



Pekao TFI

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych

**Pekao Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych
Spółka Akcyjna**

02-674 Warszawa, ul. Marynarska 15

przedstawia

ROCZNE SPRAWOZDANIE JEDNOSTKOWE*

PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA

subfunduszu w PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNYM FUNDUSZU
INWESTYCYJNYM OTWARTYM

ZA OKRES ROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 31 GRUDNIA 2020 ROKU

Sprawozdanie jednostkowe
31.12.2020

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

Warszawa, dnia 26.03.2021 roku.

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 2021, poz. 217) przedstawia ROCZNE jednostkowe sprawozdanie 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 31 grudnia 2020 o wartości 4 114 254 tys. zł;
2. bilans subfunduszu na dzień 31 grudnia 2020 wykazujący wartość aktywów netto subfunduszu w kwocie 4 112 888 tys. zł;
3. rachunek wyniku z operacji subfunduszu za okres od 1 stycznia 2020 do 31 grudnia 2020 wykazujący wynik z operacji w kwocie 52 074 tys. zł;
4. 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], ze zm.), Zarząd Pekao Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych zapewnił sporządzenie sprawozdania jednostkowego Subfunduszu za okres roczny (od 1 stycznia 2020) kończący się 31 grudnia 2020, 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, wspomnianego wyżej Rozporządzenia oraz przepisów wykonawczych do *Ustawy* o rachunkowości.

Zarząd Pekao TFI SA:

Jacek Janiuk

Prezes Zarządu

Jacek Babiński

Wiceprezes Zarządu

Osoba, której powierzono prowadzenie ksiąg rachunkowych

Zbigniew Czumaj

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

Pekao Towarzystwo
Funduszy Inwestycyjnych S.A.

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

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

Spis treści

- Zestawienie lokat
- Bilans
- Rachunek wyniku z operacji
- Zestawienie zmian w aktywach netto
- Noty objaśniające
 - Nota - 1 Polityka rachunkowości Funduszu
 - Przepisy prawne regulujące rachunkowość Funduszu i Subfunduszu
 - Zasady ogólne / jednakowe dla wszystkich funduszy zarządzanych przez Pekao TFI SA
 - Zasady ujawniania i prezentacji informacji w sprawozdaniu finansowym
 - Ujmowanie operacji dotyczących Subfunduszu w księgach rachunkowych
 - Wycena aktywów i pasywów Subfunduszu
 - Wartości szacunkowe
 - Ustalanie Wartości Aktywów Netto i wyniku z operacji
 - Wprowadzone w okresie sprawozdawczym zmiany stosowanych zasad rachunkowości, metod wyceny oraz sposobu sporządzania sprawozdania finansowego
 - Nota - 2 Należności Subfunduszu
 - Nota - 3 Zobowiązania Subfunduszu
 - Nota - 4 Środki pieniężne i ich ekwiwalenty
 - Nota - 5 Ryzyka
 - Nota - 6 Instrumenty pochodne
 - Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych
 - Nota - 7 Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu
 - Nota - 8 Kredyty i pożyczki
 - Nota - 9 Waluty i różnice kursowe
 - Nota - 10 Dochody i ich dystrybucja
 - Nota - 11 Koszty Subfunduszu
 - Nota - 12 Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa
- Informacje dodatkowe
 - A Informacje o znaczących zdarzeniach, dotyczących lat ubiegłych, ujętych w sprawozdaniu finansowym
 - B Informacje o znaczących zdarzeniach po dniu bilansowym
 - C Dokonane korekty błędów podstawowych
 - D Inne informacje
- Nazwa Subfunduszu, Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu i ich zbywanie, zarządzający
- Zmiana rozporządzenia dot. szczególnych zasad rachunkowości funduszy
- Wpływ pandemii COVID-19 na Subfundusz
- Metryka Subfunduszu

Zestawienie lokat

Sprawozdanie roczne - za okres roczny kończący się 31.12.2020
Zestawienie Lokat - Tabela Główna

SKŁADNIKI LOKAT	31.12.2020			31.12.2019		
	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	337 339	337 405	7,80%	242 241	242 296	4,44%
Dłużne papiery wartościowe	3 672 315	3 751 756	86,86%	4 712 550	4 739 303	86,50%
Instrumenty pochodne	0	-74 930	-1,67%	0	-6 939	-0,13%
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	100 000	100 023	2,32%	400 000	402 537	7,35%
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:	4 109 654	4 114 254	95,31%	5 354 791	5 377 197	98,16%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

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											337 339	337 405	7.80%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00433)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.04.2022	1.03%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	30 000.	30 000	29 688	0.69%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00458)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	16.10.2023	1.12%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	30 000.	30 000	29 994	0.69%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00025)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.04.2021	0.87%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	84.	41 955	42 058	0.97%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00033)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	18.06.2021	0.80%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	140.	70 038	70 047	1.62%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA (PLBPHHP00176)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	24.09.2021	0.28%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	1 850.	8 381	8 535	0.20%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00132)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	30.09.2024	0.00%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	40.	20 000	20 001	0.46%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00573)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	12.09.2022	0.97%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	100 000.	300.	30 155	30 112	0.70%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00058)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	10.09.2021	2.69%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	104.	52 695	52 776	1.22%
MBANK HIPOTECZNY SA (PLRHNHP00508)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	05.03.2021	1.42%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	4 000.	4 010	4 006	0.09%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA (PLBPHHP00184)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	22.03.2023	1.21%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	10 000.	10 097	10 111	0.23%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA (PLBPHHP00259)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PEKAO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	26.05.2023	0.97%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	35 000.	35 028	35 056	0.81%
PKO BANK HIPOTECZNY SA (PLPKOHP00074)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	25.04.2024	0.71%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	10.	4 980	5 021	0.12%
Suma:											337 339	337 405	7.80%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

DLUŻNE PAPIERY WARTOŚCIOWE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu	Warunki oprocentowania	Wartość nominalna	Liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
O terminie wykupu do 1 roku									1 011 042	1 016 002	23.54%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									1 011 042	1 016 002	23.54%
Aktywny rynek nieregulowany									421 777	426 392	9.88%
ORLEN CAPITAL AB XS1082660744	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	ORLEN CAPITAL AB	Szwecja	30.06.2021	2,50 (Stały kupon)	1 000.	28660	130 768	135 215	3.13%
MFINANCE FRANCE SA XS1143974159	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	MFINANCE FRANCE SA	Francja	26.11.2021	2,00 (Stały kupon)	1 000.	5226	23 885	24 564	0.57%
Ministry of Finance - Republic of Croatia XS0607904264	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Ministry of Finance - Republic of Croatia	Chorwacja	24.03.2021	6,38 (Stały kupon)	1 000.	16010	67 967	62 063	1.44%
Santander Bank Polska (Emitent) XS1849525057	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	20.09.2021	0,75 (Stały kupon)	1 000.	12250	54 549	56 990	1.32%
Polski Skarb Państwa XS0543882095	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Państwa	Polska	23.03.2021	4,00 (Stały kupon)	1 000.	1100	5 050	5 289	0.12%
Polski Skarb Państwa XS1306382364	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Państwa	Polska	14.10.2021	0,88 (Stały kupon)	1 000.	13041	59 995	60 891	1.41%
Polski Skarb Państwa XS1536786939	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Państwa	Polska	20.12.2021	0,50 (Stały kupon)	1 000.	16500	75 028	76 735	1.78%
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent) XS1650147660	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent)	Polska	25.07.2021	0,75 (Stały kupon)	1 000.	1000	4 535	4 645	0.11%
Aktywny rynek regulowany									1 175	1 185	0.03%
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA Seria A PLPKN000158	Aktywny rynek regulowany	Warsaw Stock Exchange	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA	Polska	19.09.2021	1,26 (Zmienny kupon)	100.	11762	1 175	1 185	0.03%
Nienotowane na aktywnym rynku									588 090	588 425	13.63%
MBANK HIPOTECZNY SA Seria BRE [K36]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	28.06.2021	0,81 (Zmienny kupon)	100 000.	400	40 000	40 003	0.93%
ENEA SA Seria EV122015	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	15.06.2021	1,20 (Zmienny kupon)	1 000 000.	97	97 468	97 181	2.25%
Gmina Milicz Seria B19 PLQ276400028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Milicz	Polska	22.11.2021	2,05 (Zmienny kupon)	1 000.	1800	1 804	1 806	0.04%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria 5 PLPKOHP00181	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA BANK	Polska	20.12.2021	0,81 (Zmienny kupon)	100.	2759	272	276	0.01%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) Seria BGK0121S016A PL0000500237	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	25.01.2021	0,52 (Zmienny kupon)	1 000.	15000	15 013	15 037	0.35%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH210120 PLQ219200139	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	20.01.2021	0,00 (Zerowy kupon)	500 000.	200	99 689	99 966	2.31%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH210308 PLQ219200147	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	08.03.2021	0,00 (Zerowy kupon)	500 000.	220	109 635	109 875	2.54%
Masto Poznań_old Seria H	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań_old	Polska	29.12.2021	1,05 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 023	5 017	0.12%
BZ WBK Faktor Sp. z o.o. Seria I PLQ229400042	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BZ WBK Faktor Sp. z o.o.	Polska	19.05.2021	0,40 (Zmienny kupon)	1 000.	40000	40 000	40 005	0.93%
mLeasing Sp z o.o. Seria ML15200221 PLQ243700260	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mLeasing Sp z o.o.	Polska	05.02.2021	0,00 (Zerowy kupon)	100 000.	400	39 944	39 978	0.93%
PKO BANK HIPOTECZNY SA Seria PKOBH210521 PLQ219200188	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO BANK HIPOTECZNY SA	Polska	21.05.2021	0,00 (Zerowy kupon)	500 000.	259	129 237	129 275	2.99%
Santander Leasing S.A. Seria F PLQ243200063	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Leasing S.A.	Polska	22.06.2021	0,46 (Zmienny kupon)	1 000.	10000	10 005	10 006	0.23%
O terminie wykupu powyżej 1 roku									2 661 273	2 735 754	63.32%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									2 661 273	2 735 754	63.32%
Aktywny rynek nieregulowany									1 385 088	1 433 484	33.20%
PKO FINANCE AB XS0783934085	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	PKO FINANCE AB	Szwecja	26.09.2022	4,63 (Stały kupon)	1 000.	17649	72 584	71 469	1.65%
Polski Skarb Państwa XS0794399674	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Państwa	Polska	19.01.2023	3,75 (Stały kupon)	1 000.	12395	61 159	64 120	1.48%
Polski Skarb Państwa US8575244C63	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Państwa	Polska	22.01.2024	4,00 (Stały kupon)	1 000.	95	365	402	0.01%
WZ0124 PL0000107454	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.01.2024	0,28 (Zmienny kupon)	1 000.	599	573	603	0.01%
WZ0126 PL0000108817	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.01.2026	0,28 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	4 865	5 023	0.12%
ORLEN CAPITAL AB XS1429673327	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	ORLEN CAPITAL AB	Szwecja	07.06.2023	2,50 (Stały kupon)	1 000.	4200	19 694	20 485	0.47%
WZ1122 PL0000109377	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.11.2022	0,25 (Zmienny kupon)	1 000.	300	289	301	0.01%
PS0422 PL0000109492	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Państwa	Polska	25.04.2022	2,25 (Stały kupon)	1 000.	100	102	105	0.00%
Ministry of Finance - Czech Republic CZ001004600	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Ministry of Finance - Czech Republic	Czechy	25.10.2023	0,45 (Stały kupon)	10 000.	80000	131 645	140 825	3.26%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

