

PEKAO TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH SPÓŁKA AKCYJNA

02-674 Warszawa, ul. Marynarska 15

OGŁASZA

PÓŁROCZNE SPRAWOZDANIE JEDNOSTKOWE*
PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
subfunduszu w PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNYM FUNDUSZU INWESTYCYJNYM
OTWARTYM

ZA OKRES PÓŁROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 30 CZERWCA 2019 ROKU

* Sprawozdanie jednostkowe jest załącznikiem do połączonego sprawozdania funduszu Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny 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 Spokojna Inwestycja (wydzielonego w Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty)

na które składają się:

1. zestawienie lokat subfunduszu według stanu na dzień 30 czerwca 2019 o wartości 5 662 594 tys. zł;
2. bilans subfunduszu na dzień 30 czerwca 2019 wykazujący wartość aktywów netto subfunduszu w kwocie 4 887 542 tys. zł;
3. rachunek wyniku z operacji subfunduszu za okres od 1 stycznia 2019 do 30 czerwca 2019 wykazujący wynik z operacji w kwocie 34 464 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

Spis treści

Zestawienie lokat
Bilans
Rachunek wyniku z operacji
Zestawienie zmian w aktywach netto
Noty objaśniające
Nota - 1 Polityka rachunkowości Funduszu
<i>Przepisy prawne regulujące rachunkowość Funduszu i Subfunduszu</i>
<i>Zasady ogólne / jednakowe dla wszystkich funduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA</i>
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
<i>Zasady szczególne – dotyczące Funduszu / Subfunduszu</i>
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
Kontrakty FX FWD, IRS
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 Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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	207 561	207 414	3.57%	220 068	219 837	3.67%
Dłużne papiery wartościowe	4 667 689	4 722 688	81.26%	4 448 025	4 510 029	75.36%
Instrumenty pochodne	0	-4 757	-0.10%	0	-2 505	0.00%
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	728 215	737 249	12.70%	990 090	1 000 220	16.72%
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:	5 603 465	5 662 594	97.43%	5 658 183	5 727 581	95.75%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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											207 561	207 414	3.57%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00433)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.04.2022	2.57%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1000	30000	30 000	29 365	0.51%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00458)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	16.10.2023	2.66%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1000	30000	30 000	30 050	0.52%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00025)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.04.2021	2.37%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500000	115	57 523	57 810	0.99%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00033)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	18.06.2021	2.31%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500000	140	70 038	70 164	1.21%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00132)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	30.09.2024	2.32%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500000	40	20 000	20 025	0.34%
Suma:											207 561	207 414	3.57%

DŁUŻNE 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									1 581 545	1 589 072	27.32%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									1 581 545	1 589 072	27.32%
Aktywny rynek nieregulowany									79 601	79 113	1.36%
PZU Finance AB XS1082661551	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PZU Finance AB	Szwecja	03.07.2019	1.38 (Stały kupon)	1000	11443	49 532	49 342	0.85%
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%
Polski Skarb Państwa XS0458008496	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Państwa	Polska	15.10.2019	4.68 (Stały kupon)	50000	75	16 761	16 716	0.29%
Energa Fiannce AB Seria EMTN XS0906117980	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Energa Fiannce AB	Szwecja	19.03.2020	3.25 (Stały kupon)	1000	2970	13 307	13 054	0.22%
Nienotowane na aktywnym rynku									1 501 944	1 509 959	25.96%
ING BANK ŚLĄSKI SA (Emitent) Seria INGBS191219 PLBSK0000066	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA (Emitent)	Polska	19.12.2019	2.54 (Zmienny kupon)	100000	295	29 584	29 540	0.51%
SANTANDER CONSUMER BANK SA Seria SCB000034	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SANTANDER CONSUMER BANK SA	Polska	05.05.2020	2.99 (Zmienny kupon)	100000	450	45 000	45 202	0.78%
SANTANDER CONSUMER BANK SA Seria SCB000035	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SANTANDER CONSUMER BANK SA	Polska	29.05.2020	2.99 (Zmienny kupon)	100000	400	40 000	40 104	0.69%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) Seria BGK0520S014A PL0000500211	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	19.05.2020	2.22 (Zmienny kupon)	1000	61000	61 000	61 155	1.05%
BANK MILLENNIUM SA (Emitent) Seria T PLBIG0000446	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK MILLENNIUM SA (Emitent)	Polska	21.04.2020	2.79 (Zmienny kupon)	1000	55494	55 637	55 937	0.96%
ENEA SA PLENEA000088	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	10.02.2020	2.64 (Zmienny kupon)	100000	1008	101 516	102 089	1.76%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

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	2000	20 000	20 004	0.34%
Santander Bank Polska (Emitent) Seria BPW H PLBZ0000291	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	27.09.2019	2.25 (Stały kupon)	1000	120000	120 000	122 715	2.11%
MBANK HIPOTECZNY SA Seria BRE [K31]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	14.08.2019	2.16 (Zmienny kupon)	100000	650	65 000	65 331	1.12%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA Seria O-PBH-001 PLBPHHP00226	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	18.09.2019	2.17 (Zmienny kupon)	10000	5000	50 000	50 039	0.86%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria DC137P020120	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	02.01.2020	2.07 (Stały kupon)	1000	15000	15 000	15 162	0.26%
MBANK HIPOTECZNY SA Seria BRE [K34]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	25.03.2020	2.17 (Zmienny kupon)	100000	700	70 000	70 021	1.20%
mLeasing Sp z o.o. Seria 029/2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mLeasing Sp z o.o.	Polska	25.09.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	200	19 783	19 896	0.34%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH190723	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	23.07.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	500	49 487	49 935	0.86%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL023 010719	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	01.07.2019	0.00 (Zerowy kupon)	10000	8500	84 386	84 995	1.46%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL024 010819	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	01.08.2019	0.00 (Zerowy kupon)	10000	4000	39 584	39 926	0.69%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL026 020919	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	02.09.2019	0.00 (Zerowy kupon)	10000	4000	39 575	39 852	0.69%
BZ WBK Faktor Sp. z o.o. Seria D PLBZFKT00043	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BZ WBK Faktor Sp. z o.o.	Polska	18.10.2019	2.09 (Zmienny kupon)	1000	65000	65 000	65 045	1.12%
mLeasing Sp z o.o. Seria 051/2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mLeasing Sp z o.o.	Polska	18.12.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	500	49 457	49 492	0.85%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH191002	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	02.10.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	1200	118 776	119 359	2.05%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH191106	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	06.11.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	1000	98 974	99 268	1.71%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH191206	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	06.12.2019	0.00 (Zerowy kupon)	100000	700	69 290	69 369	1.19%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL027 011019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Lesing Sp. z o.o.	Polska	01.10.2019	0.00 (Zerowy kupon)	10000	1000	9 895	9 946	0.17%
Santander Bank Polska (Emitent) Seria J PLBZ00000309	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	27.04.2020	2.02 (Stały kupon)	1000	160000	160 000	160 571	2.76%
BZ WBK Faktor Sp. z o.o. Seria E PLBZFKT00050	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BZ WBK Faktor Sp. z o.o.	Polska	27.12.2019	2.09 (Zmienny kupon)	1000	25000	25 000	25 006	0.43%
O terminie wykupu powyżej 1 roku									3 086 144	3 133 616	53.94%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									3 086 144	3 133 616	53.94%
Aktywny rynek nieregulowany									2 534 154	2 577 431	44.36%
WS0922 PL0000102646	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	23.09.2022	5.75 (Stały kupon)	1000	123000	138 420	143 665	2.47%
WZ0121 PL0000106068	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2021	1.79 (Zmienny kupon)	1000	11000	10 914	11 128	0.19%
Polski Skarb Panstwa US857524AA08	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	21.04.2021	5.13 (Stały kupon)	1000	14300	57 684	56 725	0.98%
Polski Skarb Panstwa US857524AB80	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	23.03.2022	5.00 (Stały kupon)	1000	32000	129 146	130 073	2.24%
PKO FINANCE AB XS0783934085	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PKO FINANCE AB	Szwecja	26.09.2022	4.63 (Stały kupon)	1000	1000	3 983	3 987	0.07%
Polski Skarb Panstwa US731011AT95	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	17.03.2023	3.00 (Stały kupon)	1000	19268	65 020	74 564	1.28%
DS0725 PL0000108197	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.07.2025	3.25 (Stały kupon)	1000	28000	29 400	30 631	0.53%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Polski Skarb Panstwa US857524AC63	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	22.01.2024	4.00 (Stały kupon)	1000	4095	16 317	16 748	0.29%
WZ0124 PL0000107454	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2024	1.79 (Zmienny kupon)	1000	209599	207 522	210 293	3.62%
MFINANCE FRANCE SA XS1143974159	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	MFINANCE FRANCE SA	Francja	26.11.2021	2.00 (Stały kupon)	1000	1000	4 412	4 491	0.08%
DS0726 PL0000108866	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.07.2026	2.50 (Stały kupon)	1000	35000	34 789	36 410	0.63%
WZ0126 PL0000108817	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2026	1.79 (Zmienny kupon)	1000	332000	322 962	329 314	5.66%
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	2.63%
WZ1122 PL0000109377	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.11.2022	1.79 (Zmienny kupon)	1000	9000	8 845	9 022	0.16%
PS0422 PL0000109492	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.04.2022	2.25 (Stały kupon)	1000	160000	162 302	163 033	2.80%
Ministry of Finance - Hungary US445545AE60	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Hungary	Węgry	29.03.2021	6.38 (Stały kupon)	2000	7500	60 849	60 786	1.05%
PS0123 PL0000110151	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.01.2023	2.50 (Stały kupon)	1000	260000	264 865	268 783	4.62%
WZ0524 PL0000110615	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.05.2024	1.79 (Zmienny kupon)	1000	571500	565 546	569 020	9.79%
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	58000	95 779	96 111	1.65%
Polski Skarb Panstwa XS1015428821	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	15.01.2024	3.00 (Stały kupon)	1000	10200	48 634	50 326	0.87%
Polski Skarb Panstwa XS0841073793	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	09.07.2024	3.38 (Stały kupon)	1000	8778	44 100	45 092	0.78%
Polski Skarb Panstwa XS0479333311	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	20.01.2025	5.25 (Stały kupon)	1000	4210	23 430	23 659	0.41%
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	3000	12 840	13 097	0.23%
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	4000	17 228	17 310	0.30%
Polski Skarb Panstwa XS1288467605	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	09.09.2025	1.50 (Stały kupon)	1000	3000	13 334	14 107	0.24%
PS0424 PL0000111191	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.04.2024	2.50 (Stały kupon)	1000	44900	45 473	46 176	0.79%
Aktywny rynek regulowany									970	974	0.02%
WZ0528 PL0000110383	Aktywny rynek regulowany	Warsaw Stock Exchange	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.05.2028	1.79 (Zmienny kupon)	1000	1000	970	974	0.02%
Nienotowane na aktywnym rynku									551 020	555 211	9.56%
EUROPEAN INVESTMENT BANK XS1492818866	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	EUROPEAN INVESTMENT BANK	Luksemburg	25.08.2026	2.75 (Stały kupon)	1000	37000	37 152	38 863	0.67%
JP Morgan Chase & Co Seria E005 XS1569783613	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	16.06.2027	2.74 (Zmienny kupon)	50000	600	30 000	30 156	0.52%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

