma:	307 592	10.25%

Składniki lokat nabyte od podmiotów o których mowa w art. 107 ustawy	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
ACTION SA w restrukturyzacji Seria ACT01 040717 PLACTIN00034	2 794	0.09%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria A PLPEKAO00289	12 509	0.42%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria D PLPEKAO00313	20 049	0.67%
ENEA SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	31 015	1.03%
Forward Waluta CZK FW907032 17.07.2019	0	0.00%
Forward Waluta EUR FW907047 05.07.2019	20	0.00%
Forward Waluta EUR FW907065 22.07.2019	235	0.01%
Forward Waluta EUR FW907090 22.07.2019	27	0.00%
Forward Waluta EUR FW907097 22.07.2019	19	0.00%
Forward Waluta EUR FW907106 22.07.2019	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907110 22.07.2019	18	0.00%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - Tabele Dodatkowe

Forward Waluta EUR FW907111 22.07.2019	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907121 22.07.2019	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907122 22.07.2019	3	0.00%
Forward Waluta EUR FW907131 22.07.2019	4	0.00%
Forward Waluta EUR FW907132 22.07.2019	0	0.00%
Forward Waluta EUR FW907139 22.07.2019	2	0.00%
Forward Waluta USD FW908040 29.08.2019	846	0.03%
Forward Waluta USD FW909006 09.09.2019	263	0.01%
GIEŁDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA Seria C PLGPW0000066	15 280	0.51%
Interest Rate Swap CC240117 22.01.2024	19 023	0.63%
Interest Rate Swap CC240117 22.01.2024	-18 766	-0.63%
Interest Rate Swap CC25019 20.01.2025	7 452	0.25%
Interest Rate Swap CC25019 20.01.2025	-7 479	-0.25%
Interest Rate Swap CI220313R 23.03.2022	-468	-0.02%
Interest Rate Swap CI26051R 25.05.2026	-21	0.00%
Interest Rate Swap IR21079R 26.07.2021	-1 822	-0.06%
Interest Rate Swap IR25076R 25.07.2025	-6 728	-0.22%
LC CORP SA Seria LCC006100521 PLLCCRP00082	3 027	0.10%
LC CORP SA Seria LCC011280222 PLLCCRP00132	910	0.03%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - Tabele Dodatkowe

Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	47 572	1.58%
MARVIPOL SA Seria Y PLMRVDV00037	9 931	0.33%
ORLEN CAPITAL AB XS1429673327	18 299	0.61%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA PLBPHHP00176	7 889	0.26%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL008 270320	30 006	1.00%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL027 011019	19 893	0.66%
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA Seria PGE002210526 PLPGER000069	15 049	0.50%
PS0721 PL0000109153	50 960	1.70%
Ronson Europe N.V. Seria M PLRNSER00136	1 016	0.03%
WZ0126 PL0000108817	7 935	0.26%
WZ0524 PL0000110615	19 913	0.66%
Suma:	306 687	10.19%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Bilans

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

BILANS	30.06.2019	31.12.2018
I. Aktywa	3 000 033	2 089 380
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	31 255	22 791
2. Należności	543	83 996
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	5 003	0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	2 121 459	1 262 741
- dłużne papiery wartościowe	2 121 459	1 262 741
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	841 773	719 852
- dłużne papiery wartościowe	760 916	673 506
6. Nieruchomości	0	0
7. Pozostałe aktywa	0	0
II. Zobowiązania	1 030 205	589 052
III. Aktywa netto (I - II)	1 969 828	1 500 328
IV. Kapitał funduszu	1 864 074	1 414 179
1. Kapitał wpłacony	4 087 898	3 424 875
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-2 223 824	-2 010 696
V. Dochody zatrzymane	107 653	87 148
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	85 448	70 014
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	22 205	17 134
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	-1 899	-999
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	1 969 828	1 500 328
Liczba zarejestrowanych jednostek uczestnictwa	172 644 743.844	133 019 304.712
Kategoria A	138 032 691.083	109 538 192.003
Kategoria E	0.000	0.000
Kategoria I	34 612 052.761	23 481 112.709
Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa *	11.41	11.28
Kategoria A	11.40	11.26
Kategoria E	11.40	11.26
Kategoria I	11.53	11.38

**W przypadku zbywania jednostek uczestnictwa różnych kategorii, dla tych kategorii, dla których jednostki uczestnictwa są obciążane kosztami wynagrodzenia według jednakowych stawek oraz w przypadku, gdy nie nastąpiło zbycie jednostek uczestnictwa danej kategorii: wartość jednostki uczestnictwa danej kategorii jest tożsama z wartością dla kategorii A. Więcej informacji można znaleźć w prospekcie informacyjnym Funduszu*

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Rachunek Wyniku

[Kwoty w tys. zł / wartości na JU w zł]

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	01-01-2019 - 30-06-2019	01-01-2018 - 31-12-2018	01-01-2018 - 30-06-2018
I. Przychody z lokat	29 316	37 146	16 890
Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0	0
Przychody odsetkowe	27 611	33 168	13 811
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0
Dodatnie saldo różnic kursowych	1 705	3 928	3 079
Pozostałe	0	50	0
II. Koszty funduszu	13 882	16 314	6 282
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	9 916	12 430	5 059
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0
Oplaty dla depozytariusza	89	142	51
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów	0	0	0
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	3	3	2
Usługi w zakresie rachunkowości	0	0	0
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0
Usługi prawne	0	0	0
Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0	0
Koszty odsetkowe	3 860	3 692	1 137
Koszty związane z prowadzeniem nieruchomości	0	0	0
Ujemne saldo różnic kursowych	0	0	0
Pozostałe	14	47	33
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	13 882	16 314	6 282
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	15 434	20 832	10 608
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	4 171	4 799	-378
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	5 071	-4 591	-1 041
- z tytułu różnic kursowych	706	-2 140	-1 569
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-900	9 390	663
- z tytułu różnic kursowych	-4 924	3 694	3 598
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	19 605	25 631	10 230
Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa *	0.13	0.27	0.13
Kategoria A	0.14	0.27	0.14
Kategoria I	0.15	0.30	0.15
Kategoria E	0.14	0.27	0.14

) Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa (w zestawieniu 'Rachunek wyniku z operacji') ustalany jest jako zmiana Wartości Aktywów Netto na Jednostkę Uczestnictwa (w okresie prezentowanym, zgodnie z wartościami zaprezentowanymi w zestawieniu 'Bilans')

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie zmian

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	01-01-2019 - 30-06-2019	01-01-2018 - 31-12-2018
I. Zmiana wartości aktywów netto		
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	1 500 328	759 979
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy	19 605	25 631
a) przychody z lokat netto	15 434	20 832
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	5 071	-4 591
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-900	9 390
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	19 605	25 631
4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu (razem):	0	0
a) z przychodów z lokat netto	0	0
b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat	0	0
c) z przychodów ze zbycia lokat	0	0
5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem)	449 895	714 718
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału)	663 023	920 966
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału)	-213 128	-206 248
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym (3-4-5)	469 500	740 349
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	1 969 828	1 500 328
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	1 722 548	1 068 352
II. Zmiana liczby jednostek uczestnictwa		
Zmiana liczby jednostek w okresie sprawozdawczym w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	43 147 637.526	67 705 621.804
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	14 653 138.439	15 270 761.521
Saldo zmian	28 494 499.080	52 434 860.275
Kategoria I		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	15 682 709.228	15 081 175.441
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	4 551 769.176	3 536 071.854
Saldo zmian	11 130 940.052	11 545 103.587
Zmiana liczby jednostek od początku działalności funduszu w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	308 629 771.440	265 482 133.914
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	170 597 080.350	155 943 941.911
Saldo zmian	138 032 691.083	109 538 192.003
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	138 032 691.083	109 538 192.003
Kategoria I		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	73 801 299.733	58 118 590.505
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	39 189 246.972	34 637 477.796
Saldo zmian	34 612 052.761	23 481 112.709
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	34 612 052.761	23 481 112.709
III. Zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa		
1. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego		
Kategoria A	11.26	10.99
Kategoria I	11.38	11.08
Kategoria E	11.26	10.99
2. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego		
Kategoria A	11.40	11.26
Kategoria I	11.53	11.38
Kategoria E	11.40	11.26
3. Procentowa zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym		
Kategoria A	2.51%	2.46%

Pekao Konserwatywny Plus (subfundusz w Pekao FIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie zmian

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

Kategoria E			2.51%	2.46%
Kategoria I			2.66%	2.71%
4. Minimalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	11.24	03.01.2019	10.99	03.01.2018
Kategoria E	11.24	03.01.2019	10.99	03.01.2018
Kategoria I	11.36	03.01.2019	11.09	03.01.2018
5. Maksymalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	11.39	26.06.2019	11.27	21.12.2018
Kategoria E	11.39	26.06.2019	11.27	21.12.2018
Kategoria I	11.52	26.06.2019	11.38	20.12.2018
6. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa wg ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	11.38	28.06.2019	11.26	28.12.2018
Kategoria E	11.38	28.06.2019	11.26	28.12.2018
Kategoria I	11.51	28.06.2019	11.38	28.12.2018
Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:			1.63%	1.53%
Wynagrodzenie dla Towarzystwa			1.16%	1.16%
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję			-	-
Opłaty dla depozytariusza			0.01%	0.01%
Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów			-	-
Usługi w zakresie rachunkowości			-	-
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu			-	-

Procentowa zmiana wartości i procentowy udział kosztów - prezentowane w skali roku.

Noty objaśniające

W niniejszych notach zawarte są uzupełniające dane o pozycjach bilansu i rachunku wyniku z operacji Subfunduszu oraz o zasadach prowadzenia rachunkowości Funduszu z wydzielonymi subfunduszami.

Nota - 1	Polityka rachunkowości Funduszu.....	1
Nota - 2	Należności Subfunduszu	5
Nota - 3	Zobowiązania Subfunduszu.....	6
Nota - 4	Środki pieniężne i ich ekwiwalenty.....	6
Nota - 5	Ryzyka	7
Nota - 6	Instrumenty pochodne	8
Nota - 7	Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu	15
Nota - 8	Kredyty i pożyczki	16
Nota - 9	Waluty i różnice kursowe	17
Nota - 10	Dochody i ich dystrybucja	19
Nota - 11	Koszty Subfunduszu	20
Nota - 12	Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa.....	21

Nota - 1 Polityka rachunkowości Funduszu

Przepisy prawne regulujące rachunkowość Funduszu i Subfunduszu

Rachunkowość Funduszu prowadzona była w okresie sprawozdawczym zgodnie z przepisami Ustawy z dnia 29 września 1994 roku o rachunkowości (t.j. Dz.U. z 2019. poz. 351) oraz Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 24 grudnia 2007 roku w sprawie szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych (Dz.U. Nr 249, poz. 1859) (dalej zwanym Rozporządzeniem o rachunkowości funduszy).

Zgodnie z Rozporządzeniem o rachunkowości funduszy, księgi rachunkowe subfunduszy wydzielonych w funduszu inwestycyjnym prowadzone są odrębnie.

Zasady ogólne / jednakowe dla wszystkich funduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA

Zasady ujawniania i prezentacji informacji w sprawozdaniu finansowym

Sprawozdanie zostało sporządzone:

- w języku polskim i w walucie polskiej (kwoty w tysiącach złotych, z wyjątkiem wykazywania wartości na jednostkę uczestnictwa – wówczas z dokładnością do 0,01 zł);
- według stanu Ksiąg na dzień bilansowy, z uwzględnieniem zdarzeń następujących po tym dniu, dotyczących okresu sprawozdawczego;
- zgodnie z przepisami dotyczącymi rachunkowości funduszy w zakresie ustalenia wyniku z operacji, obejmującego: (a) przychody z lokat netto oraz (b) zrealizowany zysk (stratę) ze zbycia lokat i (c) niezrealizowany zysk (stratę) z wyceny lokat;
- zgodnie z zasadami rachunkowości określonymi w polityce rachunkowości funduszu oraz metodami wyceny obowiązującymi na dzień bilansowy;
- w formacie zgodnym z Rozporządzeniem o rachunkowości funduszy.

Sprawozdanie jednostkowe subfunduszu składa się z części opisowej obejmującej: (a) noty objaśniające i (b) informacje dodatkowe. Wprowadzenie do sprawozdania sporządzone jest dla sprawozdania połączonego.

W części tabelarycznej przedstawione zostały: (a) zestawienie lokat subfunduszu, (b) bilans subfunduszu, (c) rachunek wyniku z operacji dla subfunduszu, (d) zestawienie zmian w aktywach netto subfunduszu.

W zestawieniu 'Zestawienie lokat - tabele uzupełniające' instrumenty wierzycielskie prezentowane są w wartościach (co do wartości bieżącej) wraz z odsetkami naliczonymi.

W przypadku, gdy wycena wiarytelności (w tym zapadłych nierozliczonych) dokonywana jest z uwzględnieniem oszacowania kwot odzyskiwanych, w prezentacji takich instrumentów jako termin zapadalności wskazany jest termin kontraktowy, pierwotny, a stopy oprocentowania są historyczne.