WZ0524 PL0000110615	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.05.2024	0,25 (Zmienny kupon)	1 000.	190846	191 700	191 886	4,44%
Polski Skarb Panstwa XS1015428821	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	15.01.2024	3,00 (Stały kupon)	1 000.	14172	70 402	74 075	1,72%
Polski Skarb Panstwa XS0841073793	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	09.07.2024	3,38 (Stały kupon)	1 000.	16305	81 717	86 505	2,00%
WZ0528 PL0000110383	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.05.2028	0,25 (Zmienny kupon)	1 000.	300	291	299	0,01%
Polski Skarb Panstwa XS0479333311	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	20.01.2025	5,25 (Stały kupon)	1 000.	4210	23 430	24 862	0,58%
mBank SA (Emitent) Seria EMTN XS1876097715	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	mBank SA (Emitent)	Polska	05.09.2022	1,06 (Stały kupon)	1 000.	6000	26 193	27 995	0,65%
Polski Skarb Panstwa XS1288467605	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	09.09.2025	1,50 (Stały kupon)	1 000.	3000	13 334	15 069	0,35%
PS0424 PL0000111191	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.04.2024	2,50 (Stały kupon)	1 000.	73500	78 924	80 271	1,86%
PS1024 PL0000111720	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.10.2024	2,25 (Stały kupon)	1 000.	800	823	862	0,02%
Polski Skarb Panstwa XS0282701514	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	18.01.2022	4,50 (Stały kupon)	1 000.	1000	4 767	5 060	0,12%
WZ0525 PL0000111738	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.05.2025	0,25 (Zmienny kupon)	1 000.	2495	2 433	2 508	0,06%
CEZ A.S. Seria REGS XS0764313614	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	CEZ A.S.	Czechy	03.04.2022	4,25 (Stały kupon)	1 000.	3800	16 124	14 922	0,35%
CEZ A.S. Seria REGS XS0764314695	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	CEZ A.S.	Czechy	03.04.2042	5,63 (Stały kupon)	1 000.	1000	5 174	4 687	0,11%
Ministry of Finance - Czech Republic CZ0001005870	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Ministry of Finance - Czech Republic	Czechy	14.02.2025	1,25 (Stały kupon)	10 000.	70000	117 683	126 783	2,94%
Ministry of Finance - Hungary HU0000404280	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Ministry of Finance - Hungary	Węgry	23.08.2023	1,50 (Stały kupon)	10 000.	1820000	232 444	236 013	5,46%
Magyar Fejlesztési bank Zrt/koruen Mukodo Bank XS2010030752	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Magyar Fejlesztési bank Zrt/koruen Mukodo Bank	Węgry	24.06.2025	1,38 (Stały kupon)	1 000.	2500	11 071	12 095	0,28%
Polski Skarb Panstwa XS2114767457	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	10.02.2025	0,00 (Zerowy kupon)	1 000.	5000	22 328	23 341	0,54%
PS0425 PL0000112728	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Polski Skarb Panstwa	Polska	25.04.2025	0,75 (Stały kupon)	1 000.	1000	1 007	1 018	0,02%
Polski Skarb Panstwa XS2199493169	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Polski Skarb Panstwa	Polska	07.07.2023	0,00 (Zerowy kupon)	1 000.	37000	165 573	172 126	3,99%
Ministry of Finance - Czech Republic CZ0001005037	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	Ministry of Finance - Czech Republic	Czechy	10.02.2027	0,25 (Stały kupon)	10 000.	12000	19 379	20 227	0,47%
MOL Hungarian Oil and Gas Plc. XS2232045463	Aktywny rynek nieregulowany	BGN – Bloomberg Generic Price	MOL Hungarian Oil and Gas Plc.	Węgry	08.10.2027	1,50 (Stały kupon)	1 000.	2000	9 015	9 547	0,22%
Nienotowane na aktywnym rynku									1 276 185	1 302 270	30,12%
JP Morgan Chase & Co Seria E005 XS1569783613	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	16.06.2027	1,20 (Zmienny kupon)	50 000.	600	30 000	30 015	0,69%
GIELDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA Seria C PLGPW0000066	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GIELDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA	Polska	06.10.2022	3,19 (Stały kupon)	100.	130000	13 390	13 402	0,31%
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL Seria E005 XS1610672963	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	08.05.2028	1,25 (Zmienny kupon)	100 000.	450	45 000	45 083	1,04%
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA Seria PGE002210526 PLGGER000069	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	Polska	21.05.2026	1,45 (Zmienny kupon)	1 000.	20000	20 000	20 032	0,46%
ENEA SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	26.06.2024	1,45 (Zmienny kupon)	100 000.	247	24 722	24 723	0,57%
ENEA SA Seria EX122017	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	15.06.2022	1,20 (Zmienny kupon)	1 000 000.	101	101 646	101 407	2,35%
ENEA SA Seria EV052016	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ENEA SA	Polska	15.06.2022	1,20 (Zmienny kupon)	1 000 000.	45	45 202	45 138	1,05%
Gmina Mysłibórz Seria A19 PLO266800013	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Mysłibórz	Polska	20.11.2034	1,87 (Zmienny kupon)	1 000.	1980	2 004	2 007	0,05%
Gmina Wisła Seria B19 PLO269800028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Wisła	Polska	20.11.2028	1,52 (Zmienny kupon)	1 000.	2400	2 415	2 418	0,06%
Gmina Miasta Tarnów Seria B19 PLO266300022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miasta Tarnów	Polska	20.11.2029	2,35 (Zmienny kupon)	1 000.	4650	4 358	4 364	0,10%
Gmina Miasta Tarnów Seria A19 PLO266300014	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miasta Tarnów	Polska	20.11.2031	2,55 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	4 922	4 931	0,11%
Gmina Osno Lubuskie Seria A19 PLO259500018	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Osno Lubuskie	Polska	22.11.2032	2,85 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 011	1 014	0,02%
Gmina Osno Lubuskie Seria A20 PLO259500026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Osno Lubuskie	Polska	20.11.2035	2,85 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 014	1 016	0,02%
Masto Zabrze Seria ZAB BB 020423	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Zabrze	Polska	03.04.2023	1,06 (Zmienny kupon)	10 000.	1000	10 005	10 030	0,23%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) Seria IDS1022 PL0000500070	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	25.10.2022	5,75 (Stały kupon)	1 000.	4200	4 615	4 614	0,11%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) PL0000500260	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	27.04.2027	1,88 (Stały kupon)	1 000.	251000	249 641	260 680	6,04%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) PL0000500278	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	Polska	05.06.2030	2,13 (Stały kupon)	1 000.	175000	175 292	179 044	4,15%
Miasto Łódź (Emitent) Seria LODZ 1022 101022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Łódź (Emitent)	Polska	11.04.2022	1,31 (Zmienny kupon)	1 000.	8265	8 318	8 329	0,19%
Miasto Łódź Seria LODZ0924	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Łódź	Polska	30.09.2024	1,36 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 055	5 065	0,12%
Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna PLPFR0000019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna	Polska	29.03.2024	1,38 (Stały kupon)	1 000 000.	106	106 000	108 793	2,52%
Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna PLPFR0000027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna	Polska	31.03.2025	1,63 (Stały kupon)	1 000 000.	123	122 613	126 579	2,93%
Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna PLPFR0000043	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna	Polska	07.06.2027	1,75 (Stały kupon)	1 000 000.	60	59 601	61 822	1,43%
Województwo Pomorskie Seria WPOMG 151222	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Województwo Pomorskie	Polska	15.12.2022	1,15 (Zmienny kupon)	1 000.	4400	4 429	4 425	0,10%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emiitent) PLO000500286	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emiitent)	Polska	03.07.2025	1,25 (Stały kupon)	1 000.	70000	69 528	71 637	1,66%
Gmina Jablonna Serie A20 PLO304200028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Jablonna	Polska	20.11.2026	1,28 (Zmienny kupon)	1 000.	4000	4 009	4 032	0,09%
Gmina Masta Lubań Serie C20 PLO313500038	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Lubań	Polska	30.09.2032	1,83 (Zmienny kupon)	1 000.	1150	1 153	1 159	0,03%
Gmina Suchy Las Serie B20 PLO311400025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	16.09.2024	1,34 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 001	1 005	0,02%
Gmina Barlinek Serie C20 PLO254400040	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Barlinek	Polska	20.11.2028	1,27 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 000	2 001	0,05%
Gmina Dopiewo Serie B/20 PLO266500084	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Dopiewo	Polska	07.12.2027	1,28 (Zmienny kupon)	1 000.	2500	2 505	2 507	0,06%
Gmina Masta Jaworzna Serie A20 PLO318800011	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	20.11.2028	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 002	1 004	0,02%
Gmina Masta Jaworzna Serie B20 PLO318800029	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	19.11.2029	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 003	1 004	0,02%
Gmina Masta Jaworzna Serie C20 PLO318800037	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	19.11.2030	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 003	1 004	0,02%
Gmina Masta Jaworzna Serie D20 PLO318800045	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	19.11.2031	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 505	1 507	0,03%
Gmina Masta Jaworzna Serie E20 PLO318800052	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	19.11.2032	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 505	1 507	0,03%
Gmina Masta Jaworzna Serie F20 PLO318800060	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	21.11.2033	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 505	1 508	0,03%
Gmina Masta Jaworzna Serie G20 PLO318800078	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Jaworzna	Polska	20.11.2034	1,37 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 506	1 508	0,03%
Gmina Kęty Serie C20 PLO321700018	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Kęty	Polska	25.11.2033	2,04 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 003	1 005	0,02%
Gmina Lesznowola Serie D20 PLO275200056	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	15.01.2029	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 002	1 009	0,02%
Gmina Lesznowola Serie E20 PLO275200049	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	15.01.2030	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	1200	1 203	1 211	0,03%
Gmina Lesznowola Serie G20 PLO275200031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	15.01.2032	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	4000	4 013	4 040	0,09%
Gmina Lesznowola Serie H20 PLO275200064	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	17.01.2033	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 007	2 020	0,05%
Gmina Opoczno Serie A20 PLO276600031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Opoczno	Polska	20.11.2028	1,62 (Zmienny kupon)	1 000.	2134	2 146	2 149	0,05%
Gmina Piaseczno Serie A20 PLO259600032	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Piaseczno	Polska	13.12.2027	1,06 (Zmienny kupon)	1 000.	4000	4 003	4 006	0,09%
Gmina Słupsk Serie A/2020 PLO263000047	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Słupsk	Polska	30.10.2029	1,62 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 005	2 010	0,05%
Gmina Miejska Legionowo Serie C20 PLO310600039	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miejska Legionowo	Polska	20.11.2023	1,32 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 505	1 507	0,03%
Gmina Lomianki Serie A20 PLO306100010	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lomianki	Polska	17.11.2025	1,27 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 001	1 003	0,02%
Miasto Poznań Serie A/2020 PLO318600015	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	16.11.2023	0,91 (Zmienny kupon)	1 000.	10000	10 012	10 023	0,23%
Miasto Poznań Serie B/2020 PLO318600023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	20.11.2024	1,02 (Zmienny kupon)	1 000.	15000	15 030	15 046	0,35%
Miasto Poznań Serie C/2020 PLO318600031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	26.11.2025	1,03 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 006	5 011	0,12%
Miasto Poznań Serie E/2020 PLO318600056	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	26.11.2027	1,30 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 015	5 021	0,12%
Gmina Suchy Las Serie C20 PLO311400033	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	30.09.2026	1,34 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 002	1 005	0,02%
Gmina Suchy Las Serie D20 PLO311400041	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	16.10.2028	1,33 (Zmienny kupon)	1 000.	1600	1 604	1 608	0,04%
Gmina Suchy Las Serie E20 PLO311400058	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	09.11.2030	1,33 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 003	1 005	0,02%
Gmina Suchy Las Serie F20 PLO311400066	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	01.12.2031	1,33 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 006	2 008	0,05%
Gmina Miejska Tczew Serie A20 PLO314000038	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miejska Tczew	Polska	30.11.2029	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 005	2 007	0,05%
Gmina Miejska Tczew Serie B20 PLO314000020	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miejska Tczew	Polska	02.12.2030	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	4000	4 011	4 016	0,09%
Gmina Miejska Tczew Serie C20 PLO314000012	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miejska Tczew	Polska	10.12.2031	1,48 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 006	2 008	0,05%
Gmina Długoleka Serie A20 PLO328600039	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Długoleka	Polska	20.11.2025	0,95 (Zmienny kupon)	1 000.	2000	2 003	2 004	0,05%
Gmina Uniejów Serie A20 PLO339000013	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Uniejów	Polska	22.11.2027	2,25 (Zmienny kupon)	1 000.	850	853	853	0,02%
MBANK HIPOTECZNY SA Serie BRE [K37]	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	MBANK HIPOTECZNY SA	Polska	03.01.2023	0,82 (Zmienny kupon)	100 000.	550	54 725	54 840	1,27%
P4 Sp. z o.o. Serie B PLO266100034	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	P4 Sp. z o.o.	Polska	29.12.2027	2,10 (Zmienny kupon)	1 000.	3000	3 000	3 000	0,07%
Miasto Poznań Serie F/2020 PLO318600064	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	22.12.2028	1,35 (Zmienny kupon)	1 000.	10000	10 033	10 036	0,23%
Miasto Toruń Serie B20 PLO338600011	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Toruń	Polska	29.12.2027	1,40 (Zmienny kupon)	1 000.	1500	1 501	1 501	0,03%
Miasto Toruń Serie C20 PLO338600045	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Toruń	Polska	29.12.2028	1,40 (Zmienny kupon)	1 000.	2500	2 502	2 502	0,06%
Miasto Toruń Serie D20 PLO338600037	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Toruń	Polska	31.12.2029	1,40 (Zmienny kupon)	1 000.	2500	2 502	2 502	0,06%
Suma:									3 672 315	3 751 756	86,86%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

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	-74 930	-1.67%
Aktywny rynek regulowany							0	0	0.00%
Aktywny rynek nieregulowany							0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku							0	-74 930	-1.67%
Forward Waluta CZK FWB01011 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	CZK	1	0	-533	-0.01%
Forward Waluta CZK FWB01035 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	CZK	1	0	-5	0.00%
Forward Waluta CZK FWB01065 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	CZK	1	0	-751	-0.02%
Forward Waluta CZK FWB01081 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	CZK	1	0	-4	0.00%
Forward Waluta CZK FWB01085 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	CZK	1	0	-554	-0.01%
Forward Waluta CZK FWB01091 15.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	CZK	1	0	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWA12016 23.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	-137	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01002 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-876	-0.02%
Forward Waluta EUR FWB01112 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	EUR	1	0	-1 259	-0.03%
Forward Waluta EUR FWB01141 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-22	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01142 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-17	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01162 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-2	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01163 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-14	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01198 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-47	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01233 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	218	0.01%
Forward Waluta EUR FWB01310 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-18	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01323 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-47	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01334 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-110	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01343 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01345 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-33	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01350 21.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-17	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01358 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-121	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01373 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-52	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01374 14.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	-2	0.00%
Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-404	-0.01%
Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	EUR	1	0	-585	-0.01%
Forward Waluta HUF FWB01001 19.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	HUF	1	0	-148	0.00%
Forward Waluta HUF FWB01043 19.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	HUF	1	0	-87	0.00%
Forward Waluta HUF FWB01064 19.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	HUF	1	0	0	0.00%
Forward Waluta USD FWB01292 28.01.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	USD	1	0	-1 028	-0.02%
Interest Rate Swap IR240517R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	20	0.00%
Interest Rate Swap IR240524R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	75	0.00%
Interest Rate Swap IR240529R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	141	0.00%
Interest Rate Swap IR241026R 25.10.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-859	-0.02%
Interest Rate Swap IR241030R 25.10.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	17	0.00%
Interest Rate Swap IR250313R 31.03.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	172	0.00%
Interest Rate Swap IR25033R 31.03.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-185	0.00%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Interest Rate Swap IR250716R 25.07.2025	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	281	0.01%
Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-2 988	-0.07%
Interest Rate Swap IR260712R 27.07.2026	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	1 111	0.03%
Interest Rate Swap IR26075R 27.07.2026	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 362	-0.03%
Interest Rate Swap IR27021R 04.02.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 242	-0.03%
Interest Rate Swap IR270410R 27.04.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-80	0.00%
Interest Rate Swap IR270411R 27.04.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-101	0.00%
Interest Rate Swap IR270416R 27.04.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-10	0.00%
Interest Rate Swap IR27044R 27.04.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR	1	0	-64	0.00%
Interest Rate Swap IR27063R 07.06.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	51	0.00%
Interest Rate Swap IR27065R 07.06.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK SŁĄSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	78	0.00%
Interest Rate Swap IR27072R 26.07.2027	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-642	-0.01%
Interest Rate Swap IR280420R 25.04.2028	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	5 702	0.13%
Interest Rate Swap IR280431R 25.04.2028	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-97	0.00%
Interest Rate Swap IR280436R 25.04.2028	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	95	0.00%
Interest Rate Swap IR300610R 05.06.2030	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	644	0.01%
Interest Rate Swap IR300615R 05.06.2030	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	180	0.00%
Interest Rate Swap IR300622R 05.06.2030	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	155	0.00%
Interest Rate Swap IR30062R 05.06.2030	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	235	0.01%
Interest Rate Swap IR30064R 05.06.2030	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	240	0.01%
Forward Waluta USD FWB01351 28.01.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	USD	1	0	-205	0.00%
Forward Waluta USD FWB01384 28.01.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki SA	Polska	USD	1	0	-1	0.00%
Forward Waluta USD FWB03008 18.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	USD	1	0	-2 755	-0.06%
Interest Rate Swap CC21021 23.02.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	96 426	96 532	2.24%
Interest Rate Swap CC21021 23.02.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-96 426	-102 221	-2.37%
Interest Rate Swap CC21026 23.02.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	97 208	102 876	2.38%
Interest Rate Swap CC21026 23.02.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-97 208	-97 315	-2.25%
Interest Rate Swap CC210311 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	27 794	27 802	0.64%
Interest Rate Swap CC210311 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-27 794	-29 991	-0.69%
Interest Rate Swap CC210312 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-42 757	-46 001	-1.07%
Interest Rate Swap CC210312 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	42 757	42 794	0.99%
Interest Rate Swap CC210322 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna EURIBOR	1	-26 829	-29 069	-0.67%
Interest Rate Swap CC210322 23.03.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	26 829	26 840	0.62%
Interest Rate Swap CC210914 24.09.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	-8 436	-8 527	-0.20%
Interest Rate Swap CC210914 24.09.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	8 436	8 430	0.20%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-17 236	-18 498	-0.43%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	17 236	17 251	0.40%
Interest Rate Swap CC21101 14.10.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 647	-9 224	-0.21%
Interest Rate Swap CC21101 14.10.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 647	8 653	0.20%
Interest Rate Swap CC21111 26.11.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 286	-4 626	-0.11%
Interest Rate Swap CC21111 26.11.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 286	4 288	0.10%
Interest Rate Swap CC21116 26.11.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-4 456	-4 810	-0.11%
Interest Rate Swap CC21116 26.11.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	JP Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	4 456	4 459	0.10%
Interest Rate Swap CC211212 20.12.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 572	-9 234	-0.21%
Interest Rate Swap CC211212 20.12.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 572	8 576	0.20%
Interest Rate Swap CC211214 20.12.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 592	-9 233	-0.21%
Interest Rate Swap CC211214 20.12.2021	Nietotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 592	8 596	0.20%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Interest Rate Swap CC211215 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 897	-13 850	-0.32%
Interest Rate Swap CC211215 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 897	12 903	0.30%
Interest Rate Swap CC211216 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 834	-13 851	-0.32%
Interest Rate Swap CC211216 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 834	12 840	0.30%
Interest Rate Swap CC211217 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	46 000	46 318	1.07%
Interest Rate Swap CC211217 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	-46 000	-46 022	-1.07%
Interest Rate Swap CC211220 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 453	-4 611	-0.11%
Interest Rate Swap CC211220 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 453	4 453	0.10%
Interest Rate Swap CC211221 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-58 260	-59 953	-1.39%
Interest Rate Swap CC211221 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	58 260	58 265	1.35%
Interest Rate Swap CC211222 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-16 153	-16 135	-0.37%
Interest Rate Swap CC211222 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	16 153	16 154	0.37%
Interest Rate Swap CC22011 18.01.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 324	-4 600	-0.11%
Interest Rate Swap CC22011 18.01.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 324	4 329	0.10%
Interest Rate Swap CC22083 24.08.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-12 674	-12 619	-0.29%
Interest Rate Swap CC22083 24.08.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	12 674	12 678	0.29%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 870	-13 949	-0.32%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 870	12 873	0.30%
Interest Rate Swap CC220941 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-8 717	-9 226	-0.21%
Interest Rate Swap CC220941 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	8 717	8 723	0.20%
Interest Rate Swap CC22101 26.10.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-25 268	-25 188	-0.58%
Interest Rate Swap CC22101 26.10.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	25 268	25 280	0.59%
Interest Rate Swap CC23014 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna EURIBOR	1	-50 220	-50 830	-1.18%
Interest Rate Swap CC23014 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	50 220	50 278	1.16%
Interest Rate Swap CC23015 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-14 784	-15 168	-0.35%
Interest Rate Swap CC23015 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	14 784	14 791	0.34%
Interest Rate Swap CC230611 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 137	-9 229	-0.21%
Interest Rate Swap CC230611 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	9 137	9 142	0.21%
Interest Rate Swap CC23069 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 679	-5 775	-0.13%
Interest Rate Swap CC23069 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 679	5 682	0.13%
Interest Rate Swap CC230711 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała EURIBOR	1	-58 117	-60 773	-1.41%
Interest Rate Swap CC230711 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	58 117	59 097	1.37%
Interest Rate Swap CC230715 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-61 880	-65 447	-1.52%
Interest Rate Swap CC230715 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	61 880	62 957	1.46%
Interest Rate Swap CC23078 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-44 675	-46 748	-1.08%
Interest Rate Swap CC23078 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	44 675	45 428	1.05%
Interest Rate Swap CC230811 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-25 520	-25 300	-0.59%
Interest Rate Swap CC230811 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	25 520	25 640	0.59%
Interest Rate Swap CC230815 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-12 444	-12 650	-0.29%
Interest Rate Swap CC230815 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 444	12 501	0.29%
Interest Rate Swap CC230818 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-24 888	-25 300	-0.59%
Interest Rate Swap CC230818 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	24 888	24 995	0.58%
Interest Rate Swap CC230821 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-24 789	-25 300	-0.59%
Interest Rate Swap CC230821 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	24 789	24 873	0.58%
Interest Rate Swap CC23083 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-13 024	-12 654	-0.29%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Interest Rate Swap CC23083 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	13 024	13 028	0.30%
Interest Rate Swap CC23085 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-15 162	-15 008	-0.35%
Interest Rate Swap CC23085 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	15 162	15 179	0.35%
Interest Rate Swap CC23088 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-13 007	-12 743	-0.30%
Interest Rate Swap CC23088 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	13 007	13 011	0.30%
Interest Rate Swap CC23103 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-48 880	-50 602	-1.17%
Interest Rate Swap CC23103 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	48 880	48 902	1.13%
Interest Rate Swap CC23104 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-48 985	-50 627	-1.17%
Interest Rate Swap CC23104 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	48 985	49 008	1.13%
Interest Rate Swap CC23109 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-16 980	-17 065	-0.40%
Interest Rate Swap CC23109 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	16 980	16 987	0.39%
Interest Rate Swap CC240133 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-13 855	-14 099	-0.33%
Interest Rate Swap CC240133 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	13 855	13 874	0.32%
Interest Rate Swap CC240134 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-24 690	-25 227	-0.58%
Interest Rate Swap CC240134 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	24 690	24 703	0.57%
Interest Rate Swap CC240135 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-26 856	-27 583	-0.64%
Interest Rate Swap CC240135 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	26 856	26 863	0.62%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 049	-5 525	-0.13%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 049	5 056	0.12%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-10 011	-10 910	-0.25%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	10 011	10 025	0.23%
Interest Rate Swap CC240722 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna EURIBOR	1	-28 149	-30 420	-0.70%
Interest Rate Swap CC240722 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	28 149	28 348	0.66%
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	9 133	0.21%
Interest Rate Swap CC24073 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 120	-10 047	-0.23%
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	15 769	0.37%
Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-15 747	-16 912	-0.39%
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	-5 472	-0.13%
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	4 981	0.12%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-6 909	-9 555	-0.22%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	6 909	8 569	0.20%
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	11 509	0.27%
Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 494	-12 445	-0.29%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 714	-6 267	-0.15%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 714	5 722	0.13%
Interest Rate Swap CC250213 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-41 167	-42 088	-0.97%
Interest Rate Swap CC250213 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	41 167	41 181	0.95%
Interest Rate Swap CC250215 10.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała EURIBOR	1	-22 310	-23 539	-0.55%
Interest Rate Swap CC250215 10.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	22 310	22 879	0.53%
Interest Rate Swap CC250230 17.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA WIBOR STOPA STAŁA - ZMIENNA	1	-16 846	-17 539	-0.41%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Interest Rate Swap CC250230 17.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	16 846	17 228	0.40%
Interest Rate Swap CC25026 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	STALA-ZMIENNAWIBOR STOPA STALA-ZMIENNA	1	-41 186	-42 107	-0.97%
Interest Rate Swap CC25026 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	41 186	41 200	0.95%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stala EURIBOR	1	-13 526	-15 177	-0.35%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR PRIBOR STOPA STALA-ZMIENNAWIBOR STOPA STALA-ZMIENNA	1	13 526	13 539	0.31%
Interest Rate Swap CC270212 10.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	-20 000	-19 528	-0.45%
Interest Rate Swap CC270212 10.11.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	20 000	20 007	0.46%
Interest Rate Swap CC27105 08.10.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stala EURIBOR	1	-4 583	-4 530	-0.10%
Interest Rate Swap CC27105 08.10.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 583	4 585	0.11%
Interest Rate Swap CI210323R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-189	0.00%
Interest Rate Swap CI210327R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-76	0.00%
Interest Rate Swap CI210330R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-78	0.00%
Interest Rate Swap CI210333R 24.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-25	0.00%
Interest Rate Swap CI210335R 24.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-11	0.00%
Interest Rate Swap CI210336R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-14	0.00%
Interest Rate Swap CI210340R 24.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-17	0.00%
Interest Rate Swap CI210341R 29.03.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. Morga	Polska	STOPA STALAZMIENNA	1	0	-50	0.00%
Interest Rate Swap CI210410R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	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 STALAZMIENNA	1	0	-61	0.00%
Interest Rate Swap CI210420R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-49	0.00%
Interest Rate Swap CI210433R 19.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	87	0.00%
Interest Rate Swap CI210437R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	39	0.00%
Interest Rate Swap CI210440R 21.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	144	0.00%
Interest Rate Swap CI210450R 26.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-85	0.00%
Interest Rate Swap CI21053R 14.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-31	0.00%
Interest Rate Swap CI21054R 17.05.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	BUBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-29	0.00%
Interest Rate Swap CI210614R 30.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stala EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	125	0.00%
Interest Rate Swap CI21067R 30.06.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stala EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	15	0.00%
Interest Rate Swap CI21115R 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stala EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	5	0.00%
Interest Rate Swap CI22031R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-462	-0.01%
Interest Rate Swap CI220354R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	52	0.00%
Interest Rate Swap CI220415R 04.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-13	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 STALAZMIENNA	1	0	-123	0.00%
Interest Rate Swap CI220928R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-100	0.00%
Interest Rate Swap CI220932R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-301	-0.01%
Interest Rate Swap CI220936R 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stala EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	1	0.00%
Interest Rate Swap CI220950R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-187	0.00%
Interest Rate Swap CI220951R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-204	0.00%
Interest Rate Swap CI220953R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-225	-0.01%
Interest Rate Swap CI220957R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-82	0.00%
Interest Rate Swap CI220958R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STALAZMIENNA	1	0	-8	0.00%
Interest Rate Swap CI221110R 28.11.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-37	0.00%
Interest Rate Swap CI22114R 16.12.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-63	0.00%
Interest Rate Swap CI22118R 20.11.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-61	0.00%
Interest Rate Swap CI221211R 12.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-9	0.00%
Interest Rate Swap CI221214R 23.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STALAZMIENNA	1	0	-5	0.00%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Interest Rate Swap CI22123R 05.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	1	0.00%
Interest Rate Swap CI22124R 05.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-15	0.00%
Interest Rate Swap CI22127R 07.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	1	0.00%
Interest Rate Swap CI23012R 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	124	0.00%
Interest Rate Swap CI230319R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-545	-0.01%
Interest Rate Swap CI230322R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-410	-0.01%
Interest Rate Swap CI230326R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-361	-0.01%
Interest Rate Swap CI230330R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-22	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 STALA/ZMIENNA	1	0	-583	-0.01%
Interest Rate Swap CI230613R 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	1	0.00%
Interest Rate Swap CI23126R 11.12.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	15	0.00%
Interest Rate Swap CI240719R 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	-273	-0.01%
Interest Rate Swap CI250225R 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	333	0.01%
Interest Rate Swap CI25062R 24.06.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	2	0.00%
Interest Rate Swap CI260415R 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-818	-0.02%
Interest Rate Swap CI260440R 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	-157	0.00%
Interest Rate Swap CI42046R 03.04.2042	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STALA/ZMIENNA	1	0	365	0.01%
Interest Rate Swap IR210411R 29.04.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-68	0.00%
Interest Rate Swap IR210713R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	635	0.01%
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	-768	-0.02%
Interest Rate Swap IR21093R 10.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-154	0.00%
Interest Rate Swap IR21094R 10.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-66	0.00%
Interest Rate Swap IR21114R 08.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	29	0.00%
Interest Rate Swap IR220211R 14.02.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 448	-0.03%
Interest Rate Swap IR22027R 07.02.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING BANK ŚLĄSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-2 662	-0.06%
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	-2 044	-0.05%
Interest Rate Swap IR230132R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-2 806	-0.06%
Interest Rate Swap IR230135R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 664	-0.04%
Interest Rate Swap IR230137R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 700	-0.04%
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	-3 600	-0.08%
Interest Rate Swap IR231011R 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	962	0.02%
Interest Rate Swap IR23108R 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA (Emitent)	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-2 654	-0.06%
Interest Rate Swap IR240433R 25.04.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-52	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	-3 921	-0.09%
Suma:							0	-74 930	-1.67%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