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	48000	48 000	48 255	0.83%
SANTANDER CONSUMER BANK SA Seria SCB00038 PLSNTND00117	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SANTANDER CONSUMER BANK SA	Polska	09.08.2021	2.79 (Zmienny kupon)	100000	76	7 641	7 705	0.13%
EUROPEAN INVESTMENT BANK XS1791421479	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	EUROPEAN INVESTMENT BANK	Luksemburg	25.02.2025	1.99 (Zmienny kupon)	1000	144000	143 527	144 569	2.49%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) Seria BGK0223S017A PL0000500245	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	20.02.2023	2.24 (Zmienny kupon)	1000	86000	86 000	86 690	1.49%
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	450	45 000	45 182	0.78%
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	20000	20 000	20 065	0.35%
ENEA SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	26.06.2024	2.99 (Zmienny kupon)	100000	137	13 700	13 705	0.24%
MBANK HIPOTECZNY SA Seria BRE [K35]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	27.07.2020	2.17 (Zmienny kupon)	100000	1200	120 000	120 021	2.06%
Suma:									4 667 689	4 722 688	81.26%

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
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	-4 757	-0.10%
Aktywny rynek regulowany							0	0	0.00%
Aktywny rynek nieregulowany							0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku							0	-4 757	-0.10%
Forward Rate Agreement FR210101 25.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	WIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	150 000	0	18	0.00%
Forward Waluta CZK FW907031 17.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	CZK	1	0	1	0.00%
Forward Waluta EUR FW907001 05.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	233	0.00%
Forward Waluta USD FW907115 12.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA	Polska	USD	1	0	289	0.00%
Forward Waluta USD FW908039 29.08.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1	0	1 166	0.02%
Forward Waluta USD FW908042 29.08.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	USD	1	0	603	0.01%
Forward Waluta USD FW909004 09.09.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1	0	208	0.00%
Forward Waluta USD FW909008 09.09.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	USD	1	0	767	0.01%
Forward Waluta USD FW910001 24.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	USD	1	0	558	0.01%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC19073 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	12 113	12 220	0.21%
Interest Rate Swap CC19073 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 113	-12 075	-0.21%
Interest Rate Swap CC19074 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	18 715	18 881	0.32%
Interest Rate Swap CC19074 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-18 715	-18 639	-0.32%
Interest Rate Swap CC19078 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	8 554	8 630	0.15%
Interest Rate Swap CC19078 03.07.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 554	-8 472	-0.15%
Interest Rate Swap CC19101 15.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	17 222	17 293	0.30%
Interest Rate Swap CC19101 15.10.2019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-17 222	-17 391	-0.30%
Interest Rate Swap CC20031 19.03.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-13 481	-13 451	-0.23%
Interest Rate Swap CC20031 19.03.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	13 481	13 614	0.23%
Interest Rate Swap CC20041 15.04.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	57 547	57 783	0.99%
Interest Rate Swap CC20041 15.04.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-57 547	-58 191	-1.00%
Interest Rate Swap CC20093 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 589	-5 516	-0.09%
Interest Rate Swap CC20093 28.09.2020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 589	5 591	0.10%
Interest Rate Swap CC21021 23.02.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	96 426	97 048	1.67%
Interest Rate Swap CC21021 23.02.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-96 426	-94 934	-1.63%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-17 236	-17 066	-0.29%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	17 236	17 328	0.30%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC211111 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 286	-4 263	-0.07%
Interest Rate Swap CC211111 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 286	4 295	0.07%
Interest Rate Swap CC211116 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-4 456	-4 436	-0.08%
Interest Rate Swap CC211116 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	4 456	4 466	0.08%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 870	-12 869	-0.22%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 870	12 888	0.22%
Interest Rate Swap CC24011 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	38 567	38 888	0.67%
Interest Rate Swap CC24011 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-38 567	-39 788	-0.68%
Interest Rate Swap CC240126 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-14 381	-14 388	-0.25%
Interest Rate Swap CC240126 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	14 381	14 488	0.25%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 049	-5 063	-0.09%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 049	5 092	0.09%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-10 011	-9 981	-0.17%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	10 011	10 097	0.17%
Interest Rate Swap CC24073 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	9 120	9 198	0.16%
Interest Rate Swap CC24073 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 120	-9 244	-0.16%
Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	15 747	15 882	0.27%
Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-15 747	-15 524	-0.27%
Interest Rate Swap CC24079 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-4 974	-5 020	-0.09%
Interest Rate Swap CC24079 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	4 974	5 017	0.09%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-6 909	-9 097	-0.16%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	6 909	9 080	0.16%
Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	11 494	11 587	0.20%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 494	-11 380	-0.20%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 714	-5 730	-0.10%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 714	5 760	0.10%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-13 526	-13 871	-0.24%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	13 526	13 604	0.23%
Interest Rate Swap CI210317R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-97	0.00%
Interest Rate Swap CI210318R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-34	0.00%
Interest Rate Swap CI210410R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	29	0.00%
Interest Rate Swap CI210419R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-357	-0.01%
Interest Rate Swap CI210420R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-310	-0.01%
Interest Rate Swap CI210426R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-51	0.00%
Interest Rate Swap CI210433R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	89	0.00%
Interest Rate Swap CI210437R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	34	0.00%
Interest Rate Swap CI210440R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	139	0.00%
Interest Rate Swap CI210442R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-97	0.00%
Interest Rate Swap CI210444R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-112	0.00%
Interest Rate Swap CI210445R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-104	0.00%
Interest Rate Swap CI21053R 14.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-15	0.00%
Interest Rate Swap CI21054R 17.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-11	0.00%
Interest Rate Swap CI220311R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-851	-0.01%
Interest Rate Swap CI220317R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-470	-0.01%
Interest Rate Swap CI220318R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-143	0.00%
Interest Rate Swap CI22031R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-458	-0.01%
Interest Rate Swap CI220322R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-189	0.00%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap CI220328R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-153	0.00%
Interest Rate Swap CI220331R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-107	0.00%
Interest Rate Swap CI220336R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-57	0.00%
Interest Rate Swap CI220926R 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 CI23033R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-414	-0.01%
Interest Rate Swap CI23039R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-364	-0.01%
Interest Rate Swap CI23043R 20.04.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-1 408	-0.02%
Interest Rate Swap CI23047R 24.04.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-723	-0.01%
Interest Rate Swap CI240118R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-156	0.00%
Interest Rate Swap CI240131R 22.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-51	0.00%
Interest Rate Swap IR21075R 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 IR21078R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-18	0.00%
Interest Rate Swap IR220413R 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 IR22046R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	7	0.00%
Interest Rate Swap IR22048R 25.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-9	0.00%
Interest Rate Swap IR220910R 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 IR230111R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-199	0.00%
Interest Rate Swap IR230114R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-184	0.00%
Interest Rate Swap IR230117R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-97	0.00%
Interest Rate Swap IR23012R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-383	-0.01%
Interest Rate Swap IR23013R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-348	-0.01%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Interest Rate Swap IR23018R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-86	0.00%
Interest Rate Swap IR240415R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-120	0.00%
Interest Rate Swap IR24045R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-169	0.00%
Interest Rate Swap IR24047R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-341	-0.01%
Interest Rate Swap IR250712R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-333	-0.01%
Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-492	-0.01%
Interest Rate Swap IR26075R 27.07.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-240	0.00%
Interest Rate Swap IR26076R 27.07.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-397	-0.01%
Interest Rate Swap IR26081R 25.08.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-678	-0.01%
Interest Rate Swap IR26085R 25.08.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-242	0.00%
Interest Rate Swap IR280413R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-205	0.00%
Interest Rate Swap IR280416R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-350	-0.01%
Interest Rate Swap IR280420R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	1 331	0.02%
Interest Rate Swap IR28044R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-698	-0.01%
Interest Rate Swap IR28047R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-298	-0.01%
Suma:							0	-4 757	-0.10%