W zestawieniu 'Zestawienie lokat – tabele dodatkowe' w tabeli 'Składniki lokat nabyte od podmiotów, o których mowa w art. 107 ustawy o funduszach inwestycyjnych' prezentowane są te składniki lokat (zarówno papiery wartościowe, jak i umowy mające za przedmiot prawa majątkowe), które były przedmiotem transakcji z Depozytariuszem Funduszu, akcjonariuszem Towarzystwa, podmiotami zależnymi bądź dominującymi w stosunku do Towarzystwa lub Depozytariusza.

Tabela 'Instrumenty rynku pieniężnego' w zestawieniu 'Zestawienie lokat – tabele dodatkowe' nie jest wypełniana, ponieważ dotyczy ona składników portfela wyłącznie funduszy inwestycyjnych typu funduszy rynku pieniężnego.

'Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa' (w zestawieniu 'Rachunek wyniku z operacji') ustalany jest jako zmiana Wartości Aktywów Netto na Jednostkę Uczestnictwa (w okresie prezentowanym, zgodnie z wartościami zaprezentowanymi w zestawieniu 'Bilans').

Środki pieniężne (w tym w walutach innych niż złoty) są ujawniane jako odpowiednie środki pieniężne w bilansie oraz notach objaśniających. Równocześnie, w zestawieniach lokat oraz w odpowiedniej pozycji w bilansie ujawniane są depozyty bankowe, w ramach pozycji 'Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku'.

W 'Zestawieniu lokat - Tabeli Głównej': ujawniane są m.in. niewystandaryzowane instrumenty pochodne, na których wynik z wyceny jest dodatni i takie pozycje prezentowane są w zestawieniu 'Bilans' (w aktywach w ramach pozycji 'Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku'). Składniki o wartości ujemnej stanowią zobowiązanie (odpowiednia prezentacja w zestawieniu Bilans' i są prezentowane w Nocie 3, a także są uwzględnione w 'Zestawieniu lokat – tabelach uzupełniających' oraz Nocie 6).

Prezentacja i klasyfikacja rynków notowania instrumentów dłużnych dokonywana jest w zakresie ich wykorzystania do ustalania wartości godziwej. Pomijane są rynki o relatywnie – w stosunku do posiadanego pakietu instrumentu – niewielkich obrotach. W sytuacji braku danych z rynku – wycena odbywa się poprzez wykorzystanie kosztu nabycia skorygowanego z zastosowaniem efektywnej stopy procentowej.

Wynik z różnic kursowych prezentowany jest w jednej pozycji – odpowiednio do tego, czy ujemne, czy dodatnie różnice miały w okresie sprawozdawczym wyższą wartość. Jeśli występuje nadwyżka dodatnich różnic kursowych nad ujemnymi – ta nadwyżka ujawniona zostaje w pozycji '1.4 Przychody z lokat – Dodatnie różnice kursowe'. W przypadku nadwyżki ujemnych różnic kursowych nad dodatnimi – prezentowana jest ona w pozycji 'II.12 Koszty funduszu – Ujemne saldo różnic kursowych'.

W Nocie 4 w tabeli 'Średni stan środków pieniężnych' ujawnia się środki pieniężne zgodnie z ich sposobem prezentacji w sprawozdaniu, z pominięciem depozytów bankowych.

Prezentacja (w Nocie-6) instrumentów pochodnych. Informacje ujawniane są dla każdego kontraktu osobno, w podziale na typy instrumentów pochodnych (FX FWD, FRA, IRS, *future*), przy czym:

Jednostkowe sprawozdanie półroczne stanowi składnik połączonego sprawozdania półrocznego, które w całości: podlega przeglądowi przez biegłego rewidenta, jest ogłaszane na stronie <http://www.pekaotfi.pl> i podlega przekazaniu do Komisji.

Ujmowanie operacji dotyczących Subfunduszu w księgach rachunkowych

- 1) Księgi rachunkowe subfunduszy wydzielonych w funduszu inwestycyjnym prowadzone są odrębnie.
- 2) Zobowiązania wynikające z poszczególnych subfunduszy obciążają tylko te subfundusze oraz egzekucja może nastąpić tylko z aktywów subfunduszu, z którego wynikają zobowiązania.
- 3) Fundusz alokuje do subfunduszu koszty poniesione w związku z tym subfunduszem.
- 4) Transakcje portfelowe (nabycie oraz zbycie składników lokat) ujmuje się w księgach rachunkowych w dacie ich dokonania (zawarcia umowy).
- 5) Datą wprowadzenia do ksiąg rachunkowych transakcji na Jednostkach Uczestnictwa (zmian w kapitale wpłaconym lub kapitale wypłaconym) jest dzień zbycia lub odkupienia Jednostek Uczestnictwa. Transakcje te nie są uwzględniane w wyliczeniu Wartości Aktywów Netto na Jednostkę Uczestnictwa w dniu wprowadzenia ich do ksiąg rachunkowych.
- 6) Nabyte papiery wartościowe wprowadzane są do ksiąg rachunkowych według ceny nabycia, obejmującej wszystkie koszty poniesione w związku z nabyciem (w szczególności: prowizje maklerskie, koszt nabycia praw poboru – jeśli wykorzystane do nabycia akcji). W przypadku papierów wartościowych otrzymanych nieodpłatnie – ceną nabycia jest wartość 0.
- 7) Papiery wartościowe otrzymane w zamian za inne papiery wartościowe mają przypisaną cenę nabycia wynikającą z ceny nabycia papierów wartościowych wymienionych.
- 8) Zysk lub strata ze sprzedaży papierów wartościowych wyliczana jest metodą 'najdroższe sprzedaje się jako pierwsze', polegającą na przypisaniu sprzedanym papierom wartościowym najwyższej ceny nabycia danych papierów wartościowych. Zasada ta dotyczy także transakcji na walutach.
- 9) Dywidendy ujmowane są w księgach rachunkowych pierwszego dnia, gdy akcje danej spółki notowane są bez prawa do dywidendy.
- 10) Prawa poboru akcji rejestrowane są w pierwszym dniu notowań akcji danej spółki, gdy akcje notowane są bez praw. Niewykorzystane prawa poboru akcji, po zamknięciu subskrypcji, są umarzone.
- 11) Przychody z odsetek ujmowane są w księgach rachunkowych na zasadzie memoriałowej.
- 12) Koszty operacyjne ujmowane są w księgach rachunkowych na zasadzie memoriałowej.
- 13) Przychody z tytułu udzielonych pożyczek papierów wartościowych ujmowane są na zasadzie memoriałowej.
- 14) Papiery wartościowe będące przedmiotem pożyczki ujmowane są w księgach rachunkowych wraz innymi papierami wartościowymi.
- 15) Operacje na aktywach i pasywach wyrażonych w walutach obcych wykazywane są w walucie rozliczenia oraz w złotych polskich, po przeliczeniu według odpowiedniego kursu średniego ogłaszanego przez NBP, na dzień ujęcia operacji w księgach rachunkowych.

Wycena aktywów i pasywów Subfunduszu

Wycena aktywów subfunduszu (w tym w szczególności, papierów wartościowych) i ustalanie zobowiązań dokonywana jest każdego Dnia Wyceny Funduszu oraz na dzień sporządzenia sprawozdania w wartości godziwej, z wyjątkiem instrumentów, dla których wartość stanowi koszt nabycia skorygowany z zastosowaniem efektywnej stopy procentowej.

W Dniu Wyceny wycena aktywów i ustalanie zobowiązań subfunduszu odbywa się według ustalonych stanów, określonych kursów, cen i wartości z godziny **23:30**.

- 1) Składniki lokat wyceniane są według następujących zasad:
 - Papiery wartościowe notowane na giełdach papierów wartościowych, w tym na GPW oraz *Rynku Treasury BondSpot Poland* (akcje, prawa do akcji, prawa poboru, obligacje Skarbu Państwa – w części związanej z nominalną) wyceniane są według kursów zamknięcia ogłaszanych przez prowadzącego dany rynek (w przypadku notowań ciągłych), lub ostatniego kursu jednolitego (w przypadku notowań jednolitych). W odniesieniu do papierów wartościowych notowanych równocześnie na kilku rynkach, dokonywany jest okresowy wybór rynku głównego (dla każdego papieru wartościowego), przy czym głównym kryterium brany pod uwagę są obroty danym papierem wartościowym w okresie miesięcznym. Dla instrumentów dłużnych dodatkowym kryterium jest skala obrotów danym instrumentem – odniesiona do wielkości zaangażowania.
 - W przypadku, gdy notowania papierów wartościowych na aktywnym rynku cechuje brak stałej możliwości pozyskiwania kursu zamknięcia (lub analogicznego), a jest możliwość skorzystania z danych od wyspecjalizowanego podmiotu zajmującego się dostarczaniem wycen takich papierów wartościowych, do wyceny w wartości godziwej wykorzystuje się tak pozyskane kursy (od Dostawcy Cen).
 - Papiery wartościowe dłużne notowane na rynkach aktywnych, dla których nie ma możliwości stałego uzyskiwania kursów z tych rynków ani od Dostawców Cen są wyceniane w wartości godziwej z wykorzystaniem modelu wyceny dyskontującego czynnikami rynkowymi przyszłe przepływy pieniężne.
 - Bony Skarbowe oraz nieskarbowe papiery wartościowe wierzycielskie, dla których nie ma możliwości uzyskiwania w sposób ciągły wartości rynkowej (w tym np. obligacje zamienne, bony handlowe i obligacje korporacyjne), wyceniane są metodą skorygowanej ceny nabycia, z zastosowaniem efektywnej stopy procentowej z uwzględnieniem odpisów z tytułu trwałej utraty wartości.
 - Akcje, do czasu rozpoczęcia notowań na rynku giełdowym, wyceniane są według ceny nabycia, chyba, że do ich nabycia wykorzystano prawa poboru. W takim przypadku do ceny nabycia akcji dolicza się wartość tych praw i stosuje się zasadę ogólną, za wyjątkiem sytuacji, kiedy notowane akcje danej spółki odnotowują spadek ceny uzasadniający korektę wyliczonej wartości. Ponadto, w przypadku kolejnych emisji publicznych akcji spółki, której akcje danej emisji nie są notowane na rynku giełdowym, nowa cena emisyjna, po której została przeprowadzona emisja, staje się podstawą do wyceny akcji nienotowanych znajdujących się w portfelu.
 - Prawa poboru akcji nowej emisji, notowane na rynku giełdowym, wyceniane są wg tych notowań z uwzględnieniem kryterium wyboru rynku przedstawionego powyżej. Przed rozpoczęciem notowań przez Giełdę, prawa wyceniane są odpowiednio do jednorazowej zmiany wartości akcji dających te prawa. Wartość tych praw, jeśli nie odbywa się nimi obrót, nie ulega zmianie, chyba że notowane akcje danej spółki odnotowują spadek ceny uzasadniający korektę wartości praw poboru.
 - Papiery wartościowe nabyte z udzielonym przez kontrahenta przyrzeczeniem odkupu, w transakcji mającej na celu zabezpieczenie przekazanego depozytu pieniężnego (transakcje typu 'buy sell-back'), są wyceniane metodą skorygowanej ceny nabycia, przy czym korektę przeprowadza się z wykorzystaniem efektywnej stopy procentowej. Analogiczna zasada obowiązuje dla kontraktów sprzedaży z udzielonym przyrzeczeniem odkupu od kontrahenta ('sell buy-back')
 - W uzasadnionych przypadkach, gdy na skutek zdarzeń dotyczących posiadanych papierów wartościowych, którymi nie odbywa się obrót na rynku aktywnym, po analizie przypadku dokonywany jest stosowny odpis z tytułu trwałej utraty wartości (w ciężar niezrealizowanego wyniku z inwestycji) i w zestawieniu lokat papiery wartościowe wykazywane są z uwzględnieniem odpisu.
- 2) Fundusz korzysta, na potrzeby uzyskiwania cen oraz informacji o instrumentach finansowych, z uznanych serwisów informacyjnych, w tym w szczególności:
 - Bloomberg L.P. („Bloomberg“)
Serwis: 'Bloomberg Professional Service',
Bloomberg Data License'
- 3) Modele wykorzystywane na potrzeby wyceny specyficznych instrumentów:
 - Podstawowym modelem stosowanym w zakresie wyliczania wartości pozycji w instrumentach pochodnych typu *swap* (*interest rate swap* oraz *cross-currency interest rate swap*), kontrakty terminowe na przyszłą stopę procentową (*forward rate agreement*) oraz kontraktów terminowej wymiany walut (*currency forward*) oraz określonych instrumentów dłużnych jest metoda wyliczania zdyskontowanych przepływów pieniężnych.
 - W przypadku wyceny opcji oraz składnika opcyjnego wbudowanego w obligację zamienną (w przypadku braku ścisłego powiązania z instrumentem dłużnym) stosowane są wyliczenia z systemu Dostawcy Cen, w których wykorzystuje się rozwiązanie równania *Blacka-Scholesa*, w oparciu o dane rynkowe (bieżący kurs akcji, odpowiednia zmienność kursów akcji, stopa wolna od ryzyka).
- 4) Wycena i wyliczanie wartości innych aktywów i zobowiązań:
 - Wycena zobowiązań: z tytułu kredytów, wynikających z transakcji sprzedaży z zobowiązaniem odkupu (SBB) odbywa się metodą skorygowanej ceny nabycia, z zastosowaniem efektywnej stopy procentowej.
 - Wycena kontraktów *futures* odbywa się zgodnie z notowaniami tych kontraktów na giełdzie. Rozliczenia stanu rozrachunków z tytułu zmiany depozytu zabezpieczającego dokonywane są codziennie i zmiany ujmowane w rachunku wyniku z operacji są zgodne z wyciągami z rachunku zabezpieczającego.