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						100 000		100 023	2.32%
Lokata terminowa 364 dniowa do 2021-11-05	BANK BGŻ BNP PARIBAS SA (Emitent)	Polska	PLN	0.15 (Stały kupon)	100 000	100 000	100 023	100 023	2.32%
W walutach państw nienależących do OECD						0		0	0.00%
Suma:					100 000		100 023		2.32%

GWARANTOWANE SKŁADNIKI LOKAT	Rodzaj	Łączna liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Papiery wartościowe gwarantowane przez jednostki samorządu terytorialnego			0	0	0.00%
Papiery wartościowe gwarantowane przez międzynarodowe instytucje finansowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska lub przynajmniej jedno z państw należących do OECD			0	0	0.00%
Papiery wartościowe gwarantowane przez NBP			0	0	0.00%
Składniki bez gwarancji			0	0	0.00%
Papiery wartościowe gwarantowane przez państwa należące do OECD (z wyłączeniem Rzeczypospolitej Polskiej)			0	0	0.00%
Papiery wartościowe gwarantowane przez Skarb Państwa			782 675	808 555	18.73%
Dłużne papiery wartościowe		496 289	782 675	808 555	18.73%
Suma:			782 675	808 555	18.73%

*) Papiery wartościowe emitowane przez Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej oraz innych państw zagranicznych zostały ujawnione w tabelach uzupełniających dotyczących tych składników lokat (o ile występują)

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	45 557	1.06%
Grupa Kapitałowa mBank S.A.	26 397	0.62%
Grupa ING	-6 080	-0.14%
Grupa Banku PKO BP	76 134	1.76%
Grupa PZU S.A.	42 343	1.00%
Suma:	184 351	4.30%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

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 GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) PL0000500260	136 052	3.15%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) PL0000500278	51 155	1.18%
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent) PL0000500286	71 637	1.66%
ENEA SA Seria ENEA0624 PLENEA000096	24 723	0.57%
ENEA SA Seria EV122015	70 131	1.62%
ENEA SA Seria EX122017	96 387	2.23%
Forward Waluta CZK FWB01081 15.01.2021	-4	0.00%
Forward Waluta CZK FWB01085 15.01.2021	-554	-0.01%
Forward Waluta CZK FWB01091 15.01.2021	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01002 21.01.2021	-876	-0.02%
Forward Waluta EUR FWB01141 14.01.2021	-22	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01142 14.01.2021	-17	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01162 14.01.2021	-2	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01163 14.01.2021	-14	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01198 14.01.2021	-47	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01233 14.01.2021	218	0.01%
Forward Waluta EUR FWB01310 21.01.2021	-18	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01323 21.01.2021	-47	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01334 21.01.2021	-110	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01343 21.01.2021	-23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01345 14.01.2021	-33	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01350 21.01.2021	-17	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01358 14.01.2021	-121	0.00%
Forward Waluta EUR FWB01373 14.01.2021	-52	0.00%
Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021	-404	-0.01%
Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021	-585	-0.01%
Forward Waluta HUF FWB01064 19.01.2021	0	0.00%
Forward Waluta USD FWB01292 28.01.2021	-1 028	-0.02%
Forward Waluta USD FWB01384 28.01.2021	-1	0.00%
GIEŁDA PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE SA Seria C PLGPW0000066	13 402	0.31%
Gmina Dopiewo Seria B/20 PLO266500084	2 507	0.06%
Gmina Kęty Seria C20 PLO321700018	1 005	0.02%
Gmina Lesznowola Seria D20 PLO275200056	1 009	0.02%
Gmina Lesznowola Seria E20 PLO275200049	1 211	0.03%
Gmina Lesznowola Seria G20 PLO275200031	4 040	0.09%
Gmina Lesznowola Seria H20 PLO275200064	2 020	0.05%
Gmina Łomianki Seria A20 PLO306100010	1 003	0.02%
Gmina Miasta Jaworzna Seria A20 PLO318800011	1 004	0.02%
Gmina Miasta Jaworzna Seria B20 PLO318800029	1 004	0.02%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Gmina Miasta Jaworzna Seria C20 PLO318800037	1 004	0.02%
Gmina Miasta Jaworzna Seria D20 PLO318800045	1 507	0.03%
Gmina Miasta Jaworzna Seria E20 PLO318800052	1 507	0.03%
Gmina Miasta Jaworzna Seria F20 PLO318800060	1 508	0.03%
Gmina Miasta Jaworzna Seria G20 PLO318800078	1 508	0.03%
Gmina Miasta Lubań Seria C20 PLO313500038	1 159	0.03%
Gmina Miejska Tczew Seria A20 PLO314000038	2 007	0.05%
Gmina Miejska Tczew Seria B20 PLO314000020	4 016	0.09%
Gmina Miejska Tczew Seria C20 PLO314000012	2 008	0.05%
Gmina Piaseczno Seria A20 PLO259600032	4 006	0.09%
Gmina Słupsk Seria A/2020 PLO263000047	2 010	0.05%
Gmina Suchy Las Seria B20 PLO311400025	1 005	0.02%
Gmina Suchy Las Seria C20 PLO311400033	1 005	0.02%
Gmina Suchy Las Seria D20 PLO311400041	1 608	0.04%
Gmina Suchy Las Seria E20 PLO311400058	1 005	0.02%
Gmina Suchy Las Seria F20 PLO311400066	2 008	0.05%
Interest Rate Swap CC210311 23.03.2021	27 802	0.64%
Interest Rate Swap CC210311 23.03.2021	-29 991	-0.69%
Interest Rate Swap IR210411R 29.04.2021	-99	0.00%
Interest Rate Swap IR21078R 26.07.2021	-877	-0.02%
Interest Rate Swap IR231011R 25.10.2023	-646	-0.01%
Interest Rate Swap IR23108R 25.10.2023	-3 300	-0.08%
Interest Rate Swap IR250313R 31.03.2025	-444	-0.01%
Interest Rate Swap IR25033R 31.03.2025	-629	-0.01%
Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	-3 990	-0.09%
Interest Rate Swap IR27044R 27.04.2027	-2 456	-0.06%
Interest Rate Swap IR300615R 05.06.2030	-757	-0.02%
MFINANCE FRANCE SA XS1143974159	2 350	0.05%
Miasto Łódź (Emitent) Seria LODZ 1022 101022	8 329	0.19%
Miasto Łódź Seria LODZ0924	5 065	0.12%
Miasto Poznań Seria A2020 PLO318600015	10 023	0.23%
Miasto Poznań Seria B2020 PLO318600023	15 046	0.35%
Miasto Poznań Seria C2020 PLO318600031	5 011	0.12%
Miasto Poznań Seria E2020 PLO318600056	5 021	0.12%
Miasto Poznań Seria F2020 PLO318600064	10 036	0.23%
Miasto Poznań_old Seria H	5 017	0.12%
Miasto Toruń Seria B20 PLO338600011	1 501	0.03%
Miasto Toruń Seria C20 PLO338600045	2 502	0.06%
Miasto Toruń Seria D20 PLO338600037	2 502	0.06%
Miasto Zabrze Seria ZAB BB 020423	10 030	0.23%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA PLBPHHP00176	8 535	0.20%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA PLBPHHP00184	10 111	0.23%
PEKAO BANK HIPOTECZNY SA PLBPHHP00259	35 056	0.81%
PGE POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA Seria PGE002210526 PLPGER000069	20 032	0.46%
PKO BANK HIPOTECZNY SA PLPKOHP00074	5 021	0.12%
Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna PLPFR0000019	108 793	2.52%
Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna PLPFR0000027	102 910	2.38%
PS0425 PL0000112728	1 018	0.02%
Województwo Pomorskie Seria WPOM G 151222	4 425	0.10%
WZ0524 PL0000110615	20 109	0.47%
Suma:	886 460	20.51%

Bilans

Sprawozdanie roczne - za okres roczny kończący się 31.12.2020

Bilans

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

BILANS	31.12.2020	31.12.2019
I. Aktywa	4 318 988	5 478 695
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	84 239	33 353
2. Należności	25 500	46 847
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	0	0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	1 861 061	2 614 147
- dłużne papiery wartościowe	1 861 061	2 614 147
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	2 348 188	2 784 348
- dłużne papiery wartościowe	2 228 100	2 367 452
6. Nieruchomości	0	0
7. Pozostałe aktywa	0	0
II. Zobowiązania	206 100	468 248
III. Aktywa netto (I - II)	4 112 888	5 010 447
IV. Kapitał funduszu	3 732 620	4 682 253
1. Kapitał wpłacony	13 663 934	12 325 694
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-9 931 314	-7 643 441
V. Dochody zatrzymane	401 760	336 689
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	352 444	296 229
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	49 316	40 460
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	-21 492	-8 495
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	4 112 888	5 010 447
Liczba zarejestrowanych jednostek uczestnictwa	316 905 446.090	392 261 288.398
Kategoria A	316 905 446.090	392 261 288.398
Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa	12.98	12.77
Kategoria A	12.98	12.77

Rachunek wyniku z operacji

Sprawozdanie roczne - za okres roczny kończący się 31.12.2020

Rachunek Wyniku

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

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	01-01-2020 - 31-12-2020	01-01-2019 - 31-12-2019
I. Przychody z lokat	97 011	129 702
Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0
Przychody odsetkowe	97 011	126 790
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0
Dodatnie saldo różnic kursowych	0	2 890
Pozostałe	0	22
II. Koszty funduszu	40 796	51 829
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	32 831	39 181
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0
Opłaty dla depozytariusza	633	355
Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów	0	0
Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	12	6
Usługi w zakresie rachunkowości	0	0
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0
Usługi prawne	0	0
Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0
Koszty odsetkowe	7 209	12 251
Koszty związane z prowadzeniem nieruchomości	0	0
Ujemne saldo różnic kursowych	65	0
Pozostałe	46	36
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	40 796	51 829
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	56 215	77 873
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	-4 141	-789
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	8 856	31 322
- z tytułu różnic kursowych	26 739	25 199
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-12 997	-32 111
- z tytułu różnic kursowych	-7 591	-21 893
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	52 074	77 084
Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa *	0.21	0.20
Kategoria A	0.21	0.20

*) 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')

Zestawienie zmian w aktywach netto

Sprawozdanie roczne - za okres roczny kończący się 31.12.2020

Zestawienie zmian

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	01-01-2020 - 31-12-2020	01-01-2019 - 31-12-2019
I. Zmiana wartości aktywów netto		
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	5 010 447	4 850 490
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy	52 074	77 084
a) przychody z lokat netto	56 215	77 873
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	8 856	31 322
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-12 997	-32 111
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	52 074	77 084
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)	-949 633	82 873
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału)	1 338 240	1 263 849
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału)	-2 287 873	-1 180 976
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym (3-4+-5)	-897 559	159 957
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	4 112 888	5 010 447
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	4 101 389	4 898 032
II. Zmiana liczby jednostek uczestnictwa		
Zmiana liczby jednostek w okresie sprawozdawczym w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	104 227 620.864	99 808 178.738
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	179 583 463.191	93 309 506.289
Saldo zmian	-75 355 842.308	6 498 672.467
Zmiana liczby jednostek od początku działalności funduszu w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	1 131 713 616.364	1 027 485 995.500
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	814 808 170.311	635 224 707.120
Saldo zmian	316 905 446.090	392 261 288.398
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	316 905 446.090	392 261 288.398

III. Zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa				
1. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A			12.77	12.57
2. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A			12.98	12.77
3. Procentowa zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A			1.64%	1.59%
4. Minimalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	12.64	23.03.2020	12.56	03.01.2019
5. Maksymalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	12.99	28.12.2020	12.77	27.12.2019
6. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa wg ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	12.98	30.12.2020	12.77	30.12.2019
Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:			0.99%	1.06%
Wynagrodzenie dla Towarzystwa			0.80%	0.80%
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję			-	-
Opłaty dla depozytariusza			0.02%	0.01%
Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów			-	-
Usługi w zakresie rachunkowości			-	-
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu			-	-

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

Noty objaśniające

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

Nota - 1	Polityka rachunkowości Funduszu	1
Nota - 2	Należności Subfunduszu.....	5
Nota - 3	Zobowiązania Subfunduszu	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 ...	15
Nota - 8	Kredyty i pożyczki.....	16
Nota - 9	Waluty i różnice kursowe.....	17
Nota - 10	Dochody i ich dystrybucja.....	19
Nota - 11	Koszty Subfunduszu.....	20
Nota - 12	Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa.....	21

Nota - 1 Polityka rachunkowości Funduszu

Przepisy prawne regulujące rachunkowość Funduszu i Subfunduszu

Rachunkowość Funduszu prowadzona była w okresie sprawozdawczym zgodnie z przepisami *Ustawy z dnia 29 września 1994 roku o rachunkowości* (t.j. Dz.U. z 2021. poz. 217, ze zm.) oraz *Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 24 grudnia 2007 roku w sprawie szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych* (Dz.U. Nr 249, poz. 1859, ze zm.) (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 Finansowych 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 połączanego.