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						728 215		737 249	12.70%
Lokata terminowa 365 dniowa do 2019-07-04	mBank SA	Polska	PLN	2.20 (Stały kupon)	170 000	170 000	173 699	173 699	2.99%
Lokata terminowa 365 dniowa do 2019-08-23	Santander Bank Polska S.A.	Polska	PLN	2.02 (Stały kupon)	200 000	200 000	203 437	203 437	3.50%
Lokata terminowa 273 dniowa do 2019-08-08	BANK BGŻ BNP PARIBAS SA (Emitent)	Polska	PLN	1.90 (Stały kupon)	50 000	50 000	50 608	50 608	0.87%
Lokata terminowa 364 dniowa do 2019-11-08	Santander Bank Polska S.A.	Polska	PLN	2.05 (Stały kupon)	50 000	50 000	50 652	50 652	0.87%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - tabele uzupełniające

Lokata terminowa 186 dniowa do 2019-09-16	Haitong Bank SA Oddział w Polsce	Polska	PLN	2.13 (Stały kupon)	50 000	50 000	50 314	50 314	0.87%
Lokata terminowa 365 dniowa do 2020-05-21	Santander Bank Polska S.A.	Polska	PLN	2.00 (Stały kupon)	150 000	150 000	150 318	150 318	2.59%
Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	USD	1.75 (Stały kupon)	15 494	57 848	15 496	57 854	1.00%
Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	Polska	CZK	0.90 (Stały kupon)	2 195	367	2 195	367	0.01%
W walutach państw nienależących do OECD						0		0	0.00%
Suma:						728 215		737 249	12.70%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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	394 152	6.78%
Grupa Kapitałowa mBank S.A.	12 799	0.22%
Grupa ING	28 950	0.50%
Grupa Banku PKO BP	4 002	0.07%
Grupa PZU S.A.	310 131	5.33%
Suma:	750 034	12.90%

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
BANK MILLENNIUM SA (Emitent) Seria T PLBIG0000446	1 512	0.03%
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent) Seria DC137P020120	15 162	0.26%
ENEA SA PLENEA000088	83 252	1.43%
ENEA SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	13 705	0.24%
Forward Waluta CZK FW907031 17.07.2019	1	0.00%
Forward Waluta USD FW908039 29.08.2019	1 166	0.02%
Forward Waluta USD FW909004 09.09.2019	208	0.00%
Interest Rate Swap CC19073 03.07.2019	12 220	0.21%
Interest Rate Swap CC19073 03.07.2019	-12 075	-0.21%
Interest Rate Swap CC19074 03.07.2019	18 881	0.32%
Interest Rate Swap CC19074 03.07.2019	-18 639	-0.32%
Interest Rate Swap CC19078 03.07.2019	8 630	0.15%
Interest Rate Swap CC19078 03.07.2019	-8 472	-0.15%
Interest Rate Swap IR21078R 26.07.2021	-1 822	-0.03%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie Lokat - Tabele Dodatkowe

Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	-4 917	-0.08%
Lokata O/N 3 dniowa do 2019-07-01	58 221	1.01%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL008 270320	20 004	0.34%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL023 010719	84 995	1.46%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL024 010819	39 926	0.69%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL026 020919	39 852	0.69%
Pekao Lesing Sp. z o.o. Seria PEKAL027 011019	9 946	0.17%
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA Seria PGE002210526 PLPGER000069	20 065	0.35%
PS0721 PL0000109153	50 960	0.88%
SANTANDER CONSUMER BANK SA Seria SCB00034	45 202	0.78%
SANTANDER CONSUMER BANK SA Seria SCB00035	40 104	0.69%
WZ0124 PL0000107454	20 066	0.35%
WZ0524 PL0000110615	49 783	0.86%
Suma:	587 936	10.14%

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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	5 813 336	5 984 912
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	130 899	161 682
2. Należności	1	87 623
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	5 472	0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	2 657 518	2 321 707
- dłużne papiery wartościowe	2 657 518	2 321 707
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	3 019 446	3 413 900
- dłużne papiery wartościowe	2 272 584	2 408 159
6. Nieruchomości	0	0
7. Pozostałe aktywa	0	0
II. Zobowiązania	925 794	1 134 422
III. Aktywa netto (I - II)	4 887 542	4 850 490
IV. Kapitał funduszu	4 601 968	4 599 380
1. Kapitał wpłacony	11 692 249	11 061 845
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-7 090 281	-6 462 465
V. Dochody zatrzymane	275 520	227 494
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	257 272	218 356
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	18 248	9 138
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	10 054	23 616
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+VI)	4 887 542	4 850 490
Liczba zarejestrowanych jednostek uczestnictwa	385 972 398.906	385 762 615.931
Kategoria A	385 972 398.906	385 762 615.931
Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa *	12.66	12.57
Kategoria A	12.66	12.57

**)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 Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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	64 787	100 509	43 662
Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0	0
Przychody odsetkowe	61 929	100 509	43 662
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0
Dodatnie saldo różnic kursowych	2 858	0	0
Pozostałe	0	0	0
II. Koszty funduszu	25 871	38 836	15 370
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	19 354	31 998	13 198
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0
Oplaty dla depozytariusza	208	252	61
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów	0	0	0
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	3	8	6
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	6 270	6 031	1 286
Koszty związane z prowadzeniem nieruchomości	0	0	0
Ujemne saldo różnic kursowych	0	547	819
Pozostałe	36	0	0
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	25 871	38 836	15 370
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	38 916	61 673	28 292
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	-4 452	16 646	12 099
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	9 110	8 426	18 177
- z tytułu różnic kursowych	14 129	4 903	0
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-13 562	8 220	-6 078
- z tytułu różnic kursowych	-17 765	19 492	24 498
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	34 464	78 319	40 391
Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa *	0.09	0.22	0.12
Kategoria A	0.09	0.22	0.12

) 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 Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