- Należności z tytułu udzielonych pożyczek papierów wartościowych (w części poza wynagrodzeniem z tytułu udzielenia pożyczki) wycenia się według zasad dotyczących tych papierów wartościowych;
 - Odsetki należne od obligacji Skarbu Państwa wylicza się zgodnie z podawanymi publicznie tabelami sponsora emisji;
 - Odsetki od papierów wartościowych dłużnych wyliczane są na każdy Dzień Wyceny, zgodnie z warunkami emisji;
 - Aktywa wyrażone w innej niż polska walucie – wyceniane są w danej walucie, a następnie wartości przeliczane są na polskie złote – według odpowiedniego kursu średniego, ogłaszanego przez NBP na Dzień Wyceny.
 - Wartość pasywów walutowych ustalana jest w sposób analogiczny do wyliczenia wartości aktywów wyrażonych w walucie.
- 5) W uzasadnionych przypadkach, gdy na skutek zdarzeń dotyczących emitentów bądź samych posiadanych wierzyielskich papierów wartościowych (a instrumenty nie są przedmiotem obrotu na rynku aktywnym), po analizie przypadku może być dokonany stosowny odpis z tytułu trwałej utraty wartości (w ciężar niezrealizowanego wyniku z inwestycji). W takim przypadku w zestawieniu lokat papiery wartościowe wykazywane są z uwzględnieniem odpisu. Przykładowymi przesłankami do modyfikacji standardowego mechanizmu wyceny instrumentów dłużnych bądź dokonania odpisu z tytułu szacowanej trwałej utraty wartości mogą być: ogłoszenie przez sąd upadłości emitenta z możliwością zawarcia układu z wierzycielami, upadłość likwidacyjna emitenta, umowa z wierzycielami w zakresie odłożenia terminów spłaty wierzytelności bądź restrukturyzacja (w tym obniżenie kwoty do zwrotu) wierzytelności, utrata przez emitenta możliwości regulowania zobowiązań. Określenie szacowanej stopy odpisu w każdym przypadku dokonywane jest adekwatnie do danych o emitencie, oceny co do możliwości przyszłego zwrotu wierzytelności, oraz jakości posiadanych zabezpieczeń wierzytelności.

Wartości szacunkowe

Wycena aktywów i ustalanie wartości zobowiązań dokonywane są według wiarygodnie oszacowanej wartości godziwej. W szczególnych przypadkach (w szczególności przy braku danych z aktywnego rynku oraz w przypadku wystąpienia przesłanek utraty wartości) wycena ta wymagać może dokonania oszacowania opartego o subiektywne oceny, estymacje i przyjęcie założeń wpływających na stosowane zasady rachunkowości oraz na prezentowane wartości aktywów i zobowiązań oraz kwoty przychodów i kosztów. Oszacowania dokonywane są w oparciu o dostępne dane historyczne, dane możliwe do zaobserwowania na rynku oraz szereg innych czynników uważanych za właściwe w danych okolicznościach.

W miarę możliwości w modelach wyceny wykorzystywane są dane możliwe do zaobserwowania na rynku, jednak w pewnych obszarach oszacowania są niezbędne.

Oszacowania i założenia stanowiące ich podstawę podlegają okresowym przeglądom. Korekty w wartościach szacunkowych są rozpoznawane w okresie, w którym dokonano zmiany oszacowania, jeżeli korekta dotyczy tylko tego okresu lub w okresie, w którym dokonano zmiany i okresach przyszłych, jeśli korekta wpływa zarówno na bieżący, jak i przyszłe okresy.

Zmiany przyjętych założeń i oszacowań mogą mieć wpływ na wykazywane wartości godziwe składników lokat.

Stosowane metody i modele wyceny są okresowo oceniane i weryfikowane, a przed wdrożeniem przedstawiane, i uzgadniane z Depozytariuszem Funduszu wraz z uzasadnieniem użycia.

Oszacowania dokonane na dzień bilansowy uwzględniają sytuację i dane z tego dnia i poziom ryzyka na ten dzień. Biorąc pod uwagę zmienność otoczenia gospodarczego istnieje niepewność w zakresie dokonanych szacunków.

Ustalanie Wartości Aktywów Netto i wyniku z operacji

Na każdy Dzień Wyceny (oraz na dzień sporządzenia sprawozdania) ustalone są:

- wartość portfela inwestycyjnego (składników lokat) Subfunduszu;
- bilans Subfunduszu, obejmujący wyliczenie wartości aktywów Subfunduszu oraz jego zobowiązań;
- wartość wyniku z operacji – składającego się z ujętych przychodów z lokat, poniesionych kosztów Subfunduszu, zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat i niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat;
- wartość Aktywów Netto Subfunduszu, stanowiąca różnicę między wartością jego aktywów i zobowiązań;
- liczba Jednostek Uczestnictwa (dla każdej kategorii oddzielnie);
- wartość aktywów netto na Jednostkę Uczestnictwa oraz wartość aktywów netto przypadającą na Jednostki Uczestnictwa (każdej kategorii).

Zasady szczególne – dotyczące Funduszu / Subfunduszu

- 1) Wskazanie dostawców cen: Dostawcą Cen jest Bloomberg.
- 2) W przypadku wyceny instrumentów o wartości wyrażonej w walucie, dla której NBP nie ogłasza codziennie kursów, wykorzystywany jest kurs tej waluty w relacji do **euro**.

Wprowadzone w okresie sprawozdawczym zmiany stosowanych zasad rachunkowości, metod wyceny oraz sposobu sporządzania sprawozdania finansowego

W okresie sprawozdawczym nie wprowadzono zmian stosowanych zasad rachunkowości, w tym metod ujmowania operacji, metod wyceny oraz sposobu sporządzania sprawozdania finansowego. Nie wystąpiły różnice pomiędzy danymi ujawnionymi w sprawozdaniu finansowym i w porównywalnych danych finansowych a uprzednio sporządzonymi i opublikowanymi sprawozdaniami finansowymi.

Nota - 2 Należności Subfunduszu

Wartości w tys. zł

NOTA-2 NALEŻNOŚCI FUNDUSZU	30.06.2019	31.12.2018
Należności	543	83 996
Z tytułu zbytych lokat	0	83 995
Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
Z tytułu zbytych jednostek uczestnictwa a albo w ydanych certyfikatów inwestycyjnych	542	0
Z tytułu dywidend	0	0
Z tytułu odsetek	0	0
Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0	0
Z tytułu udzielonych pożyczek w podziale na podmioty udzielające pożyczek	0	0
Pozostałe	1	1
w tym:		
Należności z tytułu podatku	0	1
Należności z tytułu pomocy prawnej dot. weryfikacji dokumentów	1	0

Nota - 3 Zobowiązania Subfunduszu

Wartości w tys. zł

NOTA-3 ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	30.06.2019	31.12.2018
Zobowiązania	1 030 205	589 052
Z tytułu nabytych aktywów	122 606	483 983
Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	868 813	88 322
Z tytułu instrumentów pochodnych	17 690	6 299
Z tytułu w płat na jednostki uczestnictw a albo certyfikaty inw estycyjne	13 361	5 484
Z tytułu odkupionych jednostek uczestnictw a albo w wykupionych certyfikatów inw estycyjnych	1 872	595
Z tytułu w wypłaty dochodów funduszu	0	0
Z tytułu w wypłaty przychodów funduszu	0	0
Z tytułu w yemitów anych obligacji	0	0
Z tytułu krótkoterminow ych pożyczek i kredytów	0	0
Z tytułu długoterminow ych pożyczek i kredytów	0	0
Z tytułu gw arancji lub poręczeń	0	0
Z tytułu rezerw	0	0
Pozostałe składniki zobow iązań	5 863	4 369
w tym:		
Zobow iązania z tytułu depozytów zabezpieczających	3 614	2 573
Zobow iązania z tytułu w ynagrodzenia za zarządzenie	1 846	1 440

Nota - 4 Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Zestawienie środków pieniężnych i ich ekwiwalentów:

NOTA-4 I. STRUKTURA ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH NA RACHUNKACH BANKOWYCH	30.06.2019		31.12.2018	
	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
I. Banki / w aluty		31 255		22 791
J.P. MORGAN SECURITIES PLC		3 699		1 075
EUR	870	3 699	250	1 075
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL		5 825		1 032
EUR	1 370	5 825	240	1 032
Santander Bank Polska S.A.		0		77
PLN	0	0	0	0
USD	0	0	20	77
Santander Biuro Maklerskie		94		0
USD	25	94	0	0
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		0		80
PLN	0	0	80	80
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA		3 610		2 570
PLN	3 610	3 610	2 570	2 570
mBank SA		0		0
PLN	0	0	0	0
BNP Paribas		2 976		1 290
EUR	700	2 976	300	1 290
DM mBanku S.A.		529		535
EUR	70	297	70	301
USD	62	232	62	234
Bank Polska Kasa Opieki S.A.		14 522		13 982
CZK	0	0	226	38
EUR	166	707	0	1
HUF	0	0	489 679	6 559
PLN	13 807	13 807	7 380	7 380
USD	2	8	1	4
PKO BP S.A.		0		0
PLN	0	0	0	0
SOCIETE GENERALE PARIS		0		2 150
EUR	0	0	500	2 150

*] Dla rozroznienia przeznaczenia przechowywania srodkow w banku depozytariuszu: (a) "Bank Polska Kasa Opieki S.A." - srodki pieniężne na rachunkach bieżących. (b) "BANK POLSKA KASA OPIEKI SA" - deoztyv zabezpieczające wykonanie kontraktów pochodnych otrzymane oraz deoztyv zabezpieczające

NOTA-4 II. ŚREDNI W OKRESIE SPRAWOZDAWCZYM POZIOM ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH UTRZYMYWANYCH W CELU ZASPOKOJENIA BIEŻĄCYCH ZOBOWIĄZAŃ	30.06.2019		31.12.2018	
	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
II. Średni w okresie sprawozdawczym poziom środków pieniężnych				
CZK	57	10	34 361	5 640
EUR	2 391	10 263	1 443	6 163
HUF	91 199	1 217	285 557	3 798
PLN	6 831	6 831	4 445	4 445
USD	290	1 105	324	1 173

Nota - 5 Ryzyka

Ryzyko inwestycyjne wynika z realizacji przyjętej polityki inwestycyjnej Subfunduszu. Szczegółowo ryzyko to zostało opisane w Prospekcie Informacyjnym Funduszu. Dane wartościowe obrazujące ryzyko prezentowane są bez danych porównawczych.