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 dłużne prezentowane są w wartościach wraz z odsetkami naliczonymi.

W przypadku, gdy wycena wierzytelności (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.

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

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 – wyliczenie odbywa się w skorygowanej cenie nabycia wyliczonej przy zastosowaniu 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, CDS, *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 kontraktów *future*
 - jako wartość instrumentu wykazywana jest wartość ustalona na podstawie kursu zamknięcia z rynku notowań kontraktu.
- c) dla kontraktów *CDS* (*Credit Default Swap*)
 - jako wartość instrumentu wykazywana jest wartość wyliczona z zastosowaniem odpowiedniego modelu wyceny (oszacowanie wartości bieżącej przyszłych kwot rozliczenia, wraz z prawdopodobieństwem danej płatności), uwzględniającego mieszalne dane z rynku instrumentów finansowych.

Jednostkowe sprawozdanie roczne stanowi składnik połączonego sprawozdania rocznego, które w całości i w zakresie poszczególnych sprawozdań jednostkowych: podlega badaniu biegłego rewidenta, zatwierdzeniu przez Walne Zgromadzenie Towarzystwa (Pekao TFI SA), jest ogłaszane na stronie www.pekaotfi.pl, podlega przekazaniu do Komisji oraz do sądu prowadzącego rejestr funduszy inwestycyjnych.

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 z akcji ujmowane są w księgach rachunkowych pierwszego dnia, gdy akcje emitenta 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 udzielonej pożyczki papierów wartościowych 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 finansowego. Wycena ta odbywa się w wartości godziwej, z wyjątkiem instrumentów, dla których wartość stanowi skorygowana cena nabycia wyliczona przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

Poniżej przedstawione są zasady ogólne obowiązujące jednakowo we wszystkich subfunduszach wydzielonych w Funduszu – niezależnie, czy w okresie sprawozdawczym bądź zgodnie z polityką inwestycyjną subfunduszu dany rodzaj aktywów występował lub mógł występować, czy nie.

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, na GPW (akcje, prawa do akcji, prawa poboru) oraz na *Rynku Treasury BondSpot Poland* (obligacje Skarbu Państwa) 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 dłużne, dla których nie ma możliwości uzyskiwania w sposób ciągły wartości rynkowej (w tym np. obligacje zamienne, bony handlowe i obligacje korporacyjne), wyceniane są w skorygowanej cenie nabycia, wyliczonej przy zastosowaniu 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 wycenianej 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.
- W odniesieniu do tytułów uczestnictwa funduszy notowanych na rynkach (ETF: Exchange Traded Fund) w uzasadnionych przypadkach (np. skala obrotu poza rynkiem zorganizowanym, różnice czasowe między rynkami) stosuje się wycenę ustaloną przez podmiot odpowiedzialny za fundusz (np. emitent, zarządzający funduszem lub na jego zlecenie).
- 2) Fundusz korzysta, na potrzeby uzyskiwania cen oraz informacji o instrumentach finansowych, z uznanych serwisów informacyjnych ('Dostawców Cen'), w tym w szczególności:
 - Bloomberg L.P. („Bloomberg“)
Serwis: 'Bloomberg Professional Service', Bloomberg Data License
M.in. wykorzystywane są kursy BGN ('*Bloomberg Generic Price*') - dla ustalenia których Bloomberg korzysta w szczególności z danych z odpowiedniego rynku dealerskiego transakcji bezpośrednich.
- 3) Modele wykorzystywane na potrzeby wyceny specyficznych instrumentów:
 - Podstawowym modelem stosowanym w zakresie wyceny 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 wyliczenia zdyskontowanych przepływów pieniężnych.
 - Dla instrumentów pochodnych typu CDS (*credit default swap*) stworzony został model wyceny polegający na szacowaniu wartości bieżącej przyszłych kwot rozliczenia, wraz z prawdopodobieństwem danej płatności, uwzględniającego mierzalne dane z rynku instrumentów finansowych.
 - 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:
- 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;
 - Wycena skutków umów nabycia papierów wartościowych wraz z równoczesnym zobowiązaniem się kontrahenta do odkupu tak nabytych papierów wartościowych oraz umów zbycia papierów wartościowych z równoczesnym zobowiązaniem się kontrahenta do odsprzedaży tych papierów wartościowych (transakcji na pojedynczym instrumencie z dwoma przeciwstawnymi komponentami rozliczonymi w różnych terminach buy sell-back, sell buy-back, repo i reverse repo – określonych w przepisach jako 'transakcje zwrotne kupno-sprzedaż' BSB lub 'transakcje zwrotne sprzedaż-kupno' SBB oraz 'transakcja odkupu' repo i reverse repo). dokonywana jest od dnia zawarcia transakcji poprzez wycenę w skorygowanej cenie nabycia wyliczonej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej. Instrument finansowy, będący przedmiotem takiej transakcji pozostaje księgowo w portfelu lokat podmiotu zbywającego (w przypadku transakcji sbb / repo – w Funduszu / Subfunduszu) i podlega odpowiednio wycenie.
 - Ustalanie wartości zobowiązań z tytułu kredytów odbywa się w skorygowanej cenie nabycia wyliczonej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.
 - 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.
- 5) W uzasadnionych przypadkach, gdy na skutek zdarzeń dotyczących emitentów bądź samych posiadanych dłużnych 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 stwierdzenia utraty wartości oraz oszacowania koniecznego odpisu (zamiast standardowego mechanizmu wyceny instrumentów) mogą być: znaczne pogorszenie sytuacji finansowej emitenta, 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 kwoty odpisu w każdym przypadku dokonywane jest adekwatnie do informacji o emitencie, oceny co do możliwości przyszłego zwrotu wierzytelności, oraz jakości posiadanych zabezpieczeń wierzytelności.

Wartości szacunkowe

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

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

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

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

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

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

Ustalanie Wartości Aktywów Netto i wyniku z operacji

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

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

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	2020-12-31	2019-12-31
Należności	25 500	46 847
Z tytułu zbytych lokat	25 500	46 844
Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
Z tytułu zbytych jednostek uczestnictwa a albo w ydanych certyfikatów inw estycyjnych	0	0
Z tytułu dywidend	0	0
Z tytułu odsetek	0	3
Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0	0
Z tytułu udzielonych pożyczek w podziale na podmioty udzielające pożyczek	0	0
Pozostałe	0	0

Nota - 3 Zobowiązania Subfunduszu

Wartości w tys. zł

NOTA-3 ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	2020-12-31	2019-12-31
Zobowiązania	206 100	468 248
Z tytułu nabytych aktywów	1	52 642
Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	86 176	378 186
Z tytułu instrumentów pochodnych	94 995	21 298
Z tytułu w płat na jednostki uczestnictwa a albo certyfikaty inw estycyjne	11 801	7 856
Z tytułu odkupionych jednostek uczestnictwa a albo w wykupionych certyfikatów inw estycyjnych	3 926	2 284
Z tytułu w wypłaty dochodów funduszu	0	0
Z tytułu w wypłaty przychodów funduszu	0	0
Z tytułu w yemitowanych 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	9 201	5 982
w tym:		
Zobowiązania z tytułu depozytów zabezpieczających	5 800	1 907
Zobowiązania z tytułu podatku	500	481
Zobowiązania z tytułu wynagrodzenia za zarządzanie	2 757	3 386

Nota - 4 Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Zestawienie środków pieniężnych i ich ekwiwalentów:

NOTA-4 I. STRUKTURA ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH NA RACHUNKACH BANKOWYCH	31.12.2020		31.12.2019	
	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
I. Banki / w aluty		84 239		33 353
J.P. MORGAN SECURITIES PLC		6 230		213
EUR	1 350	6 230	50	213
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL		11 814		5 025
EUR	2 560	11 814	1 180	5 025
Santander Bank Polska S.A.		9 050		1 050
PLN	9 050	9 050	1 050	1 050
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA		2 680		0
PLN	2 680	2 680	0	0
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		1 061		0
EUR	230	1 061	0	0
DOM MAKLERSKI MBANKU SA		0		522
EUR	0	0	123	522
Santander Biuro Maklerskie		187		0
EUR	40	187	0	0
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		0		0
PLN	0	0	0	0
ING BANK ŚLĄSKI SA		5 760		1 110
PLN	5 760	5 760	1 110	1 110
Bank Polska Kasa Opieki SA		9 996		17 762
CZK	1	0	0	0
EUR	0	2	1 612	6 863
HUF	715	9	0	0
PLN	9 865	9 865	10 253	10 253
USD	32	120	170	646
mBank SA		1 180		0
PLN	1 180	1 180	0	0
BNP PARIBAS		12 967		4 514
EUR	2 810	12 967	1 060	4 514
J.P. MORGAN AG		277		0
EUR	60	277	0	0
BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.		9 100		3 157
EUR	0	0	180	767
PLN	9 100	9 100	2 390	2 390
SOCIETE GENERALE PARIS		13 937		0
EUR	3 020	13 937	0	0

**) 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 wykonanie kontraktów pochodnych otrzymane oraz depozyt zabezpieczający złożony w Banku Pekao. Depozyty zabezpieczające otrzymane są także zaprezentowane jako zobowiązania wobec poszczególnych banków (które przekazały te depozyty)*

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	2020-12-31		2019-12-31	
	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	2 297	381	113	19
EUR	11 845	53 147	15 545	66 771
HUF	65 101	817	94 733	1 268
PLN	25 172	25 172	12 028	12 028
USD	2 000	7 732	1 326	5 207

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	46 604 tys. zł	1.1%
dłużne papiery wartościowe	1 577 000 tys. zł	36.5%

Klasa ryzyka	Poziom obciążenia ryzykiem	Udział w aktywach Subfunduszu
zobowiązania w walutach	1 230 922 tys. zł	---
wartość niezabezpieczona (w podziale na waluty)	-11 tys. EUR -17 tys. USD 29 553 tys. CZK 304 999 tys. HUF	0.23%
b) ryzyko kredytowe		
obligacje Skarbu Państwa	1 704 520 tys. zł	39.5%
korporacyjne papiery wartościowe	1 303 041 tys. zł	30.2%
obligacje skarbowe zagraniczne	585 911 tys. zł	13.6%
depozyty bankowe	100 023 tys. zł	2.3%
c) ryzyko przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej		
obligacje o zmiennej stopie procentowej	1 224 240 tys. zł	--
d) ryzyko wartości godziwej wynikające ze stopy procentowej		
instrumenty o stałej stopie procentowej (lub zerowej)	2 864 921 tys. zł	--
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)	1 191 270 tys. zł	27.5%

Informacje uzupełniające w zakresie ryzyka

- W okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki nierozliczenia się transakcji zawieranych przez Subfundusz.
- Ryzyko kredytowe i ryzyko rozliczeniowe
 - Ryzyko kredytowe i ryzyko kontrahenta 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* obowiązują dwustronne umowy zabezpieczające, jednakże faktycznie nie mają miejsca przypadki wymiany zabezpieczenia (dla potrzeb zmniejszenia ryzyka wykonania zobowiązań kontrahenta).
 - Przypadki znaczącej koncentracji ryzyka kredytowego w poszczególnych kategoriach lokat (dla potrzeb ustalenia ryzyka kredytowego emitenta papierów dłużnych), dla których Subfundusz ma ekspozycję stanowiącą ponad 5 % wartości Aktywów:

Emitenci (7) z zaangażowaniem ponad 5% aktywów	
1. Polski Skarb Państwa	20.7%
2. BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO (Emitent)	12.3%
3. PKO BANK HIPOTECZNY SA	7.9%
4. Polski Fundusz Rozwoju Spółka Akcyjna	6.9%
5. Ministry of Finance - Czech Republic	6.7%
6. ENEA SA	6.2%
7. Ministry of Finance - Hungary	5.5%

- Ryzyko walutowe
 - Ryzyko walutowe ma związek ze zmiennością kursów walut i potencjalną utratą wartości lokat wyrażoną w złotych w przypadku, gdy Subfundusz ma część aktywów denominowanych w walutach obcych oraz odpowiednim zwiększeniem wartości (w złotych) zobowiązań wyrażonych w walutach.
 - Subfundusz stosuje zabezpieczenie ryzyka walutowego (związanego ze składnikami portfela bądź środkami pieniężnymi wyrażonymi w walutach innych niż złote) poprzez dokonywanie transakcji terminowej wymiany walut (FX Fwd)

po ustalonym kursie wymiany. Informacje na temat wartości i warunków tych zabezpieczeń przedstawione są w notcie 6 [instrumenty pochodne].

4) Ryzyko płynności, ryzyko braku możliwości zbycia według wartości godziwej

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.

5) Inne typowe klasy 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 przejęcia lub nacjonalizacji skutkujące utratą aktywów (całości lub części) w wyniku nacjonalizacji lub przejęcia w inny sposób zagranicznych aktywów Subfunduszu. Ryzyko to dotyczy zagranicznych składników lokat.
- Ryzyko transgraniczne polegające na wprowadzeniu ograniczeń w zakresie przepływów kapitału między państwami, w których znajdują się aktywa Subfunduszu, co może wpłynąć negatywnie na ich wartość. Ryzyko to związane jest z zagranicznymi składnikami lokat.

6) 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.

7) Informacje dot. zarządzania ryzykiem i metody pomiaru całkowitej ekspozycji

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**.

W dokumencie 'Inne informacje' dołączanym do rocznego sprawozdania finansowego ujawnia się także wartości ekspozycji, w tym dane wykorzystywane do obliczeń oraz najniższa, najwyższa i przeciętna wartość całkowitej ekspozycji w okresie sprawozdawczym.

Poza zgodnością z przepisami prawa oraz polityką inwestycyjną badana jest także zgodność wewnętrznych limitów – odrębnie dla każdego portfela lokat (funduszu, subfunduszu). Przyjęte metody oraz limity są zgodne z profilem ryzyka inwestycyjnego i polityką inwestycyjną.