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	4 850 490		3 777 874	
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy	34 464		78 319	
a) przychody z lokat netto	38 916		61 673	
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	9 110		8 426	
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-13 562		8 220	
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	34 464		78 319	
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)	2 588		994 297	
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału)	630 404		2 121 359	
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału)	-627 816		-1 127 062	
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym (3-4+5)	37 052		1 072 616	
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	4 887 542		4 850 490	
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	4 878 816		4 396 160	
II. Zmiana liczby jednostek uczestnictwa				
Zmiana liczby jednostek w okresie sprawozdawczym w rozbiciu na kategorie				
Kategoria A				
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	50 005 028.178		170 227 832.862	
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	49 795 245.209		90 387 757.501	
Saldo zmian	209 782.975		79 840 075.358	
Zmiana liczby jednostek od początku działalności funduszu w rozbiciu na kategorie				
Kategoria A				
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	977 682 844.940		927 677 816.762	
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	591 710 446.040		541 915 200.831	
Saldo zmian	385 972 398.906		385 762 615.931	
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	385 972 398.906		385 762 615.931	
III. Zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa				
1. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A	12.57		12.35	
2. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A	12.66		12.57	
3. Procentowa zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	1.44%		1.78%	
4. Minimalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	12.56	03.01.2019	12.35	03.01.2018
5. Maksymalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	12.66	21.06.2019	12.57	20.12.2018
6. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa wg ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	12.66	28.06.2019	12.57	28.12.2018
Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:	1.07%		0.88%	
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	0.80%		0.73%	
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	-		-	
Opłaty dla depozytariusza	0.01%		0.01%	

Pekao Spokojna Inwestycja (subfundusz w Pekao Funduszy Globalnych SFIO)

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2019

Zestawienie zmian

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

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	5
Nota - 4	Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	6
Nota - 5	Ryzyka	6
Nota - 6	Instrumenty pochodne	8
Nota - 7	Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu ...	12
Nota - 8	Kredyty i pożyczki	13
Nota - 9	Waluty i różnice kursowe	14
Nota - 10	Dochody i ich dystrybucja	16
Nota - 11	Koszty Subfunduszu	17
Nota - 12	Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa	18

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 wiarygodności (w tym zapadłych nierozliczonych) dokonywana jest z uwzględnieniem osza-

cowania 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 'I.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:

- a) Dla kontraktów *IRS* (w tym dwuwalutowych)
 - termin płatności – prezentowana jest najbliższa data płatności
 - wartości przyszłych przepływów pieniężnych – zsumowane są wartości takich przyszłych przepływów, według ich aktualnego ich oszacowania
 - w przypadku, gdy kontrakt wymaga przepływów w dwóch różnych walutach – dla czytelności prezentacji ujawniane są osobno płatności w każdej walucie
- b) Dla kontaktów *future*
 - jako wartość instrumentu wykazywana jest wartość ustalona na podstawie kursu zamknięcia z rynku notowań kontaktu.

Prezentacja depozytów obejmuje wartości z uwzględnieniem odsetek naliczonych (bez dodatkowych ujawnień w należnościach).

Jednostkowe sprawozdanie półroczne stanowi składnik połączonego sprawozdania półrocznego, które w całości: podlega przeglądowi przez biegłego rewidenta, jest ogłaszane na stronie <http://www.pekaofti.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 nominaliem) 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 wierzyielskie, 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”)
Serwisy: '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 wyliczania wartości aktywów wyrażonych w walucie.
- 5) W uzasadnionych przypadkach, gdy na skutek zdarzeń dotyczących emitentów bądź samych posiadanych wierzytelności 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
- 6) W uzasadnionych przypadkach, gdy na skutek zdarzeń dotyczących emitentów bądź samych posiadanych wierzytelności papierów wartościowych (a instrumenty nie są przedmiotem obrotu na rynku aktywnym), po analizie przypadku może być dokonany stosowny odpis z tytułu trwałej utraty wartości składnika lokat do wysokości szacowanej wartości odzyskiwalnej. Odpisu dokonuje się 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. Oszacowanie wartości odpisu z tytułu trwałej utraty wartości składnika lokat dokonywane jest w oparciu o dostępne informacje o emitencie, ocenę jego sytuacji finansowej i płynności, a w szczególności możliwości spłaty zobowiązań z uwzględnieniem jakości posiadanych zabezpieczeń wierzytelności i terminów ich realizacji / zbycia.

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;
- wartość aktywów netto na Jednostkę Uczestnictwa.

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	1	87 623
Z tytułu zbytych lokat	0	87 601
Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
Z tytułu zbytych jednostek uczestnictw a albo w wydanych certyfikatów inw estycyjnych	0	0
Z tytułu dywidend	0	0
Z tytułu odsetek	1	2
Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0	0
Z tytułu udzielonych pożyczek w podziale na podmioty udzielające pożyczek	0	0
Pozostałe	0	20
Należności z tytułu świadczenia dodatkowego	0	0

Nota - 3 **Zobowiązania Subfunduszu**

Wartości w tys. zł

NOTA-3 ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	30.06.2019	31.12.2018
Zobowiązania	925 794	1 134 422
Z tytułu nabytych aktywów	119 372	907 367
Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	770 910	191 885
Z tytułu instrumentów pochodnych	14 370	8 026
Z tytułu wpłat na jednostki uczestnictw a albo certyfikaty inw estycyjne	5 477	20 617
Z tytułu odkupionych jednostek uczestnictw a albo w wykupionych certyfikatów inw estycyjnych	6 977	2 053
Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0	0
Z tytułu wypłaty przychodów funduszu	0	0
Z tytułu wemitowanych obligacji	0	0
Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów	0	0
Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów	0	0
Z tytułu gwarancji lub poręczeń	0	0
Z tytułu rezerw	0	0
Pozostałe składniki zobowiązań	8 688	4 474
w tym:		
Zobowiązania z tytułu depozytów zabezpieczających	4 780	622
Zobowiązania z tytułu podatku	491	397
Zobowiązania z tytułu wynagrodzenia za zarządzanie	3 206	3 256

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 waluty		130 899		161 682
J.P. MORGAN SECURITIES PLC		1 106		258
EUR	260	1 106	60	258
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL		4 337		946
EUR	1 020	4 337	220	946
Santander Bank Polska S.A.		0		0
PLN	0	0	0	0
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		0		10
PLN	0	0	10	10
ING BANK ŚLĄSKI SA		1 110		0
PLN	1 110	1 110	0	0
BANK POLSKA KASA OPIEKI SA		2 260		2 680
PLN	2 260	2 260	2 680	2 680
BNP Paribas		3 699		1 677
EUR	870	3 699	390	1 677
DM mBanku S.A.		521		527
EUR	123	521	123	527
Bank Polska Kasa Opieki S.A.		116 675		151 284
CZK	0	0	873	146
EUR	26 115	111 042	29 588	127 230
HUF	0	0	0	0
PLN	5 609	5 609	23 907	23 907
USD	7	24	0	1
SOCIETE GENERALE PARIS		1 191		4 300
EUR	280	1 191	1 000	4 300

*) Dla rozróżnienia przeznaczenia przechowywania środków w banku depozytariuszu: (a) "Bank Polska Kasa Opieki S.A." - środki pieniężne na rachunkach bieżących. (b) "BANK POLSKA KASA OPIEKI SA" - depozyty zabezpieczające wykonania kontraktów pochodnych otrzymane oraz depozyty zabezpieczające.

W przypadku dokonywania inwestycji w instrumenty pochodne – zgodnie z opisem w Nocie 6 'Instrumenty pochodne', jeżeli z instrumentem pochodnym związane jest złożenie depozytu zabezpieczającego: wartość złożonego depozytu zabezpieczającego jest zawarta w kwotach przedstawianych w tabeli w niniejszej nodcie. Wartość depozytu zabezpieczającego jest ujawniana przy prezentacji instrumentów pochodnych w Nocie 6 'Instrumenty pochodne'.