Poziom obciążenia aktywów i zobowiązań Subfunduszu ryzykiem w podziale na klasy ryzyka o najistotniejszym znaczeniu w Subfunduszu – na dzień bilansowy:

Klasa ryzyka	Poziom obciążenia ryzykiem	Udział w aktywach Subfunduszu
a) ryzyko walutowe		
struktura walutowa [przedstawiona w nocie 9]		
waluty	13 838 tys. zł	0,5%
	47 572 tys. zł	1,6%
dłużne papiery wartościowe	714 961 tys. zł	23,8%
zobowiązania w walutach	476 289 tys. zł	---
wartość niezabezpieczona (w podziale na waluty)	634 tys. EUR	0,03%
	-440 tys. USD	
	2 112 tys. CZK	
	-37 323 tys.. HUF	
b) ryzyko kredytowe		
obligacje Skarbu Państwa	1 897 254 tys. zł	63,2%
korporacyjne papiery wartościowe	880 753 tys. zł	29,3%
obligacje skarbowe zagraniczne	56 417 tys. zł	1,9%
depozyty bankowe	68 007 tys. zł	2,3%
c) ryzyko przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej		
obligacje o zmiennej stopie procentowej	1 067 497 tys. zł	35,5%
d) ryzyko wartości godziwej wynikające ze stopy procentowej		
instrumenty o stałej stopie procentowej (lub zerowej)	1 814 878 tys. zł	60,5%
e) ryzyko modelu		
składniki lokat (instrumenty dłużne, akcje nienotowane i instrumenty pochodne) wycenione w sposób inny niż w oparciu o kurs ustalony na aktywnym rynku tj. metodą skorygowanego kosztu nabycia lub poprzez oszacowanie wartości godziwej przy zastosowaniu modeli wyceny (DCF, metoda porównawcza bądź w przypadku opcji - BS)	726 500 tys. zł	24,1%

Informacje uzupełniające w zakresie ryzyka

- 1) W okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki nierozliczenia się transakcji zawieranych przez Subfundusz.
- 2) Ryzyko kredytowe i ryzyko rozliczeniowe
 - Ryzyko kredytowe polega na niewywiązaniu się emitenta ze swoich zobowiązań wynikających z emisji instrumentu finansowego; dotyczy także sytuacji kiedy kontrahent nie wywiązuje się z zawartej wcześniej umowy, w tym umowy, której przedmiotem są niewystandaryzowane instrumenty pochodne.
 - Ryzyko rozliczeniowe wiąże się z wystąpieniem sytuacji, w której Subfundusz wywiązał się ze swoich zobowiązań zanim zrobił to kontrahent; dotyczy to szczególnie transakcji na rynku międzybankowym (OTC) oraz transakcji na rynkach, na których nie funkcjonuje system rozliczeń nadzorowanych przez niezależną izbę rozliczeniową (gdzie stosowana jest tzw. zasada „free of payment”, czyli transferu papierów wartościowych bez płatności, a nie „delivery versus payment”, czyli wydanie przy płatności).
 - Zabezpieczenie ryzyka kontrahenta związanego z transakcjami pochodnymi wskazanymi w Nocie 6 wynika z obowiązku wymiany depozytu zabezpieczającego zmiennego (wynikającego z przepisów i odpowiednich umów dwustronnych).
 - W odniesieniu do transakcji typu *buy sell back*, *sell buy-back*, *repo* i *reverse repo* w przypadku niektórych kontrahentów są zawarte umowy zabezpieczające, jednakże faktycznie nie mają miejsca przypadki wymiany zabezpieczenia (dla potrzeb zmniejszenia ryzyka wykonania zobowiązań kontrahenta).
 - Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka kredytowego w poszczególnych kategoriach lokat
 - Lista emitentów (dla potrzeb ustalenia ryzyka kredytowego emitenta), dla których Subfundusz ma ekspozycję stanowiącą ponad 5 % wartości Aktywów:
 - Skarb Państwa63,2% Aktywów Subfunduszu.
- 3) Ryzyko walutowe
 - Ryzyko walutowe ma związek ze zmiennością kursów walut i potencjalną utratą wartości lokat wyrażoną w złotych w przypadku, gdy Subfundusz ma część aktywów denominowanych w walutach obcych oraz odpowiednim zwiększeniem wartości (w złotych) zobowiązań wyrażonych w walutach.

- Subfundusz stosuje zabezpieczenie ryzyka walutowego (związanego ze składnikami portfela bądź środkami pieniężnymi wyrażonymi w walutach innych niż złote) poprzez dokonywanie transakcji terminowej wymiany walut (FX Fwd) po ustalonym kursie wymiany. Informacje na temat wartości i warunków tych zabezpieczeń przedstawione są w nocie 6 [instrumenty pochodne].
- 4) Ryzyko płynności, ryzyko braku możliwości zbycia według wartości godziwej oraz możliwości wyceny istotnie dużej ilości składników portfela inwestycyjnego.

Ryzyko to dotyczy sytuacji, w której wystąpiłby brak możliwości realizacji transakcji na składnikach portfela inwestycyjnego w istotnie dużej ilości, np. w związku z zawieszeniem obrotu na rynkach notowań takich instrumentów. W okresie sprawozdawczym nie było takich sytuacji w odniesieniu do lokat.

W związku ze skalą zaangażowania Subfunduszu w instrumenty finansowe poszczególnych emitentów oraz dynamiczną sytuacją na rynku istnieje ryzyko, że płynność na rynku danych instrumentów może uniemożliwić uzyskanie cen stosowanych do codziennej wyceny składników portfela.

- 5) Ryzyko modelu
- Ryzyko modelu dotyczy sytuacji, gdy w portfelu lokat znajdują się instrumenty finansowe wycenione w sposób inny niż w oparciu o kurs ustalony na aktywnym rynku tj. metodą skorygowanego kosztu nabycia, z zastosowaniem określonego modelu wyceny lub gdy do ustalenia wartości wykorzystane zostały dane od Dostawców Cen (określających wartość instrumentów według własnych algorytmów opartych o dane rynkowe). Dla takich aktywów wyceny ujęte w sprawozdaniu finansowym mogą różnić się od wartości, jakie zostałyby wyznaczone, gdyby istniał dla nich aktywny rynek. Ryzyko związane jest także z faktem przyjęcia w modelu oszacowań i parametrów kalibrujących dobranych z najwyższą starannością, które jednak mogą dawać inny wynik niż gdyby analogiczne przeliczenia przeprowadzał inny podmiot.

Na dzień bilansowy model był zastosowany do wyceny instrumentów:

- obligacje Action SA

Model jest stosowany do wyceny instrumentów pochodnych nienotowanych, które mogą znajdować się w portfelu lokat. Informacje o posiadanych instrumentach finansowych ujawniane są w Nocie 6. Wskazane instrumenty finansowe wycenione są w sposób inny niż w oparciu o kurs ustalony na aktywnym rynku tj. z zastosowaniem określonego modelu wyceny (opis modeli – w Nocie 1). Dla takich aktywów wyceny ujęte w sprawozdaniu finansowym mogą różnić się od wartości, jakie zostałyby wyznaczone, gdyby istniał dla nich aktywny rynek. Ryzyko związane jest także z faktem przyjęcia w modelu oszacowań i parametrów kalibrujących dobranych z najwyższą starannością, które jednak mogą dawać inny wynik niż gdyby analogiczne przeliczenia przeprowadzał inny podmiot.

- 6) Poziom obciążenia innymi typowymi klasami ryzyka
- Subfundusz nie posiada lokat w instrumenty o charakterze udziałowym, nie jest więc obciążony ryzykiem cen akcji. Na ryzyko cen akcji składają się: ryzyko systematyczne całego rynku akcji, ryzyko branży oraz ryzyko specyficzne konkretnego emitenta akcji.
 - Subfundusz nie inwestuje w tytuły uczestnictwa funduszy inwestycyjnych, nie ma więc obciążenia ryzykiem walutowym ani pośredniego ryzykiem wynikającym z takich inwestycji (np. ryzyko stopy procentowej, ryzyko kredytowe, ryzyko cen akcji, ryzyko walutowe).
 - Ryzyko przejęcia lub nacjonalizacji skutkujące utratą aktywów (całości lub części) w wyniku nacjonalizacji lub przejęcia w inny sposób zagranicznych aktywów Subfunduszu. Ryzyko to dotyczy zagranicznych składników lokat.
 - Ryzyko transgraniczne polegające na wprowadzeniu ograniczeń w zakresie przepływów kapitału między państwami, w których znajdują się aktywa Subfunduszu, co może wpłynąć negatywnie na ich wartość. Ryzyko to związane jest z zagranicznymi składnikami lokat.
- 7) Informacje dot. zarządzania ryzykiem

Pekao TFI SA zarządza ryzykiem w zakresie adekwatnym do prowadzonej polityki inwestycyjnej, w tym m.in. ryzykiem walutowym, ryzykiem niewypłacalności emitentów papierów wartościowych oraz ryzykiem kredytowym kontrahentów w transakcjach.

W Pekao TFI SA funkcjonuje system zarządzania ryzykiem. Towarzystwo stosuje procesy, metody i procedury pomiaru oraz zarządzania ryzykiem, a także oblicza całkowitą ekspozycję funduszu / subfunduszu. W odniesieniu do Funduszu stosowana jest (jednakowa dla wszystkich funduszy, w tym subfunduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA) metoda zaangażowania. Poza zgodnością z przepisami prawa oraz polityką inwestycyjną badana jest także zgodność wewnętrznych limitów – odrębnie dla każdego portfela lokat.

Nota - 6 Instrumenty pochodne

Na dzień 30 czerwca 2019 Fundusz posiadał w portfelu inwestycyjnym Subfunduszu instrumenty pochodne:

- kontrakty zamiany płatności odsetkowych (transakcje swap na stopę procentową *IRS: Interest Rate Swap*)
- kontrakty *FX forward* (kontrakty terminowej wymiany walut)

Zawierane kontrakty typu *forward* miały na celu ograniczenie ryzyka walutowego na posiadanych w portfelu inwestycyjnym zagranicznych papierach wartościowych, denominowanych w walutach obcych, poprzez zabezpieczenie wartości kursu wymiany walut na złote. Zawarcie kontraktów spowodowało, że przy idealnie efektywnym (100 %) zabezpieczeniu złożenie transakcji zabezpieczanej i zabezpieczającej ekonomicznie ma charakterystykę portfela papierów udziałowych denominowanych w złotych, o kursach zmieniających się zgodnie z tendencjami na odpowiednich aktywnych rynkach zagranicznych. Zwykle kontrakt *forward* stanowił część kontraktu wymiany płatności *FX swap*, polegającej na wymianie waluty w momencie otwarcia kontraktu i terminowym odwrotnym rozliczeniu wymiany w dacie *FX forward*.

Kontrakty zamiany płatności odsetkowych (*IRS*) polegają na wymianie przyszłych płatności strumieni odsetkowych (zamiana odsetek stałych na zmienne, bądź odwrotnie). W przypadku, gdy transakcja zawierana jest celu zabezpieczenia posiadanego składnika lokat – taka transakcja oznacza dokonanie efektywnie zmiany typu posiadanej w portfelu lokaty.

Wszystkie kontrakty podlegają codziennej wycenie. Wycena kontraktów *forward* oraz – odpowiednio – kontraktów *IRS* polega na określeniu wartości godziwej według przyjętego na rynku modelu wyceny takich instrumentów finansowych (zdyskontowana wartość przyszłych przepływów pieniężnych), przy czym w modelu wyceny uwzględnia się sytuację na rynku terminowym (czynniki dyskontowe opierają się na danych z aktywnego rynku instrumentów finansowych).

Transakcje na niewystandaryzowane instrumenty pochodne zawierane były poza rynkiem regulowanym, z uznanymi bankami.