Nota - 6 Instrumenty pochodne

Na dzień 31 grudnia 2020 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)

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych

strona 1 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCODNE	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					
1.	Forward Waluta CZK FWB01011 15.01.2021	-	Forward	IRH	-533	BNP PARIBAS	47 515 000	CZK	7 795 515	PLN	15.01.2021	47 515 000	CZK	7 795 515	PLN	15.01.2021	15.01.2021
2.	Forward Waluta CZK FWB01035 15.01.2021	-	Forward	IRH	-5	BNP PARIBAS	674 000	CZK	113 445	PLN	15.01.2021	674 000	CZK	113 445	PLN	15.01.2021	15.01.2021
3.	Forward Waluta CZK FWB01065 15.01.2021	-	Forward	IRH	-751	BNP PARIBAS	101 843 000	CZK	17 100 967	PLN	15.01.2021	101 843 000	CZK	17 100 967	PLN	15.01.2021	15.01.2021
4.	Forward Waluta CZK FWB01081 15.01.2021	-	Forward	IRH	-4	Bank Polska Kasa Opieki SA	565 000	CZK	95 323	PLN	15.01.2021	565 000	CZK	95 323	PLN	15.01.2021	15.01.2021
5.	Forward Waluta CZK FWB01085 15.01.2021	-	Forward	IRH	-554	Bank Polska Kasa Opieki SA	100 569 000	CZK	17 075 397	PLN	15.01.2021	100 569 000	CZK	17 075 397	PLN	15.01.2021	15.01.2021
6.	Forward Waluta CZK FWB01091 15.01.2021	-	Forward	IRH	0	Bank Polska Kasa Opieki SA	21 000	CZK	3 559	PLN	15.01.2021	21 000	CZK	3 559	PLN	15.01.2021	15.01.2021
7.	Forward Waluta EUR FWA12016 23.03.2021	-	Forward	IRH	-137	SOCIETE GENERALE PARIS	1 150 000	EUR	5 177 312	PLN	23.03.2021	1 150 000	EUR	5 177 312	PLN	23.03.2021	23.03.2021
8.	Forward Waluta EUR FWB01002 21.01.2021	-	Forward	IRH	-876	Bank Polska Kasa Opieki SA	12 000 000	EUR	54 517 200	PLN	21.01.2021	12 000 000	EUR	54 517 200	PLN	21.01.2021	21.01.2021
9.	Forward Waluta EUR FWB01112 14.01.2021	-	Forward	IRH	-1 259	Santander Bank Polska S.A.	11 053 000	EUR	49 755 411	PLN	14.01.2021	11 053 000	EUR	49 755 411	PLN	14.01.2021	14.01.2021
10.	Forward Waluta EUR FWB01141 14.01.2021	-	Forward	IRH	-22	Bank Polska Kasa Opieki SA	160 000	EUR	716 206	PLN	14.01.2021	160 000	EUR	716 206	PLN	14.01.2021	14.01.2021
11.	Forward Waluta EUR FWB01142 14.01.2021	-	Forward	IRH	-17	Bank Polska Kasa Opieki SA	130 000	EUR	582 619	PLN	14.01.2021	130 000	EUR	582 619	PLN	14.01.2021	14.01.2021
12.	Forward Waluta EUR FWB01162 14.01.2021	-	Forward	IRH	-2	Bank Polska Kasa Opieki SA	16 000	EUR	71 522	PLN	14.01.2021	16 000	EUR	71 522	PLN	14.01.2021	14.01.2021
13.	Forward Waluta EUR FWB01163 14.01.2021	-	Forward	IRH	-14	Bank Polska Kasa Opieki SA	100 000	EUR	447 335	PLN	14.01.2021	100 000	EUR	447 335	PLN	14.01.2021	14.01.2021
14.	Forward Waluta EUR FWB01198 14.01.2021	-	Forward	IRH	-47	Bank Polska Kasa Opieki SA	350 000	EUR	1 568 821	PLN	14.01.2021	350 000	EUR	1 568 821	PLN	14.01.2021	14.01.2021
15.	Forward Waluta EUR FWB01233 14.01.2021	-	Forward	IRH	218	Bank Polska Kasa Opieki SA	6 704 825	PLN	1 500 000	EUR	14.01.2021	6 704 825	PLN	1 500 000	EUR	14.01.2021	14.01.2021
16.	Forward Waluta EUR FWB01310 21.01.2021	-	Forward	IRH	-18	Bank Polska Kasa Opieki SA	100 000	EUR	443 579	PLN	21.01.2021	100 000	EUR	443 579	PLN	21.01.2021	21.01.2021
17.	Forward Waluta EUR FWB01323 21.01.2021	-	Forward	IRH	-47	Bank Polska Kasa Opieki SA	274 000	EUR	1 217 955	PLN	21.01.2021	274 000	EUR	1 217 955	PLN	21.01.2021	21.01.2021
18.	Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021	-	Forward	IRH	-404	Bank Polska Kasa Opieki SA	8 304 000	EUR	38 104 847	PLN	20.09.2021	8 304 000	EUR	38 104 847	PLN	20.09.2021	20.09.2021
19.	Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021	-	Forward	IRH	-585	Bank Polska Kasa Opieki SA	11 400 000	EUR	52 309 128	PLN	14.10.2021	11 400 000	EUR	52 309 128	PLN	14.10.2021	14.10.2021
20.	Forward Waluta EUR FWB01334 21.01.2021	-	Forward	IRH	-110	Bank Polska Kasa Opieki SA	1 096 000	EUR	4 949 648	PLN	21.01.2021	1 096 000	EUR	4 949 648	PLN	21.01.2021	21.01.2021
21.	Forward Waluta EUR FWB01343 21.01.2021	-	Forward	IRH	-23	Bank Polska Kasa Opieki SA	208 000	EUR	937 140	PLN	21.01.2021	208 000	EUR	937 140	PLN	21.01.2021	21.01.2021
22.	Forward Waluta EUR FWB01345 14.01.2021	-	Forward	IRH	-33	Bank Polska Kasa Opieki SA	280 000	EUR	1 258 964	PLN	14.01.2021	280 000	EUR	1 258 964	PLN	14.01.2021	14.01.2021
23.	Forward Waluta EUR FWB01350 21.01.2021	-	Forward	IRH	-17	Bank Polska Kasa Opieki SA	134 000	EUR	601 313	PLN	21.01.2021	134 000	EUR	601 313	PLN	21.01.2021	21.01.2021
24.	Forward Waluta EUR FWB01358 14.01.2021	-	Forward	IRH	-121	Bank Polska Kasa Opieki SA	1 200 000	EUR	5 417 850	PLN	14.01.2021	1 200 000	EUR	5 417 850	PLN	14.01.2021	14.01.2021
25.	Forward Waluta EUR FWB01373 14.01.2021	-	Forward	IRH	-52	Bank Polska Kasa Opieki SA	1 196 000	EUR	5 468 441	PLN	14.01.2021	1 196 000	EUR	5 468 441	PLN	14.01.2021	14.01.2021
26.	Forward Waluta EUR FWB01374 14.01.2021	-	Forward	IRH	-2	SOCIETE GENERALE PARIS	300 000	EUR	1 383 083	PLN	14.01.2021	300 000	EUR	1 383 083	PLN	14.01.2021	14.01.2021
27.	Forward Waluta HUF FWB01001 19.01.2021	-	Forward	IRH	-148	SOCIETE GENERALE PARIS	1 010 000 000	HUF	12 614 900	PLN	19.01.2021	1 010 000 000	HUF	12 614 900	PLN	19.01.2021	19.01.2021
28.	Forward Waluta HUF FWB01043 19.01.2021	-	Forward	IRH	-87	BNP PARIBAS	1 297 396 000	HUF	16 308 259	PLN	19.01.2021	1 297 396 000	HUF	16 308 259	PLN	19.01.2021	19.01.2021
29.	Forward Waluta HUF FWB01064 19.01.2021	-	Forward	IRH	0	Bank Polska Kasa Opieki SA	948 000	HUF	11 855	PLN	19.01.2021	948 000	HUF	11 855	PLN	19.01.2021	19.01.2021
30.	Forward Waluta USD FWB01292 28.01.2021	-	Forward	IRH	-1 028	Bank Polska Kasa Opieki SA	10 000 000	USD	36 549 750	PLN	28.01.2021	10 000 000	USD	36 549 750	PLN	28.01.2021	28.01.2021
31.	Forward Waluta USD FWB03008 18.03.2021	-	Forward	IRH	-2 755	Santander Bank Polska S.A.	27 117 000	USD	99 127 007	PLN	18.03.2021	27 117 000	USD	99 127 007	PLN	18.03.2021	18.03.2021
32.	Forward Waluta USD FWB01351 28.01.2021	-	Forward	IRH	-205	Santander Bank Polska S.A.	2 149 000	USD	7 870 820	PLN	28.01.2021	2 149 000	USD	7 870 820	PLN	28.01.2021	28.01.2021
33.	Forward Waluta USD FWB01384 28.01.2021	-	Forward	IRH	-1	Bank Polska Kasa Opieki SA	700 000	USD	2 629 200	PLN	28.01.2021	700 000	USD	2 629 200	PLN	28.01.2021	28.01.2021
34.	Interest Rate Sw ap CC21021 23.02.2021	Krótką	CIRS	IRH	-102 221	BNP PARIBAS	583 381 319	CZK			23.02.2021	580 000 000	CZK			23.02.2021	23.02.2021
35.	Interest Rate Sw ap CC21026 23.02.2021	Długa	CIRS	IRH	102 876	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			587 115 472	CZK	23.02.2021			580 000 000	CZK	23.02.2021	23.02.2021
36.	Interest Rate Sw ap CC23103 25.10.2023	Krótką	CIRS	IRH	-50 602	The Goldman Sachs Group Inc.	296 354 056	CZK			25.10.2023	296 700 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
37.	Interest Rate Sw ap CC23104 25.10.2023	Krótką	CIRS	IRH	-50 627	The Goldman Sachs Group Inc.	296 503 881	CZK			25.10.2023	296 850 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
38.	Interest Rate Sw ap CC250213 14.02.2025	Krótką	CIRS	IRH	-42 088	BNP PARIBAS	250 439 250	CZK			14.02.2025	250 000 000	CZK			14.02.2025	14.02.2025
39.	Interest Rate Sw ap CC25026 14.02.2025	Krótką	CIRS	IRH	-42 107	The Goldman Sachs Group Inc.	250 549 063	CZK			14.02.2025	250 000 000	CZK			14.02.2025	14.02.2025

OPIS 'CEL otwarcia pozycji'

IRH

Ograniczenie ryzyka w walutach swojego portfela papierów w wartościowych denominowanych w walutach obcych (RH)

ORI

Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w wartościowych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

strona 2 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---														
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania waluta	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania waluta	Termin zapadalności (wygasnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
						kwota	waluta	kwota	waluta							
40.	Interest Rate Sw ap CC23109 25.10.2023	Krótką	CIRS	IRH	-17 065	SOCIETE GENERALE PARIS	99 901 146	CZK			25.10.2023	100 000 000	CZK		25.10.2023	25.10.2023
41.	Interest Rate Sw ap CC250230 17.02.2025	Krótką	CIRS	IRH	-17 539	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	104 293 494	CZK			17.02.2025	100 000 000	CZK		17.02.2025	17.02.2025
42.	Interest Rate Sw ap CC270212 10.02.2027	Krótką	CIRS	IRH	-19 528	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	119 942 817	CZK			10.02.2027	120 000 000	CZK		10.02.2027	10.02.2027
43.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-10 047	SOCIETE GENERALE PARIS	2 139 419	EUR			09.07.2024	2 120 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
44.	Interest Rate Sw ap CC21096 20.09.2021	Krótką	CIRS	IRH	-18 498	SOCIETE GENERALE PARIS	3 993 418	EUR			20.09.2021	4 000 000	EUR		20.09.2021	20.09.2021
45.	Interest Rate Sw ap CC24075 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-16 912	SOCIETE GENERALE PARIS	3 601 133	EUR			09.07.2024	3 585 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
46.	Interest Rate Sw ap CC25014 20.01.2025	Krótką	CIRS	IRH	-12 445	SOCIETE GENERALE PARIS	2 644 235	EUR			20.01.2025	2 620 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
47.	Interest Rate Sw ap CC25093 09.09.2025	Krótką	CIRS	IRH	-15 177	The Goldman Sachs Group Inc.	3 217 676	EUR			09.09.2025	3 175 000	EUR		09.09.2025	09.09.2025
48.	Interest Rate Sw ap CC21116 26.11.2021	Krótką	CIRS	IRH	-4 810	JP Morgan Chase & Co	1 037 338	EUR			26.11.2021	1 039 000	EUR		26.11.2021	26.11.2021
49.	Interest Rate Sw ap CC220915 05.09.2022	Krótką	CIRS	IRH	-13 949	BNP PARIBAS	2 998 205	EUR			05.09.2022	3 000 000	EUR		05.09.2022	05.09.2022
50.	Interest Rate Sw ap CC24079 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-5 472	The Goldman Sachs Group Inc.	1 165 104	EUR			09.07.2024	1 160 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
51.	Interest Rate Sw ap CC25018 20.01.2025	Krótką	CIRS	IRH	-6 267	BNP PARIBAS	1 331 550	EUR			20.01.2025	1 320 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
52.	Interest Rate Sw ap CC21111 26.11.2021	Krótką	CIRS	IRH	-4 626	SOCIETE GENERALE PARIS	997 625	EUR			26.11.2021	1 000 000	EUR		26.11.2021	26.11.2021
53.	Interest Rate Sw ap CC240714 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-5 525	SOCIETE GENERALE PARIS	1 176 504	EUR			09.07.2024	1 175 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
54.	Interest Rate Sw ap CC240716 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-10 910	SOCIETE GENERALE PARIS	2 328 257	EUR			09.07.2024	2 330 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
55.	Interest Rate Sw ap CC250113 20.01.2025	Krótką	CIRS	IRH	-9 555	BNP PARIBAS	2 034 014	EUR			20.01.2025	1 610 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025
56.	Interest Rate Sw ap CC220941 05.09.2022	Krótką	CIRS	IRH	-9 226	Santander Bank Polska	1 997 447	EUR			05.09.2022	2 000 000	EUR		05.09.2022	05.09.2022
57.	Interest Rate Sw ap CC23014 19.01.2023	Krótką	CIRS	IRH	-50 830	BNP PARIBAS	10 899 700	EUR			19.01.2023	11 625 000	EUR		19.01.2023	19.01.2023
58.	Interest Rate Sw ap CC210311 23.03.2021	Krótką	CIRS	IRH	-29 991	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	6 491 355	EUR			23.03.2021	6 500 000	EUR		23.03.2021	23.03.2021
59.	Interest Rate Sw ap CC210312 23.03.2021	Krótką	CIRS	IRH	-46 001	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	9 956 500	EUR			23.03.2021	10 000 000	EUR		23.03.2021	23.03.2021
60.	Interest Rate Sw ap CC210322 23.03.2021	Krótką	CIRS	IRH	-29 069	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	6 291 621	EUR			23.03.2021	6 300 000	EUR		23.03.2021	23.03.2021
61.	Interest Rate Sw ap CC21101 14.10.2021	Krótką	CIRS	IRH	-9 224	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 590	EUR			14.10.2021	2 000 000	EUR		14.10.2021	14.10.2021
62.	Interest Rate Sw ap CC211212 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-9 234	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 905	EUR			20.12.2021	2 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
63.	Interest Rate Sw ap CC211214 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-9 233	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 586	EUR			20.12.2021	2 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
64.	Interest Rate Sw ap CC211215 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-13 850	SOCIETE GENERALE PARIS	2 985 948	EUR			20.12.2021	3 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
65.	Interest Rate Sw ap CC211216 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-13 851	SOCIETE GENERALE PARIS	2 986 179	EUR			20.12.2021	3 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
66.	Interest Rate Sw ap CC22011 18.01.2022	Krótką	CIRS	IRH	-4 600	SOCIETE GENERALE PARIS	995 085	EUR			18.01.2022	1 000 000	EUR		18.01.2022	18.01.2022
67.	Interest Rate Sw ap CC240722 09.07.2024	Krótką	CIRS	IRH	-30 420	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	6 593 061	EUR			09.07.2024	6 600 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024
68.	Interest Rate Sw ap CC210914 24.09.2021	Krótką	CIRS	IRH	-8 527	mBank SA	1 845 133	EUR			24.09.2021	1 850 000	EUR		24.09.2021	24.09.2021
69.	Interest Rate Sw ap CC211217 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	46 318	SOCIETE GENERALE PARIS			9 986 039	EUR			10 000 000	EUR	20.12.2021	20.12.2021
70.	Interest Rate Sw ap CC230611 07.06.2023	Krótką	CIRS	IRH	-9 229	BNP PARIBAS	1 991 600	EUR			07.06.2023	2 000 000	EUR		07.06.2023	07.06.2023
71.	Interest Rate Sw ap CC23069 07.06.2023	Krótką	CIRS	IRH	-5 775	SOCIETE GENERALE PARIS	1 245 288	EUR			07.06.2023	1 250 000	EUR		07.06.2023	07.06.2023
72.	Interest Rate Sw ap CC240133 15.01.2024	Krótką	CIRS	IRH	-14 099	BNP PARIBAS	3 038 686	EUR			15.01.2024	3 050 000	EUR		15.01.2024	15.01.2024
73.	Interest Rate Sw ap CC250215 10.02.2025	Krótką	CIRS	IRH	-23 539	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	5 000 000	EUR			10.02.2025	5 000 000	EUR		10.02.2025	10.02.2025
74.	Interest Rate Sw ap CC211220 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-4 611	SOCIETE GENERALE PARIS	994 177	EUR			20.12.2021	1 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
75.	Interest Rate Sw ap CC230711 07.07.2023	Krótką	CIRS	IRH	-60 773	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	13 000 000	EUR			07.07.2023	13 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023
76.	Interest Rate Sw ap CC230715 07.07.2023	Krótką	CIRS	IRH	-65 447	Santander Bank Polska	14 000 000	EUR			07.07.2023	14 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023
77.	Interest Rate Sw ap CC23078 07.07.2023	Krótką	CIRS	IRH	-46 748	SOCIETE GENERALE PARIS	10 000 000	EUR			07.07.2023	10 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023
78.	Interest Rate Sw ap CC211221 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-59 953	Santander Bank Polska	12 925 782	EUR			20.12.2021	13 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
79.	Interest Rate Sw ap CC211222 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-16 135	Santander Bank Polska	3 478 709	EUR			20.12.2021	3 500 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021
80.	Interest Rate Sw ap CC23015 19.01.2023	Krótką	CIRS	IRH	-15 168	SOCIETE GENERALE PARIS	3 278 821	EUR			19.01.2023	3 300 000	EUR		19.01.2023	19.01.2023
81.	Interest Rate Sw ap CC240134 05.01.2024	Krótką	CIRS	IRH	-25 227	Santander Bank Polska	5 463 700	EUR			05.01.2024	5 500 000	EUR		05.01.2024	05.01.2024
82.	Interest Rate Sw ap CC240135 05.01.2024	Krótką	CIRS	IRH	-27 583	Santander Bank Polska	5 963 322	EUR			05.01.2024	6 000 000	EUR		05.01.2024	05.01.2024
83.	Interest Rate Sw ap CC27105 08.10.2027	Krótką	CIRS	IRH	-4 530	SOCIETE GENERALE PARIS	993 590	EUR			08.10.2027	1 000 000	EUR		08.10.2027	08.10.2027
84.	Interest Rate Sw ap CC23083 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-12 654	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 020 381 370	HUF			23.08.2023	1 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' IRH Ograniczenie ryzyka w alutowego portfela papierów w wartościach denominowanych w walutach obcych (IRH)
 ORI Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w wartościach