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	220	37	596	99
EUR	16 106	69 040	8 633	37 113
HUF	190 803	2 553	155 222	2 078
PLN	7 623	7 623	12 940	12 940
USD	79	303	602	2 071

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 nodcie 9]		
waluty	121 920 tys. zł	2.1%
	58 221 tys. zł	1.0%
dłużne papiery wartościowe	686 188 tys. zł	11.8%
należności – w walutach	0 tys. zł	0.0%
zobowiązania w walutach	766 604 tys. zł	---
wartość niezabezpieczona (w podziale na waluty)	381 tys. EUR	0.02%
	-223 tys. USD	
	3 148 tys. CZK	
	-31 128 tys.. HUF	
b) ryzyko kredytowe		
obligacje Skarbu Państwa	2 399 340 tys. zł	41.3%
korporacyjne papiery wartościowe	2 166 451 tys. zł	37.3%
obligacje skarbowe zagraniczne	156 897 tys. zł	2.7%
depozyty bankowe	737 249 tys. zł	12.7%

Klasa ryzyka	Poziom obciążenia ryzykiem	Udział w aktywach Subfunduszu
c) ryzyko przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej		
obligacje o zmiennej stopie procentowej	2 482 986 tys. zł	42.7%
d) ryzyko wartości godziwej wynikające ze stopy procentowej		
instrumenty o stałej stopie procentowej (lub zerowej)	2 447 116 tys. zł	42.1%
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)	2 243 334 tys. zł	38.6%

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).
 - 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 zmniejszania ryzyka wykonania zobowiązań kontrahenta).
 - Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka kredytowego w poszczególnych kategoriach lokat
 - Skarb Państwa 41.3% Aktywów Subfunduszu,
- 3) 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.

Ryzyko to dotyczy także sytuacji, w której z powodu zobowiązań (np. wobec uczestników składających zlecenia odkupienia jednostek uczestnictwa) pojawi się konieczność sprzedaży aktywów o niskiej płynności. Ograniczona płynność niektórych z posiadanych instrumentów finansowych może uniemożliwić w takim przypadku uzyskanie cen stosowanych do wyceny składników. Dotyczy to w szczególności: dłużnych papierów wartościowych nienotowanych na aktywnym rynku.
- 4) Poziom obciążenia innymi typowymi klasami ryzyka
 - Wszystkie lokaty Subfunduszu denominowane są w złotych - nie ma więc ryzyka walutowego.
 - 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 przejścia 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.
- 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.

6) 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:

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

Kontrakty FX FWD, IRS

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 FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych

strona 1 Tabela N-6		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 instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta		
1.	Forward Waluta CZK FW907031 17.07.2019 (0)	-	Forward	IRH	1	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	1 027 388	CZK	6 150 000	CZK	17.07.2019	1 027 388	CZK	6 150 000	17.07.2019	17.07.2019
2.	Forward Waluta EUR FW907001 05.07.2019 (0)	-	Forward	IRH	233	SOCIETE GENERALE PARIS	2 173 000	EUR	9 474 430	PLN	05.07.2019	2 173 000	EUR	9 474 430	05.07.2019	05.07.2019
3.	Forward Waluta USD FW907115 12.07.2019 (0)	-	Forward	IRH	289	POWISZCZONA KASA Oszczędności BANK POLSKI SA	4 306 000	USD	16 361 293	PLN	12.07.2019	4 306 000	USD	16 361 293	12.07.2019	12.07.2019
4.	Forward Waluta USD FW908039 29.08.2019 (0)	-	Forward	IRH	1 166	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	9 798 000	USD	37 700 842	PLN	29.08.2019	9 798 000	USD	37 700 842	29.08.2019	29.08.2019
5.	Forward Waluta USD FW908042 29.08.2019 (0)	-	Forward	IRH	603	Santander Bank Polska S.A.	5 400 000	USD	20 738 052	PLN	29.08.2019	5 400 000	USD	20 738 052	29.08.2019	29.08.2019
6.	Forward Waluta USD FW909004 09.09.2019 (0)	-	Forward	IRH	208	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA	3 231 000	USD	12 252 727	PLN	09.09.2019	3 231 000	USD	12 252 727	09.09.2019	09.09.2019
7.	Forward Waluta USD FW909008 09.09.2019 (0)	-	Forward	IRH	767	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	10 798 000	USD	41 021 602	PLN	09.09.2019	10 798 000	USD	41 021 602	09.09.2019	09.09.2019
8.	Forward Waluta USD FW910001 24.10.2019 (0)	-	CIRS	IRH	558	Santander Bank Polska S.A.	4 729 000	USD	18 175 864	PLN	24.10.2019	4 729 000	USD	18 175 864	24.10.2019	24.10.2019
9.	Interest Rate Sw ap CC21021 23.02.2021 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-94 934	BNP PARIBAS	586 753 375	CZK	23 022 021	CZK	23.02.2021	580 000 000	CZK	23 022 021	23.02.2021	23.02.2021
10.	Interest Rate Sw ap CC19073 03.07.2019 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-12 075	BNP PARIBAS	2 839 740	EUR	03.07.2019	EUR	03.07.2019	2 850 000	EUR	03.07.2019	03.07.2019	03.07.2019
11.	Interest Rate Sw ap CC19074 03.07.2019 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-18 639	SOCIETE GENERALE PARIS	4 383 610	EUR	03.07.2019	EUR	03.07.2019	4 400 000	EUR	03.07.2019	03.07.2019	03.07.2019
12.	Interest Rate Sw ap CC19078 03.07.2019 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-8 472	SOCIETE GENERALE PARIS	1 992 400	EUR	03.07.2019	EUR	03.07.2019	2 000 000	EUR	03.07.2019	03.07.2019	03.07.2019
13.	Interest Rate Sw ap CC19101 15.10.2019 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-17 391	SOCIETE GENERALE PARIS	4 086 060	EUR	15.10.2019	EUR	15.10.2019	4 100 000	EUR	15.10.2019	15.10.2019	15.10.2019
14.	Interest Rate Sw ap CC20041 15.04.2020 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-58 191	SOCIETE GENERALE PARIS	13 660 955	EUR	15.04.2020	EUR	15.04.2020	13 700 000	EUR	15.04.2020	15.04.2020	15.04.2020
15.	Interest Rate Sw ap CC24011 15.01.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-39 788	BNP PARIBAS	9 248 363	EUR	15.01.2024	EUR	15.01.2024	9 150 000	EUR	15.01.2024	15.01.2024	15.01.2024
16.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-9 244	SOCIETE GENERALE PARIS	2 149 129	EUR	09.07.2024	EUR	09.07.2024	2 120 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024	09.07.2024
17.	Interest Rate Sw ap CC20031 19.03.2020 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-13 451	SOCIETE GENERALE PARIS	3 158 691	EUR	19.03.2020	EUR	19.03.2020	3 155 000	EUR	19.03.2020	19.03.2020	19.03.2020
18.	Interest Rate Sw ap CC21096 20.09.2021 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-17 066	SOCIETE GENERALE PARIS	3 993 418	EUR	20.09.2021	EUR	20.09.2021	4 000 000	EUR	20.09.2021	20.09.2021	20.09.2021
19.	Interest Rate Sw ap CC24075 09.07.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-15 524	SOCIETE GENERALE PARIS	3 609 199	EUR	09.07.2024	EUR	09.07.2024	3 585 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024	09.07.2024
20.	Interest Rate Sw ap CC25014 20.01.2025 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-11 380	SOCIETE GENERALE PARIS	2 649 069	EUR	20.01.2025	EUR	20.01.2025	2 620 000	EUR	20.01.2025	20.01.2025	20.01.2025
21.	Interest Rate Sw ap CC25093 09.09.2025 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-13 871	The Goldman Sachs Group Inc.	3 234 738	EUR	09.09.2025	EUR	09.09.2025	3 175 000	EUR	09.09.2025	09.09.2025	09.09.2025
22.	Interest Rate Sw ap CC21116 26.11.2021 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-4 436	JP Morgan Chase & Co	1 037 338	EUR	26.11.2021	EUR	26.11.2021	1 039 000	EUR	26.11.2021	26.11.2021	26.11.2021
23.	Interest Rate Sw ap CC220915 05.09.2022 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-12 869	BNP PARIBAS	2 998 205	EUR	05.09.2022	EUR	05.09.2022	3 000 000	EUR	05.09.2022	05.09.2022	05.09.2022
24.	Interest Rate Sw ap CC24079 09.07.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-5 020	The Goldman Sachs Group Inc.	1 167 206	EUR	09.07.2024	EUR	09.07.2024	1 160 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024	09.07.2024
25.	Interest Rate Sw ap CC25018 20.01.2025 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-5 730	BNP PARIBAS	1 333 854	EUR	20.01.2025	EUR	20.01.2025	1 320 000	EUR	20.01.2025	20.01.2025	20.01.2025
26.	Interest Rate Sw ap CC21111 26.11.2021 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-4 263	SOCIETE GENERALE PARIS	997 625	EUR	26.11.2021	EUR	26.11.2021	1 000 000	EUR	26.11.2021	26.11.2021	26.11.2021
27.	Interest Rate Sw ap CC24074 09.07.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-5 063	SOCIETE GENERALE PARIS	1 177 091	EUR	09.07.2024	EUR	09.07.2024	1 175 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024	09.07.2024
28.	Interest Rate Sw ap CC20093 28.09.2020 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-5 516	SOCIETE GENERALE PARIS	1 294 863	EUR	28.09.2020	EUR	28.09.2020	1 300 000	EUR	28.09.2020	28.09.2020	28.09.2020
29.	Interest Rate Sw ap CC240126 15.01.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-14 388	BNP PARIBAS	3 356 817	EUR	15.01.2024	EUR	15.01.2024	3 360 000	EUR	15.01.2024	15.01.2024	15.01.2024
30.	Interest Rate Sw ap CC240716 09.07.2024 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-9 981	SOCIETE GENERALE PARIS	2 328 257	EUR	09.07.2024	EUR	09.07.2024	2 330 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024	09.07.2024
31.	Interest Rate Sw ap CC250113 20.01.2025 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-9 097	BNP PARIBAS	2 118 539	EUR	20.01.2025	EUR	20.01.2025	1 610 000	EUR	20.01.2025	20.01.2025	20.01.2025
32.	Interest Rate Sw ap CC19073 03.07.2019 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 220	BNP PARIBAS		PLN	12 220 016	PLN	03.07.2019		PLN	12 112 500	PLN	03.07.2019
33.	Interest Rate Sw ap CC19074 03.07.2019 (0)	Długa	CIRS	IRH	18 881	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	18 881 526	PLN	03.07.2019		PLN	18 715 400	PLN	03.07.2019
34.	Interest Rate Sw ap CC19078 03.07.2019 (0)	Długa	CIRS	IRH	8 630	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	8 629 929	PLN	03.07.2019		PLN	8 554 000	PLN	03.07.2019
35.	Interest Rate Sw ap CC19101 15.10.2019 (0)	Długa	CIRS	IRH	17 293	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	17 376 610	PLN	15.10.2019		PLN	17 222 050	PLN	15.10.2019
36.	Interest Rate Sw ap CC20041 15.04.2020 (0)	Długa	CIRS	IRH	57 783	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	58 558 157	PLN	15.04.2020		PLN	57 546 850	PLN	15.04.2020
37.	Interest Rate Sw ap CC21021 23.02.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	97 048	BNP PARIBAS		PLN	99 771 822	PLN	23.02.2021		PLN	96 425 603	PLN	23.02.2021
38.	Interest Rate Sw ap CC24011 15.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	38 888	BNP PARIBAS		PLN	42 089 373	PLN	15.01.2024		PLN	38 567 250	PLN	15.01.2024
39.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	9 198	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	10 047 654	PLN	09.07.2024		PLN	9 120 240	PLN	09.07.2024
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'			IRH	Ograniczenie ryzyka w alutach jego portfela papierów wartościowych denominowanych w alutach obcych (Rf)												