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych

strona 1		30.06.2019															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w walucie do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w walucie do otrzymania	Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
1.	Forw ard Waluta CZK FW907032 17.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	0	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	344 133	CZK	2 060 000	CZK	17.07.2019	344 133	CZK	2 060 000	PLN	17.07.2019	17.07.2019
2.	Forw ard Waluta EUR FW907002 05.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	108	SOCIETE GENERALE PARIS	1 007 000	EUR	4 390 590	PLN	05.07.2019	1 007 000	EUR	4 390 590	EUR	05.07.2019	05.07.2019
3.	Forw ard Waluta EUR FW907047 05.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	20	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	300 000	EUR	1 295 640	PLN	05.07.2019	300 000	EUR	1 295 640	EUR	05.07.2019	05.07.2019
4.	Forw ard Waluta EUR FW907065 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	235	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	4 503 000	EUR	19 402 526	PLN	22.07.2019	4 503 000	EUR	19 402 526	EUR	22.07.2019	22.07.2019
5.	Forw ard Waluta EUR FW907085 05.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	52	SOCIETE GENERALE PARIS	778 000	EUR	3 360 761	PLN	05.07.2019	778 000	EUR	3 360 761	EUR	05.07.2019	05.07.2019
6.	Forw ard Waluta EUR FW907090 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	27	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	401 000	EUR	1 734 273	PLN	22.07.2019	401 000	EUR	1 734 273	EUR	22.07.2019	22.07.2019
7.	Forw ard Waluta EUR FW907097 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	19	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	330 000	EUR	1 423 257	PLN	22.07.2019	330 000	EUR	1 423 257	EUR	22.07.2019	22.07.2019
8.	Forw ard Waluta EUR FW907106 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	4	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	90 000	EUR	387 225	PLN	22.07.2019	90 000	EUR	387 225	EUR	22.07.2019	22.07.2019
9.	Forw ard Waluta EUR FW907110 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	18	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	500 000	EUR	2 146 335	PLN	22.07.2019	500 000	EUR	2 146 335	EUR	22.07.2019	22.07.2019
10.	Forw ard Waluta EUR FW907111 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	4	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	102 000	EUR	437 906	PLN	22.07.2019	102 000	EUR	437 906	EUR	22.07.2019	22.07.2019
11.	Forw ard Waluta EUR FW907121 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	4	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	123 000	EUR	527 366	PLN	22.07.2019	123 000	EUR	527 366	EUR	22.07.2019	22.07.2019
12.	Forw ard Waluta EUR FW907122 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	3	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	120 000	EUR	514 092	PLN	22.07.2019	120 000	EUR	514 092	EUR	22.07.2019	22.07.2019
13.	Forw ard Waluta EUR FW907131 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	4	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	370 000	EUR	1 579 197	PLN	22.07.2019	370 000	EUR	1 579 197	EUR	22.07.2019	22.07.2019
14.	Forw ard Waluta EUR FW907132 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	0	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	10 000	EUR	42 707	PLN	22.07.2019	10 000	EUR	42 707	EUR	22.07.2019	22.07.2019
15.	Forw ard Waluta EUR FW907139 22.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	2	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	170 000	EUR	725 324	PLN	22.07.2019	170 000	EUR	725 324	EUR	22.07.2019	22.07.2019
16.	Forw ard Waluta USD FW907118 12.07.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	570	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	8 494 000	USD	32 274 227	PLN	12.07.2019	8 494 000	USD	32 274 227	USD	12.07.2019	12.07.2019
17.	Forw ard Waluta USD FW908040 29.08.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	846	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	7 107 000	USD	27 346 386	PLN	29.08.2019	7 107 000	USD	27 346 386	USD	29.08.2019	29.08.2019
18.	Forw ard Waluta USD FW909006 09.09.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	263	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	4 092 000	USD	15 517 846	PLN	09.09.2019	4 092 000	USD	15 517 846	USD	09.09.2019	09.09.2019
19.	Forw ard Waluta USD FW909009 09.09.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	75	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1 054 000	USD	4 004 146	PLN	09.09.2019	1 054 000	USD	4 004 146	USD	09.09.2019	09.09.2019
20.	Forw ard Waluta USD FW910002 24.10.2019 (0)	-	Forw ard	IRH	1 666	Santander Bank Polska S.A.	14 128 000	USD	54 300 827	PLN	24.10.2019	14 128 000	USD	54 300 827	USD	24.10.2019	24.10.2019
21.	Forw ard Waluta USD FW200601 25.06.2020 (0)	-	CRS	IRH	396	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	10 940 000	USD	41 079 700	PLN	25.06.2020	10 940 000	USD	41 079 700	USD	25.06.2020	25.06.2020
22.	Interest Rate Sw ap CC21022 23.02.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-27 825	BNP PARIBAS	171 979 438	CZK		CZK	23.02.2021	170 000 000	CZK			23.02.2021	23.02.2021
23.	Interest Rate Sw ap CC20122 21.12.2020 (0)	Krótko	CRS	IRH	-4 690	mBank SA (Emitent)	1 098 971	EUR		EUR	21.12.2020	1 100 000	EUR			21.12.2020	21.12.2020
24.	Interest Rate Sw ap CC210310 08.03.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-7 266	BNP PARIBAS	1 698 983	EUR		EUR	08.03.2021	1 700 000	EUR			08.03.2021	08.03.2021
25.	Interest Rate Sw ap CC21092 24.09.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-7 863	mBank SA (Emitent)	1 846 692	EUR		EUR	24.09.2021	1 850 000	EUR			24.09.2021	24.09.2021
26.	Interest Rate Sw ap CC19077 03.07.2019 (0)	Krótko	CRS	IRH	-11 013	SOCIETE GENERALE PARIS	2 590 120	EUR		EUR	03.07.2019	2 600 000	EUR			03.07.2019	03.07.2019
27.	Interest Rate Sw ap CC21122 03.12.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-23 388	SOCIETE GENERALE PARIS	5 491 345	EUR		EUR	03.12.2021	5 500 000	EUR			03.12.2021	03.12.2021
28.	Interest Rate Sw ap CC24015 15.01.2024 (0)	Krótko	CRS	IRH	-20 006	BNP PARIBAS	4 650 255	EUR		EUR	15.01.2024	4 600 000	EUR			15.01.2024	15.01.2024
29.	Interest Rate Sw ap CC24071 09.07.2024 (0)	Krótko	CRS	IRH	-10 421	SOCIETE GENERALE PARIS	2 422 839	EUR		EUR	09.07.2024	2 390 000	EUR			09.07.2024	09.07.2024
30.	Interest Rate Sw ap CC19102 31.10.2019 (0)	Krótko	CRS	IRH	-2 121	BNP PARIBAS	498 300	EUR		EUR	31.10.2019	500 000	EUR			31.10.2019	31.10.2019
31.	Interest Rate Sw ap CC25011 20.01.2025 (0)	Krótko	CRS	IRH	-14 680	BNP PARIBAS	3 418 621	EUR		EUR	20.01.2025	2 600 000	EUR			20.01.2025	20.01.2025
32.	Interest Rate Sw ap CC20091 28.09.2020 (0)	Krótko	CRS	IRH	-11 047	The Goldman Sachs Group Inc.	2 593 072	EUR		EUR	28.09.2020	2 600 000	EUR			28.09.2020	28.09.2020
33.	Interest Rate Sw ap CC21094 20.09.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-11 946	SOCIETE GENERALE PARIS	2 795 393	EUR		EUR	20.09.2021	2 800 000	EUR			20.09.2021	20.09.2021
34.	Interest Rate Sw ap CC22095 05.09.2022 (0)	Krótko	CRS	IRH	-9 857	SOCIETE GENERALE PARIS	2 298 280	EUR		EUR	05.09.2022	2 300 000	EUR			05.09.2022	05.09.2022
35.	Interest Rate Sw ap CC24074 09.07.2024 (0)	Krótko	CRS	IRH	-5 175	SOCIETE GENERALE PARIS	1 203 066	EUR		EUR	09.07.2024	1 195 000	EUR			09.07.2024	09.07.2024
36.	Interest Rate Sw ap CC25013 20.01.2025 (0)	Krótko	CRS	IRH	-5 690	SOCIETE GENERALE PARIS	1 324 534	EUR		EUR	20.01.2025	1 310 000	EUR			20.01.2025	20.01.2025
37.	Interest Rate Sw ap CC25092 09.09.2025 (0)	Krótko	CRS	IRH	-18 567	The Goldman Sachs Group Inc.	4 329 964	EUR		EUR	09.09.2025	4 250 000	EUR			09.09.2025	09.09.2025
38.	Interest Rate Sw ap CC21112 29.11.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-5 968	SOCIETE GENERALE PARIS	1 393 678	EUR		EUR	29.11.2021	1 395 000	EUR			29.11.2021	29.11.2021
39.	Interest Rate Sw ap CC21113 26.11.2021 (0)	Krótko	CRS	IRH	-8 954	SOCIETE GENERALE PARIS	2 095 699	EUR		EUR	26.11.2021	2 100 000	EUR			26.11.2021	26.11.2021
		OPIS 'CEL otwarcia pozycji'		IRH	Ograniczenie ryzyka w walutowo jego portfelu papierów w wartościowych denominowanych w walutach obcych (FR)												

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

strona 1		30.06.2019														
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartą pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w waluta do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w waluta do otrzymania	Termin zapadalności (wzglądnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
						kwota	waluta	kwota	waluta							
40.	Interest Rate Sw ap CC21119 26.11.2021 (0)	Krótką	Forward	IRH	-4 436	JP Morgan Chase & Co	1 037 338	EUR		EUR	26.11.2021	1 039 000	EUR		26.11.2021	26.11.2021
41.	Interest Rate Sw ap CC220916 05.09.2022 (0)	Krótką	Forward	IRH	-8 580	BNP PARIBAS	1 998 803	EUR		EUR	05.09.2022	2 000 000	EUR		05.09.2022	05.09.2022
42.	Interest Rate Sw ap CC23075 06.07.2023 (0)	Krótką	Forward	IRH	-11 404	The Goldman Sachs Group Inc.	2 650 000	EUR		EUR	06.07.2023	2 650 000	EUR		06.07.2023	06.07.2023
43.	Interest Rate Sw ap CC240711 09.07.2024 (0)	Krótką	Forward	IRH	-5 064	The Goldman Sachs Group Inc.	1 177 268	EUR		EUR	09.07.2024	1 170 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
44.	Interest Rate Sw ap CC24077 09.07.2024 (0)	Krótką	Forward	IRH	-9 956	SOCIETE GENERALE PARIS	2 314 765	EUR		EUR	09.07.2024	2 300 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
45.	Interest Rate Sw ap CC25016 20.01.2025 (0)	Krótką	Forward	IRH	-11 460	BNP PARIBAS	2 667 707	EUR		EUR	20.01.2025	2 640 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
46.	Interest Rate Sw ap CC240712 09.07.2024 (0)	Krótką	Forward	IRH	-30 378	SOCIETE GENERALE PARIS	7 062 546	EUR		EUR	09.07.2024	7 050 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
47.	Interest Rate Sw ap CC20094 28.09.2020 (0)	Krótką	Forward	IRH	-4 243	SOCIETE GENERALE PARIS	996 048	EUR		EUR	28.09.2020	1 000 000	EUR		28.09.2020	28.09.2020
48.	Interest Rate Sw ap CC210910 20.09.2021 (0)	Krótką	Forward	IRH	-8 512	SOCIETE GENERALE PARIS	1 994 416	EUR		EUR	20.09.2021	2 000 000	EUR		20.09.2021	20.09.2021
49.	Interest Rate Sw ap CC210911 20.09.2021 (0)	Krótką	Forward	IRH	-14 706	BNP PARIBAS	3 445 353	EUR		EUR	20.09.2021	3 455 000	EUR		20.09.2021	20.09.2021
50.	Interest Rate Sw ap CC23068 07.06.2023 (0)	Krótką	Forward	IRH	-4 584	SOCIETE GENERALE PARIS	1 068 844	EUR		EUR	07.06.2023	1 070 000	EUR		07.06.2023	07.06.2023
51.	Interest Rate Sw ap CC240124 15.01.2024 (0)	Krótką	Forward	IRH	-4 796	BNP PARIBAS	1 118 939	EUR		EUR	15.01.2024	1 120 000	EUR		15.01.2024	15.01.2024
52.	Interest Rate Sw ap CC240717 09.07.2024 (0)	Krótką	Forward	IRH	-14 993	SOCIETE GENERALE PARIS	3 497 382	EUR		EUR	09.07.2024	3 500 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
53.	Interest Rate Sw ap CC250112 20.01.2025 (0)	Krótką	Forward	IRH	-14 973	BNP PARIBAS	3 487 037	EUR		EUR	20.01.2025	2 650 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
54.	Interest Rate Sw ap CC25019 20.01.2025 (0)	Krótką	Forward	IRH	-7 479	BANK POLSKA KASA OPEKI SA (Emitent)	1 741 768	EUR		EUR	20.01.2025	1 320 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
55.	Interest Rate Sw ap CC20122 21.12.2020 (0)	Długa	Forward	IRH	4 624	mBank SA (Emitent)		PLN	4 740 304	21.12.2020		PLN	4 620 000	PLN	21.12.2020	21.12.2020
56.	Interest Rate Sw ap CC210310 08.03.2021 (0)	Długa	Forward	IRH	7 152	BNP PARIBAS		PLN	7 357 533	08.03.2021		PLN	7 109 400	PLN	08.03.2021	08.03.2021
57.	Interest Rate Sw ap CC21092 24.09.2021 (0)	Długa	Forward	IRH	8 017	mBank SA (Emitent)		PLN	8 326 135	24.09.2021		PLN	7 955 000	PLN	24.09.2021	24.09.2021
58.	Interest Rate Sw ap CC19077 03.07.2019 (0)	Długa	Forward	IRH	11 218	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	11 218 908	03.07.2019		PLN	11 120 200	PLN	03.07.2019	03.07.2019
59.	Interest Rate Sw ap CC21022 23.02.2021 (0)	Długa	Forward	IRH	28 445	BNP PARIBAS		PLN	29 243 465	23.02.2021		PLN	28 262 677	PLN	23.02.2021	23.02.2021
60.	Interest Rate Sw ap CC21122 03.12.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	23 529	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	24 516 705	03.12.2021		PLN	23 358 500	PLN	03.12.2021	03.12.2021
61.	Interest Rate Sw ap CC24015 15.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	19 961	BNP PARIBAS		PLN	21 603 995	15.01.2024		PLN	19 796 130	PLN	15.01.2024	15.01.2024
62.	Interest Rate Sw ap CC24071 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	10 370	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	11 327 308	09.07.2024		PLN	10 281 780	PLN	09.07.2024	09.07.2024
63.	Interest Rate Sw ap CC19102 31.10.2019 (0)	Długa	CIRS	IRH	2 145	BNP PARIBAS		PLN	2 157 292	31.10.2019		PLN	2 138 000	PLN	31.10.2019	31.10.2019
64.	Interest Rate Sw ap CC25011 20.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	14 893	BNP PARIBAS		PLN	16 254 935	20.01.2025		PLN	11 273 600	PLN	20.01.2025	20.01.2025
65.	Interest Rate Sw ap CC20091 28.09.2020 (0)	Długa	CIRS	IRH	11 210	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	11 446 954	28.09.2020		PLN	11 154 000	PLN	28.09.2020	28.09.2020
66.	Interest Rate Sw ap CC21094 20.09.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 130	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	12 595 494	20.09.2021		PLN	12 065 200	PLN	20.09.2021	20.09.2021
67.	Interest Rate Sw ap CC22095 05.09.2022 (0)	Długa	CIRS	IRH	9 928	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	10 478 221	05.09.2022		PLN	9 868 150	PLN	05.09.2022	05.09.2022
68.	Interest Rate Sw ap CC24074 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 294	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	5 782 799	09.07.2024		PLN	5 249 038	PLN	09.07.2024	09.07.2024
69.	Interest Rate Sw ap CC25013 20.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 793	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	6 395 850	20.01.2025		PLN	5 746 970	PLN	20.01.2025	20.01.2025
70.	Interest Rate Sw ap CC25092 09.09.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	18 210	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	20 363 949	09.09.2025		PLN	18 105 000	PLN	09.09.2025	09.09.2025
71.	Interest Rate Sw ap CC21112 29.11.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	6 002	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	6 253 666	29.11.2021		PLN	5 990 130	PLN	29.11.2021	29.11.2021
72.	Interest Rate Sw ap CC21113 26.11.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	9 125	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	9 505 411	26.11.2021		PLN	9 108 750	PLN	26.11.2021	26.11.2021
73.	Interest Rate Sw ap CC21119 26.11.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	4 466	JP Morgan Chase & Co		PLN	4 652 094	26.11.2021		PLN	4 456 271	PLN	26.11.2021	26.11.2021
74.	Interest Rate Sw ap CC220916 05.09.2022 (0)	Długa	CIRS	IRH	8 592	BNP PARIBAS		PLN	9 069 217	05.09.2022		PLN	8 580 000	PLN	05.09.2022	05.09.2022
75.	Interest Rate Sw ap CC23075 06.07.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	11 478	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	12 296 360	06.07.2023		PLN	11 379 100	PLN	06.07.2023	06.07.2023
76.	Interest Rate Sw ap CC240711 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 060	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	5 527 166	09.07.2024		PLN	5 017 000	PLN	09.07.2024	09.07.2024
77.	Interest Rate Sw ap CC24077 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	10 039	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	10 965 370	09.07.2024		PLN	9 953 250	PLN	09.07.2024	09.07.2024
78.	Interest Rate Sw ap CC25016 20.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	11 521	BNP PARIBAS		PLN	12 718 939	20.01.2025		PLN	11 428 560	PLN	20.01.2025	20.01.2025
79.	Interest Rate Sw ap CC26043 06.04.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	19 465	JP Morgan Chase & Co		PLN	22 024 872	06.04.2026		PLN	19 379 200	PLN	06.04.2026	06.04.2026
80.	Interest Rate Sw ap CC240117 22.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	19 023	BANK POLSKA KASA OPEKI SA (Emitent)		PLN	20 594 273	22.01.2024		PLN	18 805 000	PLN	22.01.2024	22.01.2024
81.	Interest Rate Sw ap CC240712 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	30 554	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	33 374 354	09.07.2024		PLN	30 293 850	PLN	09.07.2024	09.07.2024
82.	Interest Rate Sw ap CC20094 28.09.2020 (0)	Długa	CIRS	IRH	4 301	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	4 391 597	28.09.2020		PLN	4 299 000	PLN	28.09.2020	28.09.2020
83.	Interest Rate Sw ap CC210910 20.09.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	8 628	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	8 959 199	20.09.2021		PLN	8 562 000	PLN	20.09.2021	20.09.2021
84.	Interest Rate Sw ap CC210911 20.09.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	15 011	BNP PARIBAS		PLN	15 587 025	20.09.2021		PLN	14 930 783	PLN	20.09.2021	20.09.2021
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'			IRH	Ograniczenie ryzyka w alutowego portfela papierów w wartościowych denomwach innych w walutach obcych (IRH)												