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

strona 3 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartą pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Termin zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta								
85.	Interest Rate Sw ap CC23085 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-15 008	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1 210 220 945	HUF			23.08.2023	1 192 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
86.	Interest Rate Sw ap CC23088 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-12 743	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1 027 573 878	HUF			23.08.2023	1 013 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
87.	Interest Rate Sw ap CC22083 24.08.2022	Krótką	CIRS	IRH	-12 619	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 006 200 000	HUF			24.08.2022	1 000 000 000	HUF			24.08.2022	24.08.2022
88.	Interest Rate Sw ap CC22101 26.10.2022	Krótką	CIRS	IRH	-25 188	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 008 400 000	HUF			26.10.2022	2 000 000 000	HUF			26.10.2022	26.10.2022
89.	Interest Rate Sw ap CC230811 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-25 300	SOCIETE GENERALE PARIS	2 040 461 705	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
90.	Interest Rate Sw ap CC230815 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-12 650	SOCIETE GENERALE PARIS	1 020 230 853	HUF			23.08.2023	1 000 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
91.	Interest Rate Sw ap CC230818 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-25 300	SOCIETE GENERALE PARIS	2 040 461 705	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
92.	Interest Rate Sw ap CC230821 23.08.2023	Krótką	CIRS	IRH	-25 300	BNP PARIBAS	2 040 461 705	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF			23.08.2023	23.08.2023
93.	Interest Rate Sw ap CC21021 23.02.2021	Długa	CIRS	IRH	96 532	BNP PARIBAS			96 556 134	PLN	23.02.2021			96 425 603	PLN	23.02.2021	23.02.2021
94.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	9 133	SOCIETE GENERALE PARIS			9 264 244	PLN	09.07.2024			9 120 240	PLN	09.07.2024	09.07.2024
95.	Interest Rate Sw ap CC21096 20.09.2021	Długa	CIRS	IRH	17 251	SOCIETE GENERALE PARIS			17 269 164	PLN	20.09.2021			17 236 000	PLN	20.09.2021	20.09.2021
96.	Interest Rate Sw ap CC24075 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	15 769	SOCIETE GENERALE PARIS			15 995 751	PLN	09.07.2024			15 747 113	PLN	09.07.2024	09.07.2024
97.	Interest Rate Sw ap CC25014 20.01.2025	Długa	CIRS	IRH	11 509	SOCIETE GENERALE PARIS			11 732 238	PLN	20.01.2025			11 493 940	PLN	20.01.2025	20.01.2025
98.	Interest Rate Sw ap CC25093 09.09.2025	Długa	CIRS	IRH	13 539	The Goldman Sachs Group Inc.			13 903 348	PLN	09.09.2025			13 525 500	PLN	09.09.2025	09.09.2025
99.	Interest Rate Sw ap CC21116 26.11.2021	Długa	CIRS	IRH	4 459	JP Morgan Chase & Co			4 464 395	PLN	26.11.2021			4 456 271	PLN	26.11.2021	26.11.2021
100.	Interest Rate Sw ap CC220915 05.09.2022	Długa	CIRS	IRH	12 873	BNP PARIBAS			12 909 431	PLN	05.09.2022			12 870 000	PLN	05.09.2022	05.09.2022
101.	Interest Rate Sw ap CC24079 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	4 981	The Goldman Sachs Group Inc.			5 052 537	PLN	09.07.2024			4 974 000	PLN	09.07.2024	09.07.2024
102.	Interest Rate Sw ap CC25018 20.01.2025	Długa	CIRS	IRH	5 722	BNP PARIBAS			5 832 751	PLN	20.01.2025			5 714 280	PLN	20.01.2025	20.01.2025
103.	Interest Rate Sw ap CC21111 26.11.2021	Długa	CIRS	IRH	4 288	SOCIETE GENERALE PARIS			4 293 313	PLN	26.11.2021			4 285 500	PLN	26.11.2021	26.11.2021
104.	Interest Rate Sw ap CC240714 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	5 056	SOCIETE GENERALE PARIS			5 128 696	PLN	09.07.2024			5 048 975	PLN	09.07.2024	09.07.2024
105.	Interest Rate Sw ap CC240716 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	10 025	SOCIETE GENERALE PARIS			10 168 911	PLN	09.07.2024			10 010 845	PLN	09.07.2024	09.07.2024
106.	Interest Rate Sw ap CC250113 20.01.2025	Długa	CIRS	IRH	8 569	BNP PARIBAS			8 713 408	PLN	20.01.2025			8 609 315	PLN	20.01.2025	20.01.2025
107.	Interest Rate Sw ap CC21026 23.02.2021	Krótką	CIRS	IRH	-97 315	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	97 339 590	PLN			23.02.2021	97 208 000	PLN			23.02.2021	23.02.2021
108.	Interest Rate Sw ap CC220941 05.09.2022	Długa	CIRS	IRH	8 723	Santander Bank Polska			8 747 476	PLN	05.09.2022			8 716 966	PLN	05.09.2022	05.09.2022
109.	Interest Rate Sw ap CC23014 19.01.2023	Długa	CIRS	IRH	50 278	BNP PARIBAS			50 501 936	PLN	19.01.2023			50 220 000	PLN	19.01.2023	19.01.2023
110.	Interest Rate Sw ap CC210311 23.03.2021	Długa	CIRS	IRH	27 802	BANK POLSKA KASA OPIEKI SA			27 814 217	PLN	23.03.2021			27 794 000	PLN	23.03.2021	23.03.2021
111.	Interest Rate Sw ap CC210312 23.03.2021	Długa	CIRS	IRH	42 794	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA			42 812 127	PLN	23.03.2021			42 757 000	PLN	23.03.2021	23.03.2021
112.	Interest Rate Sw ap CC210322 23.03.2021	Długa	CIRS	IRH	26 840	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			26 851 042	PLN	23.03.2021			26 828 550	PLN	23.03.2021	23.03.2021
113.	Interest Rate Sw ap CC21101 14.10.2021	Długa	CIRS	IRH	8 653	SOCIETE GENERALE PARIS			8 663 172	PLN	14.10.2021			8 647 400	PLN	14.10.2021	14.10.2021
114.	Interest Rate Sw ap CC211212 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	8 576	SOCIETE GENERALE PARIS			8 587 646	PLN	20.12.2021			8 572 000	PLN	20.12.2021	20.12.2021
115.	Interest Rate Sw ap CC211214 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	8 596	SOCIETE GENERALE PARIS			8 607 683	PLN	20.12.2021			8 592 000	PLN	20.12.2021	20.12.2021
116.	Interest Rate Sw ap CC211215 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	12 903	SOCIETE GENERALE PARIS			12 920 541	PLN	20.12.2021			12 897 000	PLN	20.12.2021	20.12.2021
117.	Interest Rate Sw ap CC211216 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	12 840	SOCIETE GENERALE PARIS			12 857 426	PLN	20.12.2021			12 834 000	PLN	20.12.2021	20.12.2021
118.	Interest Rate Sw ap CC22011 18.01.2022	Długa	CIRS	IRH	4 329	SOCIETE GENERALE PARIS			4 335 683	PLN	18.01.2022			4 323 700	PLN	18.01.2022	18.01.2022
119.	Interest Rate Sw ap CC240722 09.07.2024	Długa	CIRS	IRH	28 348	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			28 753 708	PLN	09.07.2024			28 149 000	PLN	09.07.2024	09.07.2024
120.	Interest Rate Sw ap CC210914 24.09.2021	Długa	CIRS	IRH	8 430	mBank SA			8 438 667	PLN	24.09.2021			8 436 000	PLN	24.09.2021	24.09.2021
121.	Interest Rate Sw ap CC211217 20.12.2021	Krótką	CIRS	IRH	-46 022	SOCIETE GENERALE PARIS	46 083 963	PLN			20.12.2021	46 000 000	PLN			20.12.2021	20.12.2021
122.	Interest Rate Sw ap CC230611 07.06.2023	Długa	CIRS	IRH	9 142	BNP PARIBAS			9 201 459	PLN	07.06.2023			9 137 000	PLN	07.06.2023	07.06.2023
123.	Interest Rate Sw ap CC23069 07.06.2023	Długa	CIRS	IRH	5 682	SOCIETE GENERALE PARIS			5 718 812	PLN	07.06.2023			5 678 750	PLN	07.06.2023	07.06.2023
124.	Interest Rate Sw ap CC23083 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	13 028	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			13 128 014	PLN	23.08.2023			13 024 225	PLN	23.08.2023	23.08.2023
125.	Interest Rate Sw ap CC23085 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	15 179	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA			15 295 238	PLN	23.08.2023			15 162 240	PLN	23.08.2023	23.08.2023
126.	Interest Rate Sw ap CC23088 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	13 011	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA			13 110 571	PLN	23.08.2023			13 006 920	PLN	23.08.2023	23.08.2023
127.	Interest Rate Sw ap CC23103 25.10.2023	Długa	CIRS	IRH	48 902	The Goldman Sachs Group Inc.			49 322 866	PLN	25.10.2023			48 879 736	PLN	25.10.2023	25.10.2023
128.	Interest Rate Sw ap CC23104 25.10.2023	Długa	CIRS	IRH	49 008	The Goldman Sachs Group Inc.			49 429 234	PLN	25.10.2023			48 985 149	PLN	25.10.2023	25.10.2023
129.	Interest Rate Sw ap CC240133 15.01.2024	Długa	CIRS	IRH	13 874	BNP PARIBAS			14 011 247	PLN	15.01.2024			13 854 630	PLN	15.01.2024	15.01.2024

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' IRH Ograniczenie ryzyka w walutach tego portfela papierów w walutach obcych denominowanych w walutach obcych (IRH)
 ORI Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w walutach obcych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

strona 4 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---															
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 zapadłości (wygasnięcia) instrumenta pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta								
130.	Interest Rate Sw ap CC250213 14.02.2025	Długa	CIRS	IRH	41 181	BNP PARIBAS			42 012 171	PLN	14.02.2025			41 167 172	PLN	14.02.2025	14.02.2025
131.	Interest Rate Sw ap CC250215 10.02.2025	Długa	CIRS	IRH	22 879	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			23 330 558	PLN	10.02.2025			22 310 000	PLN	10.02.2025	10.02.2025
132.	Interest Rate Sw ap CC250226 14.02.2025	Długa	CIRS	IRH	41 200	The Goldman Sachs Group Inc.			42 031 551	PLN	14.02.2025			41 186 161	PLN	14.02.2025	14.02.2025
133.	Interest Rate Sw ap CC211220 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	4 453	SOCIETE GENERALE PARIS			4 458 925	PLN	20.12.2021			4 452 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
134.	Interest Rate Sw ap CC22083 24.08.2022	Długa	CIRS	IRH	12 678	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			12 712 246	PLN	24.08.2022			12 674 271	PLN	24.08.2022	24.08.2022
135.	Interest Rate Sw ap CC22101 26.10.2022	Długa	CIRS	IRH	25 280	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			25 366 811	PLN	26.10.2022			25 268 478	PLN	26.10.2022	26.10.2022
136.	Interest Rate Sw ap CC230711 07.07.2023	Długa	CIRS	IRH	59 097	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			59 505 016	PLN	07.07.2023			58 116 500	PLN	07.07.2023	07.07.2023
137.	Interest Rate Sw ap CC230715 07.07.2023	Długa	CIRS	IRH	62 957	Santander Bank Polska			63 391 070	PLN	07.07.2023			61 880 000	PLN	07.07.2023	07.07.2023
138.	Interest Rate Sw ap CC23078 07.07.2023	Długa	CIRS	IRH	45 428	SOCIETE GENERALE PARIS			45 741 382	PLN	07.07.2023			44 675 000	PLN	07.07.2023	07.07.2023
139.	Interest Rate Sw ap CC230811 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	25 640	SOCIETE GENERALE PARIS			25 836 272	PLN	23.08.2023			25 520 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
140.	Interest Rate Sw ap CC230815 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	12 501	SOCIETE GENERALE PARIS			12 596 510	PLN	23.08.2023			12 444 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
141.	Interest Rate Sw ap CC230818 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	24 995	SOCIETE GENERALE PARIS			25 186 181	PLN	23.08.2023			24 888 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
142.	Interest Rate Sw ap CC230821 23.08.2023	Długa	CIRS	IRH	24 873	BNP PARIBAS			25 063 015	PLN	23.08.2023			24 789 178	PLN	23.08.2023	23.08.2023
143.	Interest Rate Sw ap CC211221 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	58 265	Santander Bank Polska			58 343 573	PLN	20.12.2021			58 259 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
144.	Interest Rate Sw ap CC211222 20.12.2021	Długa	CIRS	IRH	16 154	Santander Bank Polska			16 175 809	PLN	20.12.2021			16 152 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
145.	Interest Rate Sw ap CC23015 19.01.2023	Długa	CIRS	IRH	14 791	SOCIETE GENERALE PARIS			14 857 009	PLN	19.01.2023			14 784 000	PLN	19.01.2023	19.01.2023
146.	Interest Rate Sw ap CC23109 25.10.2023	Długa	CIRS	IRH	16 987	SOCIETE GENERALE PARIS			17 132 661	PLN	25.10.2023			16 980 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
147.	Interest Rate Sw ap CC240134 05.01.2024	Długa	CIRS	IRH	24 703	Santander Bank Polska			24 941 827	PLN	05.01.2024			24 689 500	PLN	05.01.2024	05.01.2024
148.	Interest Rate Sw ap CC240135 05.01.2024	Długa	CIRS	IRH	26 863	Santander Bank Polska			27 130 117	PLN	05.01.2024			26 856 000	PLN	05.01.2024	05.01.2024
149.	Interest Rate Sw ap CC250230 17.02.2025	Długa	CIRS	IRH	17 228	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			17 572 135	PLN	17.02.2025			16 846 361	PLN	17.02.2025	17.02.2025
150.	Interest Rate Sw ap CC270212 10.11.2026	Długa	CIRS	IRH	20 007	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			20 916 029	PLN	10.11.2026			20 000 000	PLN	10.11.2026	10.11.2026
151.	Interest Rate Sw ap CC27105 08.10.2027	Długa	CIRS	IRH	4 585	SOCIETE GENERALE PARIS			220 376	PLN	08.10.2027			4 583 000	PLN	08.10.2027	08.10.2027
152.	Interest Rate Sw ap CC22110R 28.11.2022	-	IRS	IRH	-37	J.P. MORGAN AG	1 362 126	CZK	1 148 833	CZK	28.11.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	28.11.2022	28.11.2022
153.	Interest Rate Sw ap C22114R 16.12.2025	-	IRS	IRH	-63	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 347 937	CZK	986 167	CZK	16.12.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	16.12.2025	16.12.2025
154.	Interest Rate Sw ap C22118R 20.11.2022	-	IRS	IRH	-61	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 346 706	CZK	994 972	CZK	20.11.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	20.11.2022	20.11.2022
155.	Interest Rate Sw ap C221211R 12.12.2022	-	IRS	IRH	-9	J.P. MORGAN AG	1 384 105	CZK	1 330 014	CZK	12.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	12.12.2022	12.12.2022
156.	Interest Rate Sw ap C22124R 05.12.2022	-	IRS	IRH	-15	J.P. MORGAN AG	1 376 175	CZK	1 291 167	CZK	05.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	05.12.2022	05.12.2022
157.	Interest Rate Sw ap C250225R 14.02.2025	-	IRS	IRH	333	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 364 000	CZK	4 312 174	CZK	14.02.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	14.02.2025	14.02.2025
158.	Interest Rate Sw ap C221214R 23.12.2022	-	IRS	IRH	-5	J.P. MORGAN AG	1 397 284	CZK	1 368 750	CZK	23.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	23.12.2022	23.12.2022
159.	Interest Rate Sw ap C211115R 26.11.2021	-	IRS	IRH	5	BNP PARIBAS	8 864	EUR	9 903	EUR	26.11.2021	1 700 000	EUR	1 700 000	EUR	26.11.2021	26.11.2021
160.	Interest Rate Sw ap C220936R 05.09.2022	-	IRS	IRH	1	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	20 351	EUR	20 234	EUR	05.09.2022	2 000 000	EUR	2 000 000	EUR	05.09.2022	05.09.2022
161.	Interest Rate Sw ap C23012R 19.01.2023	-	IRS	IRH	124	SOCIETE GENERALE PARIS	123 606	EUR	148 602	EUR	19.01.2023	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	19.01.2023	19.01.2023
162.	Interest Rate Sw ap C240719R 09.07.2024	-	IRS	IRH	-273	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	103 691	EUR	46 200	EUR	09.07.2024	5 500 000	EUR	5 500 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024
163.	Interest Rate Sw ap C21067R 30.06.2021	-	IRS	IRH	15	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	8 281	EUR	11 529	EUR	30.06.2021	3 150 000	EUR	3 150 000	EUR	30.06.2021	30.06.2021
164.	Interest Rate Sw ap C210614R 30.06.2021	-	IRS	IRH	125	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	66 879	EUR	93 500	EUR	30.06.2021	25 000 000	EUR	25 000 000	EUR	30.06.2021	30.06.2021
165.	Interest Rate Sw ap C22123R 05.12.2022	-	IRS	IRH	1	BNP PARIBAS	51 894	EUR	52 352	EUR	05.12.2022	5 000 000	EUR	5 000 000	EUR	05.12.2022	05.12.2022
166.	Interest Rate Sw ap C22127R 07.12.2022	-	IRS	IRH	1	J.P. MORGAN AG	104 527	EUR	103 400	EUR	07.12.2022	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	07.12.2022	07.12.2022
167.	Interest Rate Sw ap C230613R 07.06.2023	-	IRS	IRH	1	J.P. MORGAN AG	12 874	EUR	12 975	EUR	07.06.2023	1 000 000	EUR	1 000 000	EUR	07.06.2023	07.06.2023
168.	Interest Rate Sw ap C23128R 11.12.2023	-	IRS	IRH	15	SOCIETE GENERALE PARIS	76 550	EUR	79 950	EUR	11.12.2023	5 000 000	EUR	5 000 000	EUR	11.12.2023	11.12.2023
169.	Interest Rate Sw ap C25062R 24.06.2025	-	IRS	IRH	2	J.P. MORGAN AG	52 186	EUR	53 773	EUR	24.06.2025	2 500 000	EUR	2 500 000	EUR	24.06.2025	24.06.2025
170.	Interest Rate Sw ap C210410R 19.04.2021	-	IRS	IRH	-29	SOCIETE GENERALE PARIS	10 356 438	HUF	8 088 889	HUF	19.04.2021	2 000 000 000	HUF	2 000 000 000	HUF	19.04.2021	19.04.2021
171.	Interest Rate Sw ap C210419R 21.04.2021	-	IRS	IRH	-61	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	10 464 822	HUF	5 612 007	HUF	21.04.2021	1 300 000 000	HUF	1 300 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
172.	Interest Rate Sw ap C210420R 21.04.2021	-	IRS	IRH	-49	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	7 835 616	HUF	3 938 348	HUF	21.04.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
173.	Interest Rate Sw ap C21053R 14.05.2021	-	IRS	IRH	-31	BNP PARIBAS	6 400 000	HUF	3 928 056	HUF	14.05.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	14.05.2021	14.05.2021
174.	Interest Rate Sw ap C21054R 17.05.2021	-	IRS	IRH	-29	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	6 284 247	HUF	3 993 889	HUF	17.05.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	17.05.2021	17.05.2021