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

strona 1 Tabela N-6		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 waluta do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w waluta do otrzymania	Termin zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta					
40.	Interest Rate Swap CC20031 19.03.2020 (0)	Długa	Forw ard	IRH	13 614	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	13 779 165		19.03.2020		PLN	13 481 315	PLN	19.03.2020	19.03.2020
41.	Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021 (0)	Długa	Forw ard	IRH	17 328	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	17 993 563		20.09.2021		PLN	17 236 000	PLN	20.09.2021	20.09.2021
42.	Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024 (0)	Długa	Forw ard	IRH	15 882	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	17 348 396		09.07.2024		PLN	15 747 113	PLN	09.07.2024	09.07.2024
43.	Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025 (0)	Długa	Forw ard	IRH	11 587	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	12 791 701		20.01.2025		PLN	11 493 940	PLN	20.01.2025	20.01.2025
44.	Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025 (0)	Długa	Forw ard	IRH	13 604	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	15 213 067		09.09.2025		PLN	13 525 500	PLN	09.09.2025	09.09.2025
45.	Interest Rate Swap CC21116 26.11.2021 (0)	Długa	Forw ard	IRH	4 466	JP Mrgan Chase & Co		PLN	4 652 094		26.11.2021		PLN	4 456 271	PLN	26.11.2021	26.11.2021
46.	Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022 (0)	Długa	Forw ard	IRH	12 888	BNP PARIBAS		PLN	13 603 825		05.09.2022		PLN	12 870 000	PLN	05.09.2022	05.09.2022
47.	Interest Rate Swap CC24079 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 017	The Goldman Sachs Group Inc.		PLN	5 479 793		09.07.2024		PLN	4 974 000	PLN	09.07.2024	09.07.2024
48.	Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 760	BNP PARIBAS		PLN	6 359 469		20.01.2025		PLN	5 714 280	PLN	20.01.2025	20.01.2025
49.	Interest Rate Swap CC21111 26.11.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	4 295	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	4 473 819		26.11.2021		PLN	4 285 500	PLN	26.11.2021	26.11.2021
50.	Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 092	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	5 562 392		09.07.2024		PLN	5 048 975	PLN	09.07.2024	09.07.2024
51.	Interest Rate Swap CC20093 28.09.2020 (0)	Długa	CIRS	IRH	5 591	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	5 709 077		28.09.2020		PLN	5 588 700	PLN	28.09.2020	28.09.2020
52.	Interest Rate Swap CC240126 15.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	14 488	BNP PARIBAS		PLN	15 681 286		15.01.2024		PLN	14 380 800	PLN	15.01.2024	15.01.2024
53.	Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	10 097	SOCIETE GENERALE PARIS		PLN	11 028 822		09.07.2024		PLN	10 010 845	PLN	09.07.2024	09.07.2024
54.	Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	9 080	BNP PARIBAS		PLN	9 911 937		20.01.2025		PLN	6 909 315	PLN	20.01.2025	20.01.2025
55.	Interest Rate Swap C1210419R 19.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	29	SOCIETE GENERALE PARIS	20 684 658	HUF	2 643 333	HUF	19.04.2021	2 000 000 000	HUF	2 000 000 000	HUF	19.04.2021	19.04.2021
56.	Interest Rate Swap C1210419R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-357	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	42 879 164	HUF	1 830 111	HUF	21.04.2021	1 300 000 000	HUF	1 300 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
57.	Interest Rate Swap C1210420R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-310	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	35 373 288	HUF	1 328 889	HUF	21.04.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
58.	Interest Rate Swap C121053R 14.05.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-15	BNP PARIBAS	12 817 534	HUF	1 277 778	HUF	14.05.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	14.05.2021	14.05.2021
59.	Interest Rate Swap C121054R 17.05.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-11	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	12 551 370	HUF	1 277 778	HUF	17.05.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	17.05.2021	17.05.2021
60.	Interest Rate Swap C1210433R 19.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	89	BNP PARIBAS	2 017 778	HUF	29 013 699	HUF	19.04.2021	2 000 000 000	HUF	2 000 000 000	HUF	19.04.2021	19.04.2021
61.	Interest Rate Swap C1210437R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	34	BNP PARIBAS	941 111	HUF	13 655 342	HUF	21.04.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
62.	Interest Rate Swap C1210440R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	139	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	3 374 235	HUF	47 465 753	HUF	21.04.2021	3 300 000 000	HUF	3 300 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
63.	Interest Rate Swap IR230111R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-199	SOCIETE GENERALE PARIS	3 024 126	PLN	2 807 058	PLN	25.01.2023	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
64.	Interest Rate Swap IR230111R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-184	SOCIETE GENERALE PARIS	2 949 879	PLN	2 749 037	PLN	25.01.2023	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
65.	Interest Rate Swap IR23012R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-383	Santander Bank Polska (Emitent)	5 002 542	PLN	4 587 822	PLN	25.01.2023	65 000 000	PLN	65 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
66.	Interest Rate Swap IR23013R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-348	ING BANK ŚLĄSKI SA	5 313 357	PLN	4 933 866	PLN	25.01.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
67.	Interest Rate Swap IR23018R 25.01.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-86	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1 502 301	PLN	1 407 875	PLN	25.01.2023	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
68.	Interest Rate Swap IR240415R 25.04.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-120	The Goldman Sachs Group Inc.	1 980 744	PLN	1 848 772	PLN	25.04.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
69.	Interest Rate Swap IR24045R 25.04.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-169	The Goldman Sachs Group Inc.	3 422 886	PLN	3 235 352	PLN	25.04.2024	35 000 000	PLN	35 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
70.	Interest Rate Swap IR24047R 25.04.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-341	The Goldman Sachs Group Inc.	5 921 224	PLN	5 546 317	PLN	25.04.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
71.	Interest Rate Swap IR250712R 25.07.2025 (0)	-	CIRS	IRH	-333	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	3 438 637	PLN	3 080 847	PLN	25.07.2025	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
72.	Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025 (0)	-	CIRS	IRH	-492	BANK POLSKA KASA OPEKI SA (Emitent)	5 218 639	PLN	4 690 330	PLN	25.07.2025	38 000 000	PLN	38 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
73.	Interest Rate Swap IR26075R 27.07.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-240	Santander Bank Polska (Emitent)	2 454 300	PLN	2 195 846	PLN	27.07.2026	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	27.07.2026	27.07.2026
74.	Interest Rate Swap IR26076R 27.07.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-397	The Goldman Sachs Group Inc.	3 351 160	PLN	2 924 923	PLN	27.07.2026	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	27.07.2026	27.07.2026
75.	Interest Rate Swap IR26081R 25.08.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-678	BNP PARIBAS	4 702 172	PLN	3 979 261	PLN	25.08.2026	27 000 000	PLN	27 000 000	PLN	25.08.2026	25.08.2026
76.	Interest Rate Swap IR26085R 25.08.2026 (0)	-	CIRS	IRH	-242	ING BANK ŚLĄSKI SA	1 732 041	PLN	1 473 800	PLN	25.08.2026	10 000 000	PLN	10 000 000	PLN	25.08.2026	25.08.2026
77.	Interest Rate Swap IR280413R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-205	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	3 715 495	PLN	3 495 632	PLN	25.04.2028	18 933 333	PLN	18 933 333	PLN	25.04.2028	25.04.2028
78.	Interest Rate Swap IR280416R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-350	BNP PARIBAS	5 914 234	PLN	5 538 853	PLN	25.04.2028	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
79.	Interest Rate Swap IR28044R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-698	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	6 295 014	PLN	5 538 853	PLN	25.04.2028	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
80.	Interest Rate Swap IR28047R 25.04.2028 (0)	-	CIRS	IRH	-298	mBank SA (Emitent)	3 092 145	PLN	2 769 427	PLN	25.04.2028	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
81.	Interest Rate Swap IR21075R 26.07.2021 (0)	-	CIRS	IRH	15	OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent)	3 705 137	PLN	3 705 718	PLN	26.07.2021	100 000 000	PLN	100 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
82.	Interest Rate Swap IR21078R 26.07.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-18	BANK POLSKA KASA OPEKI SA (Emitent)	1 868 733	PLN	1 842 559	PLN	26.07.2021	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
83.	Interest Rate Swap IR220413R 25.04.2022 (0)	-	CIRS	IRH	17	SOCIETE GENERALE PARIS	2 487 953	PLN	2 495 280	PLN	25.04.2022	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.04.2022	25.04.2022
84.	Interest Rate Swap IR22046R 25.04.2022 (0)	-	CIRS	IRH	7	Santander Bank Polska (Emitent)	3 025 562	PLN	3 020 752	PLN	25.04.2022	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.04.2022	25.04.2022
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'		IRH	Ograniczenie ryzyka w autow ego portfela papierów w artościowych denominowanych w walutach ob-cych (IRH)														