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

strona 2		30.06.2019																
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności waluta do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności waluta do otrzymania	Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego		
						kwota	waluta	kwota	waluta									
85.	Interest Rate Sw ap	CC23068 07.06.2023 (0)	Długa	Forward	IRH	4 608	SOCIETE GENERALE PARIS		4 932 310	PLN			07.06.2023	PLN	4 601 000		07.06.2023	
86.	Interest Rate Sw ap	CC240124 15.01.2024 (0)	Długa	Forward	IRH	4 829	BNP PARIBAS		5 227 095	PLN			15.01.2024	PLN	4 793 600		15.01.2024	
87.	Interest Rate Sw ap	CC240717 09.07.2024 (0)	Długa	Forward	IRH	15 167	SOCIETE GENERALE PARIS		16 566 900	PLN			09.07.2024	PLN	15 037 750		09.07.2024	
88.	Interest Rate Sw ap	CC250112 20.01.2025 (0)	Długa	Forward	IRH	14 946	BNP PARIBAS		16 314 679	PLN			20.01.2025	PLN	11 372 475		20.01.2025	
89.	Interest Rate Sw ap	CC25019 20.01.2025 (0)	Długa	Forward	IRH	7 452	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)			PLN		8 134 980			PLN	5 677 320		20.01.2025
90.	Interest Rate Sw ap	CC26043 06.04.2026 (0)	Krótka	Forward	IRH	-20 635	JP Morgan Chase & Co	6 184 026		USD			06.04.2026	USD	5 120 000		06.04.2026	
91.	Interest Rate Sw ap	CC240117 22.01.2024 (0)	Krótka	Forward	IRH	-18 766	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	5 032 394		USD			22.01.2024	USD	5 000 000		22.01.2024	
92.	Interest Rate Sw ap	CI20081R 03.08.2020 (0)	-	Forward	IRH	483	mBank SA (Emitent)	2 990 000		CZK	5 897 022		03.08.2020	CZK	260 000 000		03.08.2020	
93.	Interest Rate Sw ap	CI21081R 05.08.2021 (0)	-	Forward	IRH	242	mBank SA (Emitent)	3 484 433		CZK	4 945 195		05.08.2021	CZK	130 000 000		05.08.2021	
94.	Interest Rate Sw ap	CI21086R 09.08.2021 (0)	-	Forward	IRH	281	mBank SA (Emitent)	3 238 083		CZK	4 943 604		09.08.2021	CZK	130 000 000		09.08.2021	
95.	Interest Rate Sw ap	CI20086R 03.08.2020 (0)	-	Forward	IRH	-342	BNP PARIBAS	5 897 004		CZK	3 853 778		03.08.2020	CZK	260 000 000		03.08.2020	
96.	Interest Rate Sw ap	CI21081R 09.08.2021 (0)	-	Forward	IRH	-129	BNP PARIBAS	4 943 604		CZK	4 176 467		09.08.2021	CZK	130 000 000		09.08.2021	
97.	Interest Rate Sw ap	CI210812R 05.08.2021 (0)	-	Forward	IRH	-131	BNP PARIBAS	4 945 195		CZK	4 170 761		05.08.2021	CZK	130 000 000		05.08.2021	
98.	Interest Rate Sw ap	CI27025R 22.02.2027 (0)	-	Forward	IRH	-140	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	5 429 706		CZK	4 492 176		22.02.2027	CZK	35 000 000		22.02.2027	
99.	Interest Rate Sw ap	CI27027R 23.02.2027 (0)	-	Forward	IRH	-114	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	4 349 178		CZK	3 587 964		23.02.2027	CZK	28 000 000		23.02.2027	
100.	Interest Rate Sw ap	CI270210R 23.02.2027 (0)	-	Forward	IRH	123	BNP PARIBAS	3 587 964		CZK	4 405 956		23.02.2027	CZK	28 000 000		23.02.2027	
101.	Interest Rate Sw ap	CI27029R 22.02.2027 (0)	-	Forward	IRH	153	BNP PARIBAS	4 489 683		CZK	5 511 217		22.02.2027	CZK	35 000 000		22.02.2027	
102.	Interest Rate Sw ap	CI210612R 21.06.2021 (0)	-	Forward	IRH	2	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	5 848 000		CZK	5 823 463		21.06.2021	CZK	150 000 000		21.06.2021	
103.	Interest Rate Sw ap	CI210613R 25.06.2021 (0)	-	Forward	IRH	0	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	9 746 667		CZK	9 685 211		25.06.2021	CZK	250 000 000		25.06.2021	
104.	Interest Rate Sw ap	CI23064R 07.06.2023 (0)	-	Forward	IRH	-141	SOCIETE GENERALE PARIS	15 180		EUR			07.06.2023	EUR	1 500 000		07.06.2023	
105.	Interest Rate Sw ap	CI22045R 19.04.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-22	BNP PARIBAS			EUR			19.04.2022	EUR	800 000		19.04.2022	
106.	Interest Rate Sw ap	CI26051R 25.05.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-43	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	5 044		EUR			25.05.2026	EUR	900 000		25.05.2026	
107.	Interest Rate Sw ap	CI21032R 05.03.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-13	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	9 773 370		HUF	1 144 889		05.03.2021	HUF	800 000 000		05.03.2021	
108.	Interest Rate Sw ap	CI21049R 19.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	15	SOCIETE GENERALE PARIS	10 342 329		HUF	1 321 667		19.04.2021	HUF	1 000 000 000		19.04.2021	
109.	Interest Rate Sw ap	CI210418R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-192	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	23 088 781		HUF	985 444		21.04.2021	HUF	700 000 000		21.04.2021	
110.	Interest Rate Sw ap	CI210421R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-465	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	53 059 932		HUF	1 993 333		21.04.2021	HUF	1 500 000 000		21.04.2021	
111.	Interest Rate Sw ap	CI21052R 14.05.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-8	BNP PARIBAS	6 408 767		HUF	638 889		14.05.2021	HUF	500 000 000		14.05.2021	
112.	Interest Rate Sw ap	CI210432R 19.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	44	BNP PARIBAS	1 008 889		HUF	14 506 849		19.04.2021	HUF	1 000 000 000		19.04.2021	
113.	Interest Rate Sw ap	CI210436R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	34	BNP PARIBAS	941 111		HUF	13 655 342		21.04.2021	HUF	1 000 000 000		21.04.2021	
114.	Interest Rate Sw ap	CI210439R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	105	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	2 556 239		HUF	35 958 904		21.04.2021	HUF	2 500 000 000		21.04.2021	
115.	Interest Rate Sw ap	IR22031R 07.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-257	mBank SA (Emitent)	1 031 892		PLN	764 179		07.03.2022	PLN	14 500 000		07.03.2022	
116.	Interest Rate Sw ap	IR22107R 25.10.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-244	BNP PARIBAS	996 485		PLN	744 421		25.10.2022	PLN	12 000 000		25.10.2022	
117.	Interest Rate Sw ap	IR230110R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-149	SOCIETE GENERALE PARIS	2 268 095		PLN	2 105 294		25.01.2023	PLN	30 000 000		25.01.2023	
118.	Interest Rate Sw ap	IR230112R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-115	SOCIETE GENERALE PARIS	1 843 675		PLN	1 718 148		25.01.2023	PLN	25 000 000		25.01.2023	
119.	Interest Rate Sw ap	IR23014R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-99	ING BANK SŁĄSKI SA	1 518 102		PLN	1 409 676		25.01.2023	PLN	20 000 000		25.01.2023	
120.	Interest Rate Sw ap	IR23017R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-43	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	751 151		PLN	703 937		25.01.2023	PLN	10 000 000		25.01.2023	
121.	Interest Rate Sw ap	IR240411R 25.04.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-301	BNP PARIBAS	4 951 860		PLN	4 621 931		25.04.2024	PLN	50 000 000		25.04.2024	
122.	Interest Rate Sw ap	IR24048R 25.04.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-462	The Goldman Sachs Group Inc.	7 902 969		PLN	7 395 090		25.04.2024	PLN	80 000 000		25.04.2024	
123.	Interest Rate Sw ap	IR250710R 25.07.2025 (0)	-	CIRS	IRH	-533	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	5 501 819		PLN	4 929 355		25.07.2025	PLN	40 000 000		25.07.2025	
124.	Interest Rate Sw ap	IR25076R 25.07.2025 (0)	-	CIRS	IRH	-673	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	7 141 295		PLN	6 418 346		25.07.2025	PLN	52 000 000		25.07.2025	
125.	Interest Rate Sw ap	IR26074R 27.07.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-962	Santander Bank Polska (Emitent)	9 817 200		PLN	8 783 386		27.07.2026	PLN	60 000 000		27.07.2026	
126.	Interest Rate Sw ap	IR26082R 25.08.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-754	BNP PARIBAS	5 224 636		PLN	4 421 401		25.08.2026	PLN	30 000 000		25.08.2026	
127.	Interest Rate Sw ap	IR26086R 25.08.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-363	ING BANK SŁĄSKI SA	2 598 062		PLN	2 210 701		25.08.2026	PLN	15 000 000		25.08.2026	
128.	Interest Rate Sw ap	IR280412R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-154	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	2 786 622		PLN	2 621 724		25.04.2028	PLN	14 200 000		25.04.2028	
129.	Interest Rate Sw ap	IR280415R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-175	BNP PARIBAS	2 957 117		PLN	2 769 427		25.04.2028	PLN	15 000 000		25.04.2028	