OPIS 'CEL otwarcia pozycji'
 IRH
 ORI

Ograniczenie ryzyka w walutowego portfela papierów wartościowych denominowanych w walutach obcych (IRH)
 Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów wartościowych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

strona 5 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania		Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania		Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
175.	Interest Rate Sw ap C210433R 19.04.2021	-	IRS	IRH	87	BNP PARIBAS	8 088 889	HUF	14 958 904	HUF	19.04.2021	2 000 000 000	HUF	2 000 000 000	HUF	19.04.2021	19.04.2021
176.	Interest Rate Sw ap C210440R 21.04.2021	-	IRS	IRH	39	BNP PARIBAS	4 044 444	HUF	7 100 000	HUF	21.04.2021	1 000 000 000	HUF	1 000 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
177.	Interest Rate Sw ap C210440R 21.04.2021	-	IRS	IRH	144	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	13 346 667	HUF	24 750 000	HUF	21.04.2021	3 300 000 000	HUF	3 300 000 000	HUF	21.04.2021	21.04.2021
178.	Interest Rate Sw ap IR230114R 25.01.2023	-	IRS	IRH	-2 044	SOCIETE GENERALE PARIS	2 281 973	PLN	234 178	PLN	25.01.2023	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
179.	Interest Rate Sw ap IR23013R 25.01.2023	-	IRS	IRH	-3 600	ING BANK SŁĄSKI SA	4 016 512	PLN	409 811	PLN	25.01.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
180.	Interest Rate Sw ap IR24047R 25.04.2024	-	IRS	IRH	-3 921	The Goldman Sachs Group Inc.	4 728 731	PLN	788 680	PLN	25.04.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
181.	Interest Rate Sw ap IR25077R 25.07.2025	-	IRS	IRH	-2 988	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	4 030 223	PLN	1 016 289	PLN	25.07.2025	38 000 000	PLN	38 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
182.	Interest Rate Sw ap IR26075R 27.07.2026	-	IRS	IRH	-1 362	Santander Bank Polska	1 970 611	PLN	592 157	PLN	27.07.2026	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	27.07.2026	27.07.2026
183.	Interest Rate Sw ap IR21078R 26.07.2021	-	IRS	IRH	-768	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	877 793	PLN	109 013	PLN	26.07.2021	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
184.	Interest Rate Sw ap IR28042R 25.04.2028	-	IRS	IRH	5 702	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2 866 479	PLN	8 673 671	PLN	25.04.2028	45 000 000	PLN	45 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
185.	Interest Rate Sw ap IR210713R 26.07.2021	-	IRS	IRH	635	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	86 349	PLN	722 167	PLN	26.07.2021	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
186.	Interest Rate Sw ap IR260712R 27.07.2026	-	IRS	IRH	1 111	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	592 237	PLN	1 715 962	PLN	27.07.2026	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	27.07.2026	27.07.2026
187.	Interest Rate Sw ap IR21093R 10.09.2021	-	IRS	IRH	-154	BNP PARIBAS	173 853	PLN	20 163	PLN	10.09.2021	10 000 000	PLN	10 000 000	PLN	10.09.2021	10.09.2021
188.	Interest Rate Sw ap IR220211R 14.02.2022	-	IRS	IRH	-1 448	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 583 151	PLN	132 490	PLN	14.02.2022	100 000 000	PLN	100 000 000	PLN	14.02.2022	14.02.2022
189.	Interest Rate Sw ap IR22027R 07.02.2022	-	IRS	IRH	-2 662	ING BANK SŁĄSKI SA	2 880 399	PLN	216 371	PLN	07.02.2022	80 000 000	PLN	80 000 000	PLN	07.02.2022	07.02.2022
190.	Interest Rate Sw ap IR230132R 25.01.2023	-	IRS	IRH	-2 806	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA	3 205 280	PLN	393 588	PLN	25.01.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
191.	Interest Rate Sw ap IR230135R 25.01.2023	-	IRS	IRH	-1 664	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 960 429	PLN	292 722	PLN	25.01.2023	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
192.	Interest Rate Sw ap IR230137R 25.01.2023	-	IRS	IRH	-1 700	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 996 599	PLN	292 722	PLN	25.01.2023	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
193.	Interest Rate Sw ap IR231011R 25.10.2023	-	IRS	IRH	962	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	648 949	PLN	1 615 253	PLN	25.10.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
194.	Interest Rate Sw ap IR23108R 25.10.2023	-	IRS	IRH	-2 654	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	3 314 415	PLN	648 949	PLN	25.10.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
195.	Interest Rate Sw ap IR241026R 25.10.2024	-	IRS	IRH	-859	mBank SA	1 309 105	PLN	444 136	PLN	25.10.2024	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.10.2024	25.10.2024
196.	Interest Rate Sw ap IR27021R 04.02.2027	-	IRS	IRH	-1 242	BNP PARIBAS	1 953 071	PLN	696 949	PLN	04.02.2027	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	04.02.2027	04.02.2027
197.	Interest Rate Sw ap IR27072R 26.07.2027	-	IRS	IRH	-642	mBank SA	2 770 447	PLN	2 132 533	PLN	26.07.2027	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	26.07.2027	26.07.2027
198.	Interest Rate Sw ap IR210411R 29.04.2021	-	IRS	IRH	-68	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	98 817	PLN	31 130	PLN	29.04.2021	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	29.04.2021	29.04.2021
199.	Interest Rate Sw ap IR21094R 10.09.2021	-	IRS	IRH	-66	BNP PARIBAS	151 072	PLN	84 683	PLN	10.09.2021	42 000 000	PLN	42 000 000	PLN	10.09.2021	10.09.2021
200.	Interest Rate Sw ap IR241030R 25.10.2024	-	IRS	IRH	17	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	355 309	PLN	371 746	PLN	25.10.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.10.2024	25.10.2024
201.	Interest Rate Sw ap IR25033R 31.03.2025	-	IRS	IRH	-185	Bank Polska Kasa Opeki SA	634 458	PLN	449 653	PLN	31.03.2025	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	31.03.2025	31.03.2025
202.	Interest Rate Sw ap IR250716R 25.07.2025	-	IRS	IRH	281	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 016 289	PLN	1 295 971	PLN	25.07.2025	38 000 000	PLN	38 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
203.	Interest Rate Sw ap IR270410R 27.04.2027	-	IRS	IRH	-80	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 543 275	PLN	1 473 855	PLN	27.04.2027	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
204.	Interest Rate Sw ap IR270411R 27.04.2027	-	IRS	IRH	-101	Santander Bank Polska S.A.	1 564 130	PLN	1 473 855	PLN	27.04.2027	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
205.	Interest Rate Sw ap IR270416R 27.04.2027	-	IRS	IRH	-10	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 446 618	PLN	2 456 425	PLN	27.04.2027	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
206.	Interest Rate Sw ap IR27044R 27.04.2027	-	IRS	IRH	-64	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	2 500 857	PLN	2 456 425	PLN	27.04.2027	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
207.	Interest Rate Sw ap IR27063R 07.06.2027	-	IRS	IRH	51	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 202 518	PLN	1 265 188	PLN	07.06.2027	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	07.06.2027	07.06.2027
208.	Interest Rate Sw ap IR27065R 07.06.2027	-	IRS	IRH	78	ING BANK SŁĄSKI SA	1 676 768	PLN	1 771 263	PLN	07.06.2027	35 000 000	PLN	35 000 000	PLN	07.06.2027	07.06.2027
209.	Interest Rate Sw ap IR300610R 05.06.2030	-	IRS	IRH	644	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	3 222 671	PLN	3 946 844	PLN	05.06.2030	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
210.	Interest Rate Sw ap IR30062R 05.06.2030	-	IRS	IRH	235	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 701 665	PLN	1 973 422	PLN	05.06.2030	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
211.	Interest Rate Sw ap IR30064R 05.06.2030	-	IRS	IRH	240	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 695 687	PLN	1 973 422	PLN	05.06.2030	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
212.	Interest Rate Sw ap IR250313R 31.03.2025	-	IRS	IRH	172	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	449 653	PLN	622 057	PLN	31.03.2025	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	31.03.2025	31.03.2025
213.	Interest Rate Sw ap IR280431R 25.04.2028	-	IRS	IRH	-97	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 361 574	PLN	1 273 990	PLN	25.04.2028	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
214.	Interest Rate Sw ap IR280436R 25.04.2028	-	IRS	IRH	95	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 480 308	PLN	1 592 488	PLN	25.04.2028	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
215.	Interest Rate Sw ap IR300615R 05.06.2030	-	IRS	IRH	180	BANK POLSKA KASA OPEKI SA	786 322	PLN	986 711	PLN	05.06.2030	10 000 000	PLN	10 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
216.	Interest Rate Sw ap IR300622R 05.06.2030	-	IRS	IRH	155	Santander Bank Polska	1 299 006	PLN	1 480 067	PLN	05.06.2030	15 000 000	PLN	15 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
217.	Interest Rate Sw ap IR21114R 08.11.2021	-	IRS	IRH	29	ING BANK SŁĄSKI SA	130 658	PLN	159 599	PLN	08.11.2021	100 000 000	PLN	100 000 000	PLN	08.11.2021	08.11.2021
218.	Interest Rate Sw ap IR240433R 25.04.2024	-	IRS	IRH	-52	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	640 535	PLN	588 552	PLN	25.04.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
219.	Interest Rate Sw ap IR240517R 27.05.2024	-	IRS	IRH	20	POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI SA	829 224	PLN	847 844	PLN	27.05.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' IRH Ograniczenie ryzyka w alutowego portfela papierów w artosiowych denominowanych w walutach obcych (IRH)
 ORI Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w artosiowych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

strona 6 Tabela N-6		31.12.2020 --- 249 pozycji ---															
NOTA-6 INSTRUMENTY POCHODNE	Typ zajętej pozycji	Rodzaj instrumentu pochodnego	Cel otwarcia pozycji	Wartość otwartej pozycji	Kontrahent	Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do wykonania		Wartość przyszłych strumieni pieniężnych do otrzymania		Terminy przyszłych strumieni pieniężnych	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Termin zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
220.	Interest Rate Sw ap IR240524R 27.05.2024	-	IRS	IRH	75	ING BANK SŁĄSKI SA	678 022	PLN	752 739	PLN	27.05.2024	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
221.	Interest Rate Sw ap IR240529R 27.05.2024	-	IRS	IRH	141	J.P. MORGAN AG	687 228	PLN	827 797	PLN	27.05.2024	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
222.	Interest Rate Sw ap CI23033R 17.03.2023	-	IRS	IRH	-583	The Goldman Sachs Group Inc.	166 348	USD	10 949	USD	17.03.2023	2 300 000	USD	2 300 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
223.	Interest Rate Sw ap CI22031R 23.03.2022	-	IRS	IRH	-482	SOCIETE GENERALE PARIS	135 990	USD	7 469	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
224.	Interest Rate Sw ap CI220926R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-123	The Goldman Sachs Group Inc.	36 419	USD	3 531	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
225.	Interest Rate Sw ap CI220928R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-100	The Goldman Sachs Group Inc.	30 136	USD	3 531	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
226.	Interest Rate Sw ap CI220932R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-301	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	90 947	USD	10 594	USD	26.09.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
227.	Interest Rate Sw ap CI260415R 06.04.2026	-	IRS	IRH	-818	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	418 231	USD	197 877	USD	06.04.2026	10 000 000	USD	10 000 000	USD	06.04.2026	06.04.2026
228.	Interest Rate Sw ap CI220950R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-187	BNP PARIBAS	56 652	USD	6 710	USD	26.09.2022	1 900 000	USD	1 900 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
229.	Interest Rate Sw ap CI220951R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-204	The Goldman Sachs Group Inc.	61 429	USD	7 063	USD	26.09.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
230.	Interest Rate Sw ap CI230319R 17.03.2023	-	IRS	IRH	-545	The Goldman Sachs Group Inc.	164 500	USD	19 042	USD	17.03.2023	4 000 000	USD	4 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
231.	Interest Rate Sw ap CI230322R 17.03.2023	-	IRS	IRH	-410	The Goldman Sachs Group Inc.	123 750	USD	14 281	USD	17.03.2023	3 000 000	USD	3 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
232.	Interest Rate Sw ap CI210323R 29.03.2021	-	IRS	IRH	-189	SOCIETE GENERALE PARIS	56 500	USD	6 275	USD	29.03.2021	10 000 000	USD	10 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
233.	Interest Rate Sw ap CI210327R 29.03.2021	-	IRS	IRH	-76	SOCIETE GENERALE PARIS	23 250	USD	3 138	USD	29.03.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
234.	Interest Rate Sw ap CI210330R 29.03.2021	-	IRS	IRH	-78	BNP PARIBAS	23 875	USD	3 138	USD	29.03.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
235.	Interest Rate Sw ap CI210333R 24.03.2021	-	IRS	IRH	-25	The Goldman Sachs Group Inc.	8 250	USD	1 488	USD	24.03.2021	2 500 000	USD	2 500 000	USD	24.03.2021	24.03.2021
236.	Interest Rate Sw ap CI210450R 26.04.2021	-	IRS	IRH	-85	BNP PARIBAS	27 750	USD	5 205	USD	26.04.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	26.04.2021	26.04.2021
237.	Interest Rate Sw ap CI220354R 23.03.2022	-	IRS	IRH	52	SOCIETE GENERALE PARIS	7 469	USD	21 375	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
238.	Interest Rate Sw ap CI220953R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-225	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	70 309	USD	10 418	USD	26.09.2022	2 950 000	USD	2 950 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
239.	Interest Rate Sw ap CI220957R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-82	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	28 979	USD	7 063	USD	26.09.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
240.	Interest Rate Sw ap CI230326R 17.03.2023	-	IRS	IRH	-361	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	120 188	USD	23 802	USD	17.03.2023	5 000 000	USD	5 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
241.	Interest Rate Sw ap CI210335R 24.03.2021	-	IRS	IRH	-11	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	4 635	USD	1 786	USD	24.03.2021	3 000 000	USD	3 000 000	USD	24.03.2021	24.03.2021
242.	Interest Rate Sw ap CI210336R 29.03.2021	-	IRS	IRH	-14	SOCIETE GENERALE PARIS	6 240	USD	2 510	USD	29.03.2021	4 000 000	USD	4 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
243.	Interest Rate Sw ap CI210340R 24.03.2021	-	IRS	IRH	-17	The Goldman Sachs Group Inc.	7 531	USD	2 977	USD	24.03.2021	5 000 000	USD	5 000 000	USD	24.03.2021	24.03.2021
244.	Interest Rate Sw ap CI210341R 29.03.2021	-	IRS	IRH	-50	J.P. Morga	23 280	USD	10 040	USD	29.03.2021	16 000 000	USD	16 000 000	USD	29.03.2021	29.03.2021
245.	Interest Rate Sw ap CI220415R 04.04.2022	-	IRS	IRH	-13	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	15 020	USD	11 652	USD	04.04.2022	3 800 000	USD	3 800 000	USD	04.04.2022	04.04.2022
246.	Interest Rate Sw ap CI220958R 26.09.2022	-	IRS	IRH	-8	SOCIETE GENERALE PARIS	5 644	USD	3 531	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
247.	Interest Rate Sw ap CH2048R 03.04.2042	-	IRS	IRH	365	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	99 353	USD	30 685	USD	03.04.2042	1 000 000	USD	1 000 000	USD	03.04.2042	03.04.2042
248.	Interest Rate Sw ap CI230330R 17.03.2023	-	IRS	IRH	-22	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	68 075	USD	62 205	USD	17.03.2023	14 300 000	USD	14 300 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
249.	Interest Rate Sw ap CI260440R 06.04.2026	-	IRS	IRH	-157	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	249 562	USD	206 525	USD	06.04.2026	10 000 000	USD	10 000 000	USD	06.04.2026	06.04.2026