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

strona 2 Tabela N-6		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		kwota	waluta	kwota	waluta			
85.	Interest Rate Sw ap IR22048R 25.04.2022 (0)	-	Forward	IRH	-9	BNP PARIBAS	2 535 031	PLN	2 514 841	PLN	25.04.2022	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.04.2022	25.04.2022
86.	Interest Rate Sw ap IR2209110R 23.09.2022 (0)	-	Forward	IRH	29	The Goldman Sachs Group Inc.	2 839 089	PLN	2 858 144	PLN	23.09.2022	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	23.09.2022	23.09.2022
87.	Interest Rate Sw ap IR2310117R 25.01.2023 (0)	-	Forward	IRH	-97	SOCIETE GENERALE PARIS	1 797 820	PLN	1 690 519	PLN	25.01.2023	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
88.	Interest Rate Sw ap IR280420R 25.04.2028 (0)	-	Forward	IRH	1 331	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	8 275 177	PLN	9 722 002	PLN	25.04.2028	45 000 000	PLN	45 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
89.	Forward Rate Agreement FR210101 25.01.2021 (0)	-	Forward	IRH	18	BNP PARIBAS		PLN	18 820	PLN	25.01.2021	150 000 000	PLN	150 000 000	PLN	25.01.2021	25.01.2021
90.	Interest Rate Sw ap CI23043R 20.04.2023 (0)	-	Forward	IRH	-1 408	BNP PARIBAS	1 068 192	USD	61 548	USD	20.04.2023	9 500 000	USD	9 500 000	USD	20.04.2023	20.04.2023
91.	Interest Rate Sw ap CI23047R 24.04.2023 (0)	-	Forward	IRH	-723	BNP PARIBAS	522 054	USD	29 360	USD	24.04.2023	4 500 000	USD	4 500 000	USD	24.04.2023	24.04.2023
92.	Interest Rate Sw ap CI23033R 17.03.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-414	The Goldman Sachs Group Inc.	265 971	USD	14 167	USD	17.03.2023	2 300 000	USD	2 300 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
93.	Interest Rate Sw ap CI23039R 17.03.2023 (0)	-	CIRS	IRH	-364	SOCIETE GENERALE PARIS	232 239	USD	12 319	USD	17.03.2023	2 000 000	USD	2 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
94.	Interest Rate Sw ap CI22031R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-458	SOCIETE GENERALE PARIS	271 476	USD	17 769	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
95.	Interest Rate Sw ap CI220311R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-851	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	524 806	USD	35 537	USD	23.03.2022	6 000 000	USD	6 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
96.	Interest Rate Sw ap CI210426R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-51	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	55 917	USD	7 127	USD	21.04.2021	1 100 000	USD	1 100 000	USD	21.04.2021	21.04.2021
97.	Interest Rate Sw ap CI220317R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-470	BNP PARIBAS	420 030	USD	35 537	USD	23.03.2022	6 000 000	USD	6 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
98.	Interest Rate Sw ap CI220318R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-143	SOCIETE GENERALE PARIS	136 353	USD	11 846	USD	23.03.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
99.	Interest Rate Sw ap CI240118R 22.01.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-156	The Goldman Sachs Group Inc.	128 550	USD	6 479	USD	22.01.2024	1 000 000	USD	1 000 000	USD	22.01.2024	22.01.2024
100.	Interest Rate Sw ap CI220322R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-189	The Goldman Sachs Group Inc.	197 437	USD	17 769	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
101.	Interest Rate Sw ap CI210317R 29.03.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-97	The Goldman Sachs Group Inc.	350 993	USD	60 836	USD	29.03.2021	10 000 000	USD	10 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
102.	Interest Rate Sw ap CI210318R 29.03.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-34	SOCIETE GENERALE PARIS	171 354	USD	30 418	USD	29.03.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
103.	Interest Rate Sw ap CI210442R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-97	SOCIETE GENERALE PARIS	178 138	USD	15 632	USD	21.04.2021	4 300 000	USD	4 300 000	USD	21.04.2021	21.04.2021
104.	Interest Rate Sw ap CI210444R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-112	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	206 948	USD	18 177	USD	21.04.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	21.04.2021	21.04.2021
105.	Interest Rate Sw ap CI210445R 21.04.2021 (0)	-	CIRS	IRH	-104	The Goldman Sachs Group Inc.	203 306	USD	16 763	USD	21.04.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	21.04.2021	21.04.2021
106.	Interest Rate Sw ap CI220328R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-153	The Goldman Sachs Group Inc.	284 836	USD	29 615	USD	23.03.2022	5 000 000	USD	5 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
107.	Interest Rate Sw ap CI220331R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-107	The Goldman Sachs Group Inc.	175 067	USD	17 769	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
108.	Interest Rate Sw ap CI220336R 23.03.2022 (0)	-	CIRS	IRH	-57	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	209 776	USD	23 692	USD	23.03.2022	4 000 000	USD	4 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
109.	Interest Rate Sw ap CI220926R 26.09.2022 (0)	-	CIRS	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
110.	Interest Rate Sw ap CI240131R 22.01.2024 (0)	-	CIRS	IRH	-51	The Goldman Sachs Group Inc.	259 438	USD	9 348	USD	22.01.2024	3 000 000	USD	3 000 000	USD	22.01.2024	22.01.2024
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'			IRH	Ograniczenie ryzyka w alutowego portfela papierów w wartościach denominowanych w walutach obcych (FR)													

Nota - 7Transakcje 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'.