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' | IRH | Ograniczenie ryzyka w walutach jego portfela papierów w wartościach tych denominowanych w walutach obcych (IRH)

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

strona 4		30.06.2019															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania		Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania		Termin zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
175.	Interest Rate Sw ap C220332R 23.03.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-71	The Goldman Sachs Group Inc.	116 711	USD	11 846	USD	23.03.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
176.	Interest Rate Sw ap C220334R 23.03.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-48	SOCIETE GENERALE PARIS	110 401	USD	11 846	USD	23.03.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
177.	Interest Rate Sw ap C220337R 23.03.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-43	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	157 332	USD	17 769	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
178.	Interest Rate Sw ap C22055R 23.05.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-218	SOCIETE GENERALE PARIS	329 334	USD	32 224	USD	23.05.2022	5 000 000	USD	5 000 000	USD	23.05.2022	23.05.2022
179.	Interest Rate Sw ap C220921R 26.09.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-41	SOCIETE GENERALE PARIS	68 266	USD	5 962	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
180.	Interest Rate Sw ap C220922R 26.09.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-22	The Goldman Sachs Group Inc.	119 327	USD	11 924	USD	26.09.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
181.	Interest Rate Sw ap C220924R 26.09.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-13	SOCIETE GENERALE PARIS	60 598	USD	5 962	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
182.	Interest Rate Sw ap C220927R 26.09.2022 (0)	-	Forw ard	IRH	-12	The Goldman Sachs Group Inc.	60 157	USD	5 962	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
183.	Interest Rate Sw ap C240128R 22.01.2024 (0)	-	Forw ard	IRH	-62	SOCIETE GENERALE PARIS	181 071	USD	6 545	USD	22.01.2024	2 000 000	USD	2 000 000	USD	22.01.2024	22.01.2024
184.	Interest Rate Sw ap C240132R 22.01.2024 (0)	-	Forw ard	IRH	-65	The Goldman Sachs Group Inc.	328 621	USD	11 841	USD	22.01.2024	3 800 000	USD	3 800 000	USD	22.01.2024	22.01.2024
185.	Interest Rate Sw ap C260411R 06.04.2026 (0)	-	Forw ard	IRH	-69	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	395 913	USD	6 689	USD	06.04.2026	3 000 000	USD	3 000 000	USD	06.04.2026	06.04.2026
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'			IRH	Ograniczenie ryzyka w alutach ego portfela papierów w artosiowych denomnom anych w w alutach ob-cych (IR4)													

Nota - 7 Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu

W poniższych informacjach (Nota 7) przedstawione są – zgodnie z przepisami Rozporządzenia o rachunkowości funduszy - informacje dot. transakcji *buy sell-back / sell buy-back* oraz *repo* i *reverse repo* – przedstawianych jako transakcje z przyrzeczeniem odkupu. W sprawozdaniu ma miejsce rozróżnienie typów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych ('transakcje zwrotne kupno-sprzedaż' BSB lub 'transakcje zwrotne sprzedaż-kupno' SBB oraz 'transakcja odkupu' *repo* i *reverse repo*). Pojedyncza transakcja zawiera w takim przypadku dwa komponenty, np. BSB: zakup i odsprzedaż w ustalonym późniejszym terminie. W przypadku transakcji *repo / reverse repo* przedmiotem drugiej części transakcji jest ten sam instrument, a dysponowanie nim w okresie obowiązywania umowy jest ograniczone, podczas gdy dla transakcji BSB i SBB wskazane powyżej elementy umowy nie występują. Dla wyraźnej prezentacji powyższego rozróżnienia w nocie 7 w sytuacji zawartej transakcji przedstawiana jest dodatkowa klasyfikacja.

Innym rodzajem transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych są przedstawiane w nocie 7 transakcje 'udzielania pożyczek papierów wartościowych, transakcje 'zaciąganie pożyczek papierów wartościowych'.

- Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu (*Buy-sell-back*)

		30.06.2019	31.12.2018
	Transakcje typu <i>Buy-sell-back</i> (wartość należności z tyt. odsprzedaży papieru)	5 003 tys. zł	nie miał zawartych
a.	Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na Subfundusz praw własności i ryzyk	nie miał zawartych	nie miał zawartych
b.	Transakcje, w wyniku których nie następuje przeniesienie na Subfundusz praw własności i ryzyk	nie miał zawartych	nie miał zawartych
c.	Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na Subfundusz praw własności i nie następuje przeniesienie na Subfundusz ryzyk Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na Subfundusz praw własności i nie następuje przeniesienie na Subfundusz ryzyka (wartość należności z tyt. odsprzedaży papieru)	Zaprezentowane w tabeli poniżej	nie miał zawartych

Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na Fundusz praw własności i nie następuje przeniesienie na Fundusz ryzyka										
Lp.	Kontrahent	Rodzaj	Wycena w walucie (w tys.)	Waluta	Dni do zapadalności	% Aktywów	Instrument bazowy	ISIN	Wartość nominalna (instr. bazowy w tys.)	Wycena w tys. PLN
1.	mBank SA	BSB	5 003	PLN	1	0,17%	PS0123	PL0000110151	4 844	5 003
1.						0,17%				5 003

- Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu do odkupu (*Sell-buy-back*)

		30.06.2019	31.12.2018
	Transakcje typu <i>Sell-buy-back</i> (wartość zobowiązania do odkupu papieru)	Zaprezentowane w tabeli poniżej	5 kontraktów z: <ul style="list-style-type: none"> • 2 z Ipopema Securities SA • 1 z Raiffeisen Bank International AG • 1 z Haitong Bank O/Polska • 1 z mBank SA Kwota transakcji: 88 322 tys. zł <ul style="list-style-type: none"> • na 3 327 tys. zł • na 31 926 tys. zł • na 45 085 tys. zł • na 4 991 tys. zł • na 2 993 tys. zł Czas do zapadalności (względem daty bilansowej): poniżej 1 tygodnia za wyjątkiem kontraktu z Raiffeisen bez terminu zapadalności. Zobowiązanie ogółem z tego tytułu stanowi 4.2% Aktywów. Kontrakty dotyczyły (<i>nominalnie</i>) <ul style="list-style-type: none"> • obligacji Skarbu Państwa:

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

WZ0126 (78 mln zł)
 WZ0524 (8 mln zł)
 Poland Rep Bond (0.7 mln €)

Transakcje typu Sell-buy-back										
Lp.	Kontrahent	Rodzaj	Wycena w walucie (w tys.)	Waluta	Dni do zapadalności	% Aktywów	Instrument bazowy	ISIN	Wartość nominalna (instr. bazowy w tys.)	Wycena w tys. PLN
1.	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	SBB	5 323	USD	Bez terminu	0,67%	PL220301	US857524AB80	5 900	20 017
2.	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	SBB	812	USD	Bez terminu	0,10%	PL220301	US857524AB80	900	3 053
3.	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	SBB	4 926	USD	Bez terminu	0,61%	PL240102	US857524AC63	5 300	18 428
4.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	80 210	PLN	1	2,67%	PS0422	PL0000109492	78 666	80 218
5.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	2 920	USD	Bez terminu	0,36%	PL210401	US857524AA08	2 750	10 904
6.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	21 318	USD	2	2,65%	PL220301	US857524AB80	19 578	79 618
7.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	4 000	EUR	Bez terminu	0,50%	PL230301	US731011AT95	3 857	14 938
8.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	774	EUR	15	0,11%	PL240101	XS1015428821	670	3 285
9.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	7 628	USD	5	0,95%	PL260401	US731011AU68	7 500	28 633
10.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	100 138	PLN	5	3,34%	PS0123	PL0000110151	97 000	100 147
11.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	184 653	PLN	5	6,16%	WS0922	PL0000102646	158 000	184 674
12.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	50 161	PLN	5	1,67%	WZ0124	PL0000107454	50 000	50 166
13.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	59 545	PLN	5	1,99%	WZ0126	PL0000108817	60 000	59 551
14.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	169 261	PLN	5	5,64%	WZ0524	PL0000110615	170 000	169 275
15.	SOCIETE GENERALE SA ODDZIAŁ W POLSCE	SBB	45 898	PLN	2	1,53%	PS0422	PL0000109492	45 000	45 906
						28,95%				868 813

- Należności z tytułu papierów wartościowych pożyczonych od Subfunduszu w trybie przepisów rozporządzenia o pożyczkach papierów wartościowych

	30.06.2019	31.12.2018
pożyczone papiery wartościowe (w charakterze pożyczkodawcy)	nie miał otwartych pozycji	nie miał otwartych pozycji
Zobowiązania z tytułu papierów wartościowych pożyczonych przez Subfundusz w trybie przepisów rozporządzenia o pożyczkach papierów wartościowych		
	30.06.2019	31.12.2018
pożyczone papiery wartościowe (w charakterze pożyczkobiorcy)	nie miał otwartych pozycji	nie miał otwartych pozycji

Nota - 8 Kredyty i pożyczki

	30.06.2019	31.12.2018
a. zobowiązania z tytułu pożyczek i kredytów	nie wystąpiły	nie wystąpiły
b. należności z tytułu udzielonych pożyczek pieniężnych	nie wystąpiły	nie wystąpiły

Nota - 9 Waluty i różnice kursowe

1. Na dzień 30 czerwca 2019 część aktywów, w tym środki pieniężne i ich ekwiwalenty i część pasywów Subfunduszu była denominowana w walutach obcych – zgodnie z poniższym zestawieniem walutowej struktury pozycji bilansu:

NOTA-9 I. WALUTOWA STRUKTURA POZYCJI BILANSU	30.06.2019		31.12.2018	
	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
I. Aktywa		3 000 033		2 089 380
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty		31 255		22 791
CZK	0	0	226	38
EUR	3 176	13 504	1 360	5 849
HUF	0	0	489 679	6 559
PLN	17 417	17 417	10 030	10 030
USD	89	334	83	315
2. Należności		543		83 996
EUR	0	0	2 000	8 600
PLN	543	543	75 396	75 396
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu		5 003		0
PLN	5 003	5 003	0	0
4. Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku, w tym:		2 121 459		1 262 741
- dłużne papiery wartościowe		2 121 459		1 262 741
CZK	168 484	28 170	168 218	28 143
EUR	67 999	289 130	57 790	248 500
HUF	0	0	5 535 762	74 146
PLN	1 461 780	1 461 780	701 953	701 953
USD	91 704	342 379	55 856	209 999
5. Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku, w tym:		841 773		719 852
CZK	-158 355	-26 477	-159 103	-26 619
EUR	-57 679	-245 250	-50 360	-216 531
HUF	15 025	198	59 947	803
PLN	319 828	319 828	319 039	319 039
USD	8 721	32 558	-8 072	-30 346
- dłużne papiery wartościowe		760 916		673 506
EUR	14 855	63 171	15 923	68 473
PLN	697 745	697 745	605 033	605 033
6. Nieruchomości	0	0	0	0
7. Pozostałe aktywa		0		0
II. Zobowiązania		1 030 205		589 052
CZK	5 117	856	4 524	757
EUR	21 626	91 960	16 180	69 573
HUF	51 554	678	37 617	504
PLN	732 788	732 788	494 765	494 765
USD	54 619	203 923	6 236	23 453

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

Aktywa wyceniane (oraz zobowiązania ustalane) w walutach innych niż złote, na dzień bilansowy, zostały przeliczone na złote z zastosowaniem średniego kursu dla danej waluty ogłaszanego przez NBP

Tabela nr 124/A/NBP/2019 z dnia 2019-06-28			
	Nazwa waluty	Kod waluty	Kurs średni
1,	dolar amerykański	1 USD	3,7336
2,	euro	1 EUR	4,2520
3,	forint (Węgry)	100 HUF	1,3140
4,	korona czeska	1 CZK	0,1672

2. Dodatnie i ujemne różnice kursowe w przekroju lokat Subfunduszu, zgodnie z podziałem przedstawionym w zestawieniu lokat, w podziale na zrealizowane i niezrealizowane:

NOTA-9 II. DODATNIE I UJEMNE RÓŻNICE KURSOWE W PRZEKROJU LOKAT FUNDUSZU	30.06.2019			
	Dodatnie różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.
Akcje	0	0	0	0
Warranty subskrypcyjne	0	0	0	0
Prawa do akcji	0	0	0	0
Prawa poboru	0	0	0	0
Kwity depozytowe	0	0	0	0
Listy zastawne	719	0	0	0
Dłużne papiery wartościowe	0	0	13	8 827
Instrumenty pochodne	0	3 903	0	0
Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	0	0	0	0
Jednostki uczestnictwa	0	0	0	0
Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0	0
Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w spółnego inwestowania mające siedzibę za granicą	0	0	0	0
Wierzytelności	0	0	0	0
Weksle	0	0	0	0
Depozyty	0	0	0	0
Waluty	0	0	0	0
Nieruchomości	0	0	0	0
Statki morskie	0	0	0	0
Inne	0	0	0	0