OPIS 'CEL otwarcia pozycji'

IRH

ORI

Ograniczenie ryzyka w aktów ego portfela papierów w wartościach denominowanych w walutach obcych (IRH)

Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w wartościach

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

W poniższych informacjach (Nota 7) przedstawione są 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*)

	31.12.2020	31.12.2019
Transakcje typu <i>Buy-sell-back</i> (wartość należności z tyt. odsprzedaży papieru)	Nie miał zawartych	Nie miał zawartych

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

	31.12.2020	31.12.2019
Transakcje typu <i>Sell-buy-back</i> (wartość zobowiązania do odkupu papieru)	Zaprezentowane w tabeli poniżej	Zaprezentowane w tabeli poniżej

W odniesieniu do transakcji na 31.12.2020

31.12.2020		Transakcje typu <i>Sell-buy-back</i> (w tym <i>repo</i>)								AKTYWNE kontrakty SBB: 5	
Lp.	Kontrahent	Rodzaj	Wycena w walucie (w tys.)	Waluta	Dni do zapadalności	% Aktywów	Instrument bazowy	ISIN	Wartość nominalna (instr. bazowy w tys.)	Wycena w tys. PLN	
1.	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	SBB	861 936	HUF	Bez terminu	0.25%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	10 893	
2.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	25 380	PLN	Bez terminu	0.59%	FP300601	PL0000500278	25 000	25 383	
3.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	13 071	PLN	Bez terminu	0.30%	WZ0524	PL0000110615	13 000	13 071	
4.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	11 060	PLN	Bez terminu	0.26%	WZ0524	PL0000110615	11 000	11 060	
5.	BNP PARIBAS	SBB	2 039 114	HUF	Bez terminu	0.60%	HU230801	HU0000404280	2 000 000	25 769	
5. - pozycji. PODSUMOWANIE						2.00%				86 176	

W odniesieniu do transakcji na 31.12.2019

31.12.2019		Transakcje typu <i>Sell-buy-back</i> (w tym <i>repo</i>)									
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	16 975	PLN	Bez terminu	0.31%	WZ0524	PL0000110615	17 000	16 983	
2.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	86 872	PLN	Bez terminu	1.59%	WZ0524	PL0000110615	87 000	86 923	
3.	NWAI Dom Maklerski SA	SBB	14 055	PLN	Bez terminu	0.26%	WZ1122	PL0000109377	14 000	14 063	
4.	Bank Polska Kasa Opieki SA	SBB	150 597	PLN	Bez terminu	2.75%	WZ1122	PL0000109377	150 000	150 686	
5.	Santander Bank Polska S.A.	SBB	12 588	PLN	Bez terminu	0.23%	PS0123	PL0000110151	12 000	12 591	
6.	Santander Bank Polska S.A.	SBB	12 992	PLN	Bez terminu	0.24%	WZ0524	PL0000110615	13 000	12 995	
7.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	83 938	PLN	Bez terminu	1.53%	PS0123	PL0000110151	80 000	83 945	
7. - pozycji. PODSUMOWANIE						6.91%				378 186	

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

	31.12.2020	31.12.2019
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

	31.12.2020	31.12.2019
Pożyczone papiery wartościowe (w charakterze pożyczkobiorcy)	nie miał otwartych pozycji	nie miał otwartych pozycji

Nota - 8 Kredyty i pożyczki

Subfundusz nie miał na datę bilansową udzielonych pożyczek ani zaciągniętych kredytów

Nota - 9 Waluty i różnice kursowe

1) Zestawienie walutowej struktury pozycji bilansu:

NOTA-9 I. WALUTOWA STRUKTURA POZYCJI BILANSU	2020-12-31		2019-12-31	
	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		4 318 988		5 478 695
1. Środki pieniężne i ich ekw walenty		84 239		33 353
EUR	10 070	46 475	4 205	17 904
HUF	715	9	0	0
PLN	37 635	37 635	14 803	14 803
USD	32	120	170	646
2. Należności		25 500		46 847
EUR	0	0	11 000	46 844
PLN	25 500	25 500	3	3
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu		0		0
4. Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku, w tym:		1 861 061		2 614 147
- dłużne papiery w wartościowe		1 861 061		2 614 147
CZK	1 641 952	287 835	0	0
EUR	194 938	899 609	101 421	431 906
HUF	18 674 874	236 013	0	0
PLN	284 061	284 061	1 929 820	1 929 820
USD	40 853	153 543	66 466	252 421
5. Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku, w tym:		2 348 188		2 784 348
CZK	477 354	83 681	-571 871	-95 846
EUR	5 668	26 161	-87 916	-374 394
HUF	-8 169 248	-103 242	55 640	716
PLN	113 071	113 071	881 598	881 598
USD	111	417	1 269	4 822
- dłużne papiery w wartościowe		2 228 100		2 367 452
EUR	1 850	8 535	0	0
PLN	2 219 565	2 219 565	2 367 452	2 367 452
6. Nieruchomości	0	0	0	0
7. Pozostałe aktywa		0		0
II. Zobowiązania		169 437		468 248
CZK	1 849 899	324 286	-576 036	-96 544
EUR	164 792	760 470	28 363	120 786
HUF	7 940 202	100 348	58 604	756
PLN	-1 024 822	-1 024 822	438 662	438 662
USD	2 437	9 155	1 209	4 588

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

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 255/A/NBP/2020 z dnia 2020-12-31			
	Nazwa waluty	Kod waluty	Kurs średni
1.	dolar amerykański	1 USD	3,7584
2.	euro	1 EUR	4,6148
3.	forint (Węgry)	100 HUF	1,2638
4.	korona czeska	1 CZK	0,1753

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	2020-12-31			
	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 artosciowe	26 739	46 291	0	0
Instrumenty pochodne	0	0	0	53 882
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 spólnego 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 Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

NOTA-9 II. DODATNIE I UJEMNE RÓŻNICE KURSOWE W PRZEKROJU LOKAT FUNDUSZU	31.12.2019			
	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 artosciowe	25 199	0	0	26 402
Instrumenty pochodne	0	4 509	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 spólnego 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

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	2020-12-31		2019-12-31	
	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.
Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku	51 346	37 111	33 962	-28 052
Instrumenty pochodne	-9	0	0	0
Dłużne papiery w artosciowe	51 355	37 111	33 962	-28 052
Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku	-42 490	-50 108	-2 640	-4 059
Listy zastawne	99	-47	85	-67
Instrumenty pochodne	-53 958	-67 992	-4 482	-4 433
Dłużne papiery w artosciowe	11 369	17 931	1 757	441
Nieruchomości	0	0	0	0
Pozostałe	0	0	0	0
Suma:	8 856	-12 997	31 322	-32 111

- 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:

Kategoria JU	Maksymalna stawka (określona w Statucie)	Stawka obowiązująca na dzień bilansowy	Data, od kiedy stawka obowiązuje
A	1,00 %	0,80 %	23.05.2018
E, I	1,00 %	0,80 %	31.12.2020
F	0,95 %	0,80 %	31.12.2020
J	2,50 %	0,80 %	31.12.2020
K	2,00 %	0,80 %	31.12.2020
L	1,50 %	0,80 %	31.12.2020

- 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.

	rok 2020	rok 2019
Subfundusz naliczył wynagrodzenie za zarządzanie w wysokości (tys. zł)	32 831	39 181

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

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

- wynagrodzenie Towarzystwa za zarządzanie – ujawniane szczegółowo w niniejszej notcie.
- 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:
 - opłaty i prowizje maklerskie – ujmowane w kosztach konkretnych transakcji,
 - opłaty i prowizje bankowe,
 - provizje i opłaty na rzecz instytucji depozytowych oraz rozliczeniowych oraz prowadzących wymagane prawem repozytoria, w tym opłaty transakcyjne,
 - koszty obsługi i odsetek od kredytów i pożyczek zaciągniętych;
- podatki i opłaty oraz inne koszty wynikające z przepisów prawa lub regulacji wewnętrznych sądów, w tym w szczególności:
 - opłaty sądowe i notarialne,
 - koszty postępowania przed sądem powszechnym, sądem polubownym, sądem administracyjnym oraz cywilnego postępowania egzekucyjnego, związane z działalnością inwestycyjną Funduszu dokonywaną na rzecz Subfunduszu,
 - opłaty za decyzje i zezwolenia Komisji,
- koszty likwidacji;

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

Koszty (i), (ii) (b-d), (iii) zostały zaprezentowane odrębnie (w niniejszej notcie-11 oraz w części sprawozdania 'Rachunek Wyniku z Operacji').

Z kwoty wpłat uczestników pobierana jest opłata manipulacyjna (nie stanowi kosztu funduszu/subfunduszu), 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.

Nota - 12 Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa

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

Opis	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2018	31.12.2017
Wartość Aktywów Netto	4 112 888 tys. zł	5 010 447 tys. zł	4 850 490 tys. zł	3 777 874 tys. zł
Wartość JU A [zł]	12.98	12.77	12.57	12.35

Informacje dodatkowe

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

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

B Informacje o znaczących zdarzeniach po dniu bilansowym

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

C Dokonane korekty błędów podstawowych

W okresie sprawozdawczym nie dokonywano korekt błędów podstawowych.

Ponadto:

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

D Inne informacje

Nazwa Subfunduszu, Jednostki Uczestnictwa Subfunduszu i ich zbywanie, zarządzający

Subfundusz *Pekao Spokojna Inwestycja* wydzielony w funduszu *Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty*.

Rodzaj funduszu: Fundusz jest specjalistycznym funduszem inwestycyjnym otwartym z wydzielonymi subfunduszami.

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

W okresie sprawozdawczym Fundusz zbywał (w każdym z subfunduszy) Jednostki Uczestnictwa bez podziału na kategorie. 31.12.2020 weszła w życie zmiana Statutu Funduszu, zgodnie z którą wcześniej zbyte Jednostki Uczestnictwa stały się Jednostkami Uczestnictwa kategorii A, a w Subfunduszu są zbywane także Jednostki Uczestnictwa innych kategorii: E, F, I, J, K oraz L. Na datę bilansową takie Jednostki uczestnictwa nie zostały nabyte.

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

- Jednostki Uczestnictwa kategorii A
- Jednostki Uczestnictwa kategorii E (od 31.12.2020)
- Jednostki Uczestnictwa kategorii I (od 31.12.2020)
- Jednostki Uczestnictwa kategorii F (od 31.12.2020)
- Jednostki Uczestnictwa kategorii J, K, L (od 31.12.2020)

Jednostki uczestnictwa różnych kategorii mogą różnić się między sobą:

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

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

Zarządzanie portfelem lokat Subfunduszu odbywa się w Towarzystwie.

Zmiana rozporządzenia dot. szczególnych zasad rachunkowości funduszy

1.01.2021 weszła w życie zmiana w przepisach dot. szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych (Rozporządzenie Ministra Finansów, Funduszy i Polityki Regionalnej z 28.12.2020).

Towarzystwa funduszy inwestycyjnych, fundusze inwestycyjne zapewnią dostosowanie rachunkowości do zmienionych przepisów nie później niż do dnia 1.07.2021, a wynikające zmiany w zakresie sprawozdań mają zastosowanie do sprawozdań finansowych, połączonych sprawozdań finansowych oraz sprawozdań jednostkowych subfunduszy sporządzanych za rok obrotowy rozpoczynający się po dniu 31.12.2020. Zmienione przepisy mogą być stosowane do półrocznych sprawozdań finansowych, półrocznych połączonych sprawozdań finansowych oraz półrocznych sprawozdań jednostkowych subfunduszy sporządzanych za okres sprawozdawczy kończący się w dniu 30.06.2021 i w takim przypadku w informacji dodatkowej zostanie umieszczona, zgodnie z przepisami, odpowiednia informacja, przy czym w przypadku nie stosowania jeszcze zmienionych przepisów odpowiednia adnotacja zostaje także umieszczona.

W sprawozdaniach finansowych, połączonych sprawozdaniach finansowych oraz sprawozdaniach jednostkowych subfunduszy sporządzanych po raz pierwszy zgodnie ze zmienionymi przepisami rozporządzenia nie dokonuje się przekształcenia danych porównawczych za poprzedni okres sprawozdawczy.

Zmiany w przepisach obejmują w szczególności:

- Przyjęcie nadrzędnej zasady wyceny składników lokat w oszacowanej wartości godziwej i wprowadzenia hierarchii wartości godziwej:
 1. Cena z aktywnego rynku (określonego jako rynek, na którym transakcje dotyczące danego składnika aktywów lub zobowiązania odbywają się z dostateczną częstotliwością i mają dostateczny wolumen, aby dostarczać bieżących informacji na temat cen tego składnika aktywów lub zobowiązania, w tym rynki giełdowe, rynki pośredników, rynki brokerskie i rynki transakcji bezpośrednich, które cechują się taką częstotliwością i wolumenem),
 2. Cena wyliczona z zastosowaniem modelu wyceny, gdzie wszystkie znaczące dane wejściowe są obserwowalne w sposób bezpośredni lub pośredni,
 3. Wartość godziwa ustalona za pomocą modelu wyceny opartego o dane nieobserwowalne.
- Określenie warunków do korzystania z danych wejściowych i stosowania modeli wyceny poszczególnych składników lokat, ich okresowych przeglądów, koniecznym uzgodnieniu modeli wyceny z depozytariuszem. Wskazane zostały także zasady koniecznych ujawnień, w szczególności w sprawozdaniach okresowych.
- Wskazane zostały krótkoterminowe lokaty (pierwotny termin zapadalności do 92 dni) oraz inne przypadki naliczeń, dla których możliwe jest stosowanie wyceny metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.
- Rozszerzenie zakresu ujawnień w sprawozdaniach okresowych, a tym w tabelach.

Zmiany w odniesieniu do funduszy inwestycyjnych zarządzanych przez Pekao TFI:

- Pekao TFI prowadzi prace wdrożeniowe w zakresie konstrukcji modeli (wraz z koniecznymi uzgodnieniami i zmianami systemowymi) i dokumentacji księgowej.
- Zmiany dotyczą wdrożenia ujednoliconego modelu równocześnie w odniesieniu do wszystkich funduszy.
- Nie jest spodziewana istotna różnica w wyniku zmiany wyceny, mimo dużej skali instrumentów, które są objęte pracami.
- Wdrożenie jest planowane do końca 1. półrocza 2021.

Wpływ pandemii COVID-19 na Subfundusz

W roku 2020 ma miejsce rozprzestrzenienie się koronawirusa SARS-CoV-2 (2019-nCoV) i światowa pandemia CoViD-19. Jednym z efektów epidemii są problemy gospodarcze (przerwanie łańcucha dostaw, zakłócenia w działaniu całych branż przemysłu i usług oraz ograniczenie popytu konsumpcyjnego) mogące mieć długotrwałe skutki w obniżeniu rozwoju gospodarczego i zwiększeniu poziomu bezrobocia, sytuacji płynnościowej, a co za tym idzie duża zmienność i duża skala obniżek kursów instrumentów finansowych, utrata wartości niektórych walut, w tym pln oraz niepewność na rynkach finansowych. Problem ma charakter globalny. Reakcja instytucji na całym świecie w postaci luzowania polityki monetarnej (np. poprzez obniżki stóp procentowych) i fiskalnej (np. pakiety stymulacyjne czy ulgi podatkowe) była bez precedensu. Pozwoliło to uniknąć depresji ekonomicznej, a gospodarka światowa weszła na ścieżkę poprawy. Jednakże skutkiem tego w funduszach inwestycyjnych otwartych i specjalistycznych funduszach inwestycyjnych otwartych były realizowane w 2020 duże zlecenia odkupienia (największa skala dotyczyła marca 2020), a wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa okresowo obniżała się. Początek kwietnia przyniósł istotne zmniejszenie skali zleceń odkupienia, a w maju i czerwcu 2020 sytuacja uległa uspokojeniu, w szczególności także w związku z obniżkami oprocentowania lokat bankowych. W drugiej połowie roku wartość aktywów netto subfunduszy oraz wartości aktywów na jednostkę zaczęły wzrastać.

Towarzystwo podejmowało działania w obszarze zarządzania portfelem, w tym zarządzania ryzykiem dla ograniczenia skutków pandemii, w tym także w zakresie decyzji uczestników o wypłatach. Także jakość kluczowych procesów operacyjnych nie uległa pogorszeniu, mimo koniecznych zmian w tym w zakresie pracy zdalnej.

Na dzień podpisania sprawozdania sytuacja finansowa i płynnościowa subfunduszu, w kontekście skutków pandemii CoViD-19, nie budzi wątpliwości co do kontynuacji działalności w okresie co najmniej 12 miesięcy.

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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres roczny kończący się 31 grudnia 2020 roku

o stanie rachunków uczestników Towarzystwo oferuje system automatycznej obsługi i informacji *eFunduszePekao*. Ponadto Towarzystwo zarządza informacyjną stroną w Internecie: <https://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, a także (od 2021) dodatkowe *informacje okresowe*, w tym skład portfela.

Nazwa	Pekao Funduszy Globalnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty - Pekao Spokojna Inwestycja		
Nazwa w j. angielskim	Pekao Reliable Investment (subfund of: Pekao Global Funds Specialized Open-End Investment Fund)		
Rozpoczęcie wycen	17.12.2009	Wartość początkowa (A)	10,00 zł
Oznaczenia	ISIN JU	IZFiA	Nr krajowy (KNF)
w systemach	PLPPTFI00394	PIO046	PLSFIO00075
<i>Podstawowe dane na 31 grudnia 2020</i>			
Wartość aktywów netto	4 112 888 tys. zł	Wartość JU kat. A	12.98 zł

Warszawa, dnia 26.03.2021 roku.