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

		30.06.2019	31.12.2018
a.	Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na subfundusz praw własności i ryzyka	Nie miał zawartych	Nie miał zawartych
b.	Transakcje, w wyniku których nie następuje przeniesienie na subfundusz praw własności i ryzyka	Nie miał zawartych	Nie miał zawartych
c.	Transakcje, w wyniku których następuje przeniesienie na subfundusz praw własności i nie następuje przeniesienie na subfundusz ryzyka	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	5 472	PLN	1	0.09%	PS0123	PL0000110151	5 298	5 472
1.						0.09%				5 472

2) 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	4 kontrakty: <ul style="list-style-type: none"> • 1 z Société Generale (Oddz. w Polsce) • 2 z Ipopema Securities SA • 1 z mBank SA Kwota transakcji: <ul style="list-style-type: none"> • na 139 018 tys. zł • na 29 745 tys. zł • na 23 122 tys. zł Czas do zapadalności (względem daty bilansowej): poniżej 1 tygodnia. Zobowiązanie ogółem z tego tytułu stanowi 3.2% Aktywów. Kontrakty dotyczyły (<i>nominalnie</i>): <ul style="list-style-type: none"> • obligacji Skarbu Państwa: <ul style="list-style-type: none"> WZ0126 (140 mln zł) WZ0121 (29 mln zł) WZ1122 (23 mln zł)

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Finansowe Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2019 roku

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.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	50 725	PLN	1	0.87%	PS0422	PL0000109492	49 748	50 729
2.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	15 182	USD	2	0.98%	PL210401	US857524AA08	14 300	56 701
3.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	21 296	USD	Bez terminu	1.38%	PL220301	US857524AB80	20 000	79 944
4.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	13 067	USD	Bez terminu	0.84%	PL220301	US857524AB80	12 000	48 800
5.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	16 144	USD	Bez terminu	1.04%	PL230301	US731011AT95	16 000	60 604
6.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	1 999	USD	Bez terminu	0.13%	PL230301	US731011AT95	1 928	7 467
7.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	7 557	EUR	4	0.55%	PL240101	XS1015428821	6 600	32 106
8.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	3 945	EUR	4	0.29%	PL240701	XS0841073793	3 350	16 748
9.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	126 404	PLN	5	2.17%	WZ0124	PL0000107454	126 000	126 419
10.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	124 051	PLN	5	2.13%	WZ0126	PL0000108817	125 000	124 066
11.	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Deponent)	SBB	105 539	PLN	5	1.82%	WZ0524	PL0000110615	106 000	105 551
12.	SOCIETE GENERALE SA ODDZIAŁ W POLSCE	SBB	30 728	PLN	3	0.53%	DS0725	PL0000108197	28 000	30 733
13.	SOCIETE GENERALE SA ODDZIAŁ W POLSCE	SBB	31 036	PLN	2	0.53%	PS0123	PL0000110151	30 000	31 042
						13.26%				770 910

3) 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

4) 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) Zestawienie 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		5 813 336		5 984 912
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty		130 899		161 682
CZK	0	0	873	146
EUR	28 668	121 896	31 381	134 938
PLN	8 979	8 979	26 597	26 597
USD	7	24	0	1
2. Należności		1		87 623
EUR	0	0	4 000	17 200
PLN	1	1	70 403	70 403
USD	0	0	5	20
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu		5 472		0
PLN	5 472	5 472	0	0
4. Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku, w tym:		2 657 518		2 321 707
- dłużne papiery w artosciowe		2 657 518		2 321 707
CZK	574 826	96 111	573 922	96 017
EUR	58 135	247 194	96 185	413 594
HUF	0	0	8 007 085	107 247
PLN	1 971 330	1 971 330	1 464 070	1 464 070
USD	91 837	342 883	64 041	240 779
5. Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku, w tym:		3 019 446		3 413 900
CZK	-565 587	-94 566	-565 502	-94 608
EUR	-37 305	-158 620	-34 937	-150 226
HUF	22 065	291	30 283	405
PLN	938 312	938 312	1 258 015	1 258 015
USD	16 457	61 445	-2 086	-7 845
- dłużne papiery w artosciowe		2 272 584		2 408 159
PLN	2 272 584	2 272 584	2 408 159	2 408 159
6. Nieruchomości	0	0	0	0
7. Pozostałe aktywa		0		0
II. Zobowiązania		925 794		1 134 422
EUR	47 382	203 989	36 369	156 383
HUF	52 726	693	79 665	1 067
PLN	461 545	461 545	973 972	973 972
USD	69 523	259 567	798	3 000

Aktywa wyceniane (oraz zobowiązania ustalone) 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	0	0	0	0
Dłużne papiery w wartościowe	14 129	0	0	21 010
Instrumenty pochodne	0	3 245	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 wspólnego 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 FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 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	0	0	0	0	0	0
Dłużne papiery w artosciowe	4 903	22 498	0	0	0	31 245	0	0
Instrumenty pochodne	0	0	0	3 006	0	0	0	6 747
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	12 677	-12 568	24 323	11 040	18 194	18 204
Instrumenty pochodne	0	0	135	0	142	0
Dłużne papiery w artosciowe	12 677	-12 568	24 188	11 040	18 052	18 204
Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku	-3 567	-994	-15 897	-2 820	-17	-24 282
Listy zastawne	85	-34	-6	-122	0	-94
Instrumenty pochodne	-3 426	-2 252	-15 920	-2 499	-78	-23 978
Dłużne papiery w artosciowe	-226	1 292	29	-199	61	-210
Nieruchomości	0	0	0	0	0	0
Pozostałe	0	0	0	0	0	0
Suma:	9 110	-13 562	8 426	8 220	18 177	-6 078

- 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:

Maksymalna stawka (określona w Statucie)	Stawka obowiązująca na dzień bilansowy	Data, od kiedy stawka obowiązuje
1,00 %	0,80 %	23.05.2018

- 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).

	1. półrocze 2019	rok 2018
Subfundusz naliczył wynagrodzenie za zarządzanie w wysokości (tys. zł)	19 354	31 998

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. Obecnie opłaty manipulacyjne nie są pobierane (stawka wynosi 0.0 %).

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 notcie.
- (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 – ujemowane 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;

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

Koszty (i), (iii) zostały zaprezentowane odrębnie (w niniejszej notcie-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	4 887 542 tys. zł	4 850 490 tys. zł	3 777 874 tys. zł	2 743 686 tys. zł
Wartość JU	12.66	12.57	12.35	12.07

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:

- nie dokonywano korekt wycen Jednostek Uczestnictwa;
- Jednostki Uczestnictwa były zbywane i odkupywane bez ograniczeń;
- 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 Spokojna Inwestycja* wydzielony w funduszu *Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty*.

11.01.2019 nazwa subfunduszu została zmieniona: z: **Pekao Gotówkowy**. W niniejszym sprawozdaniu subfundusz jest wykazywany pod nazwą obowiązującą od 11.01.2019.

Data rozpoczęcia zbywania Jednostek Uczestnictwa Subfunduszu: 17 grudnia 2009 roku.

Fundusz zbywa (w każdym z subfunduszy) Jednostki Uczestnictwa jednej kategorii (w rozumieniu art. 158 Ustawy).

Jednostki Uczestnictwa zbywane są (i odkupywane) w Dni Wyceny, to jest w dni gdy odbywa się sesja na Gieldzie 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), dokument 'Informacje dla inwestora AFI', bieżące oraz wcześniejsze sprawozdania finansowe.

Nazwa	Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty - Pekao Spokojna Inwestycja		
Nazwa w j. angielskim	Pekao Liquidity (subfund of: Pekao Global Funds Specialized Open-End Investment Fund)		
Rozpoczęcie wycen	17.12.2009	Wartość początkowa	10,00 zł
Oznaczenia w systemach	ISIN JU PLPPTFI00394	IZFiA PIO046	Nr krajowy (KNF) PLSFIO00075
<i>Podstawowe dane na 30 czerwca 2019</i>			
Wartość aktywów netto	4 887 542 tys. zł	Wartość JU	12.66 zł

Warszawa, dnia 19.08.2019 roku.