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

NOTA-9 II. DODATNIE I UJEMNE RÓŻNICE KURSOWE W PRZEKROJU LOKAT FUNDUSZU	31.12.2018				30.06.2018			
	Dodatnie różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.
Akcje	0	0	0	0	0	0	0	0
Warranty subskrypcyjne	0	0	0	0	0	0	0	0
Prawa do akcji	0	0	0	0	0	0	0	0
Prawa poboru	0	0	0	0	0	0	0	0
Kwity depozytowe	0	0	0	0	0	0	0	0
Listy zastawne	0	0	39	0	0	0	39	0
Dłużne papiery w artosciowe	0	4 405	2 101	0	0	6 467	1 530	0
Instrumenty pochodne	0	0	0	711	0	0	0	2 869
Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	0	0	0	0	0	0	0	0
Jednostki uczestnictwa	0	0	0	0	0	0	0	0
Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0	0	0	0	0	0
Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w spólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	0	0	0	0	0	0	0	0
Wierzytelności	0	0	0	0	0	0	0	0
Weksle	0	0	0	0	0	0	0	0
Depozyty	0	0	0	0	0	0	0	0
Waluty	0	0	0	0	0	0	0	0
Nieruchomości	0	0	0	0	0	0	0	0
Statki morskie	0	0	0	0	0	0	0	0
Inne	0	0	0	0	0	0	0	0

Nota - 10 Dochody i ich dystrybucja

1) Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat oraz wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny

NOTA-10 ZREALIZOWANY I NIEZREALIZOWANY ZYSK (STRATA) ZE ZBYCIA LOKAT	30.06.2019		31.12.2018		30.06.2018	
	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat w tys.	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.
Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku	3 954	1 812	-5 513	12 795	-1 037	4 007
Instrumenty pochodne	18	0	-174	0	-99	0
Dłużne papiery w artosciowe	3 936	1 812	-5 339	12 795	-938	4 007
Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku	1 117	-2 712	922	-3 405	-4	-3 344
Listy zastawne	719	0	-39	0	-39	0
Instrumenty pochodne	-208	-4 528	1 839	-5 102	1 423	-5 061
Dłużne papiery w artosciowe	606	1 816	-878	1 697	-1 388	1 717
Nieruchomości	0	0	0	0	0	0
Pozostałe	0	0	0	0	0	0
Suma:	5 071	-900	-4 591	9 390	-1 041	663

- 2) Subfundusz, zgodnie ze Statutem, nie wypłaca dywidend ani innych dochodów. Dochody Subfunduszu osiągnięte w wyniku dokonanych inwestycji, w tym odsetki oraz dywidendy, powiększają wartość aktywów danego subfunduszu, jak również zwiększają odpowiednio wartość Jednostek Uczestnictwa tego subfunduszu.

Nota - 11 Koszty Subfunduszu

Towarzystwo nie pokrywa, ani nie zwraca Subfunduszowi kosztów ponoszonych, przy czym część kosztów obsługi Subfunduszu (które, zgodnie ze Statutem, nie obciążają Subfunduszu) opłacana jest przez Towarzystwo (z wynagrodzenia za zarządzanie). Subfundusz, zgodnie ze Statutem, ponosi koszty wynagrodzenia za zarządzanie oraz koszty niepodlegające ograniczeniu limitowemu.

Fundusz wypłaca Towarzystwu wynagrodzenie za zarządzanie każdym z subfunduszy (naliczane codziennie odrębnie w każdym z subfunduszy). Stawki wynagrodzenia (stałego – jeśli nie zaznaczono inaczej) za zarządzanie Subfunduszem:

Kat. JU	Maksymalna stawka (określona w Statucie)	Stawka obowiązująca na dzień bilansowy	Data, od kiedy stawka obowiązuje
A	1,20 %	1,20 %	1.11.2013
E	0,80 %	0,80 %	1.11.2013
I	1,00 %	1,00 %	1.11.2013

- Stawki - w granicach poziomu maksymalnego określonego w Statucie – są zmieniane w drodze uchwały zarządu Towarzystwa.
- Wynagrodzenie za zarządzanie (stałe) wyliczane jest w każdym dniu, proporcjonalnie do wartości aktywów netto na poprzedni dzień wyceny – według obowiązującej stawki.
- Zgodnie ze Statutem wynagrodzenie zmienne nie jest naliczane ani pobierane. Wynagrodzenie zmienne byłoby wynagrodzeniem uzależnionym od wzrostu wartości Jednostki Uczestnictwa w danym Dniu Wyceny – w stosunku do poziomu odniesienia (historycznego maksimum wycen).
- Kwoty wynagrodzenia za zarządzanie naliczane są w odniesieniu do Jednostek Uczestnictwa każdej kategorii odrębnie.

	1. półrocze 2019	rok 2018
Subfundusz naliczył wynagrodzenie za zarządzanie w wysokości (tys. zł)	9 916	12 430

Wynagrodzenie Towarzystwa uzależnione jest w całości od wartości aktywów netto Subfunduszu.

Z kwoty wpłat uczestników pobierana jest opłata manipulacyjna, która jest przekazywana podmiotom prowadzącym dystrybucję, w tym Towarzystwu. W Statucie Funduszu wskazane są stawki maksymalne tej opłaty, jednakże mające zastosowanie stawki opłat manipulacyjnych zależą od kwoty wpłaty, sytuacji szczególnej wynikającej np. z prawa do akumulacji oraz sposobu rozliczenia (w tym wskazania prowadzącego dystrybucję). Szczegółową tabelę stawek opłat manipulacyjnych Towarzystwo prezentuje w materiałach informacyjnych.

Zgodnie ze Statutem Funduszu Subfundusz może uznawać za koszty i ponosić następujące rodzaje opłaty, prowizje i wynagrodzenia:

- (i) wynagrodzenie Towarzystwa za zarządzanie – ujawniane szczegółowo w niniejszej nodcie.
- (ii) koszty obsługi transakcji (w tym opłaty), opłaty za wykonywanie czynności i usług bankowych w związku z Aktywami Subfunduszu bądź zobowiązaniami Subfunduszu, w tym w szczególności:
 - a) opłaty i prowizje maklerskie – ujmowane w kosztach konkretnych transakcji,
 - b) opłaty i prowizje bankowe,
 - c) prowizje i opłaty na rzecz instytucji depozytowych oraz rozliczeniowych oraz prowadzących wymagane prawem repozytoria, w tym opłaty transakcyjne,
 - d) koszty obsługi i odsetek od kredytów i pożyczek zaciągniętych;
- (iii) podatki i opłaty oraz inne koszty wynikające z przepisów prawa lub regulacji wewnętrznych sądów, w tym w szczególności:
 - a) opłaty sądowe i notarialne,
 - b) koszty postępowania przed sądem powszechnym, sądem polubownym, sądem administracyjnym oraz cywilnego postępowania egzekucyjnego, związane z działalnością inwestycyjną Funduszu dokonywaną na rzecz Subfunduszu,
 - c) opłaty za decyzje i zezwolenia Komisji,
- (iv) koszty likwidacji;
- (v) koszty obsługi prawnej (w tym pomocy prawnej i doradztwa podatkowego), związane z działalnością inwestycyjną – na zasadach określonych w Statucie.

Szczegółowe zasady ujmowania, rozliczania oraz stawki kosztów i ew. pułapy określone są w Statucie Funduszu.

Koszty (i), (iii), (v) zostały zaprezentowane odrębnie (w niniejszej nodcie-11 oraz w części sprawozdania 'Rachunek Wyniku z Operacji').

Informacje dotyczące kosztów faktycznie poniesionych uwzględnione są w dwóch wskaźnikach:

- wskaźniku kosztów całkowitych (WKC) – prezentowanym w prospekcie informacyjnym funduszu, wyliczanym za każdy rok za rok poprzedni, przy czym uwzględnione są w nim wszystkie koszty zaprezentowane w rachunku wyniku w sprawozdaniu finansowym,
- wskaźniku opłat bieżących – prezentowanym w dokumencie 'kluczowe informacje dla inwestora', wyliczanym corocznie za rok poprzedni, przy czym wskaźnik uwzględnia także stawki opłat bieżących w funduszach znajdujących się w portfelu lokat.

Wskaźniki mają różną konstrukcję, jednakże przedstawiają koszty odniesione do średniorocznych aktywów netto.

Nota - 12 Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa

Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego i na koniec roku obrotowego za trzy ostatnie lata.

Opis	30.06.2019	31.12.2018	31.12.2017	31.12.2016
Wartość Aktywów Netto	1 969 828 tys. zł	1 500 328 tys. zł	759 979 tys. zł	999 019 tys. zł
Wartość JU kat. A, E	11,40	11,26	10,99	10,70
Wartość JU kat. I	11,53	11,38	11,08	10,77

Informacje dodatkowe

A Informacje o znaczących zdarzeniach, dotyczących lat ubiegłych, ujętych w sprawozdaniu finansowym

Nie wystąpiły znaczące zdarzenia dotyczące lat ubiegłych wymagające ujęcia w sprawozdaniu finansowym za bieżący okres sprawozdawczy.

B Informacje o znaczących zdarzeniach po dniu bilansowym

Nie wystąpiły znaczące zdarzenia po dniu bilansowym, które nie zostały uwzględnione w bieżącym sprawozdaniu finansowym.

C Dokonane korekty błędów podstawowych

W okresie sprawozdawczym nie dokonywano korekt błędów podstawowych.

Ponadto:

- a. nie dokonywano korekt wycen Jednostek Uczestnictwa;
- b. Jednostki Uczestnictwa były zbywane i odkupywane bez ograniczeń;
- c. Zawierane transakcje były rozliczane zgodnie z zasadami rynkowymi, w tym w zakresie terminowości i prawidłowości.

D Inne informacje

Nazwa Subfunduszu, Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu i ich zbywanie, zarządzający

Subfundusz *Pekao Konserwatywny Plus* wydzielony w funduszu *Pekao Fundusz Inwestycyjny Otwarty*.

11.01.2019 nazwa subfunduszu została zmieniona, z: **Pekao Pieniężny Plus** na '**Pekao Oszczędny Plus**'. Następnie, 14 czerwca 2019 dokonana została zmiana nazwy na **Pekao Konserwatywny Plus** (w niniejszym sprawozdaniu subfundusz jest wykazywany pod tą nazwą).

Data rozpoczęcia zbywania Jednostek Uczestnictwa Subfunduszu: 11 września 2013 roku.

Informacje o polityce inwestycyjnej Subfunduszu, jego celu inwestycyjnym, specjalizacji oraz ograniczeniach inwestycyjnych ujawnione są we Wprowadzeniu do sprawozdania połączonego Funduszu, zgodnie z opisami zawartymi w Statucie Funduszu.

Fundusz zbywa Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu następujących kategorii (w rozumieniu art. 158 Ustawy):

- Jednostki Uczestnictwa kategorii A
- Jednostki Uczestnictwa kategorii E
- Jednostki Uczestnictwa kategorii I

Jednostki uczestnictwa tych kategorii mogą różnić się między sobą:

- (i) stawkami określającymi wynagrodzenie za zarządzanie
- (ii) faktycznie stosowanymi stawkami opłat manipulacyjnych pobieranych przy zbywaniu
- (iii) progiem minimalnym wartości inwestycji
- (iv) wskazaniem prowadzących dystrybucję (siecią dystrybucji)

Jednostki Uczestnictwa zbywane są (i odkupywane) w Dni Wyceny, to jest w dni, w których odbywa się sesja na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie.

Zarządzanie portfelem lokat Subfunduszu odbywa się w Towarzystwie.

Metryka Subfunduszu

Towarzystwo zapewnia uczestnikom Funduszu możliwość korzystania z infolinii: [tel. w Polsce] 0-801 641 641 lub +48 22 640 4040. Istnieje także możliwość skorzystania z poczty elektronicznej: *Fundusz@Pekaotfi.pl*. W zakresie elektronicznej informacji o stanie rachunków uczestników Towarzystwo oferuje system automatycznej obsługi i informacji *eFunduszePekao*. Ponadto Towarzystwo zarządza informacyjną stroną w Internecie: *www.pekaotfi.pl* (wyceny, informacje o Funduszu). Na stronie tej dostępne są bieżące wersje Prospektu Informacyjnego, dokumentu 'Kluczowe informacje dla inwestora' (KII), bieżące oraz wcześniejsze sprawozdania finansowe.

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO KONSERWATYWNY PLUS
Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

Nazwa	Pekao Fundusz Inwestycyjny Otwarty - Pekao Konserwatywny Plus		
Nazwa w j. angielskim	Pekao Money Market Plus (<i>subfund of: Pekao Open-End Investment Fund</i>)		
Rozpoczęcie wycen	11.09.2013	Wartość początkowa	10,00 zł
Oznaczenia	ISIN JU	IZFiA	Nr krajowy (KNF)
w systemach	PLPPTFI00527	PIO059	PLFIO000201
<i>Podstawowe dane na 30 czerwca 2019</i>			
Wartość aktywów netto	1 969 828 tys. zł	Wartość JU kat. A	11,40 zł

Warszawa, dnia 19.08.2019 roku.