



Pekao TFI

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych

**Pekao Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych
Spółka Akcyjna**

02-674 Warszawa, ul. Marynarska 15

przedstawia

**Sprawozdanie jednostkowe
30.06.2021**

PÓŁROCZNE SPRAWOZDANIE JEDNOSTKOWE*

PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA

subfunduszu w PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNYM FUNDUSZU
INWESTYCYJNYM OTWARTYM

ZA OKRES PÓŁROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 30 CZERWCA 2021 ROKU

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

Oświadczenie Zarządu Pekao TFI S.A.

Zarząd Pekao TFI S.A., zgodnie z wymogami art. 52 *Ustawy* z dnia 29 września 1994 roku o rachunkowości (t.j. Dz.U. z 2021, poz. 217, ze zm.) przedstawia PÓLROCZNE 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 30 czerwca 2021 o wartości 5 118 921 tys. zł;
2. bilans subfunduszu na dzień 30 czerwca 2021 wykazujący wartość aktywów netto subfunduszu w kwocie 4 390 753 tys. zł;
3. rachunek wyniku z operacji subfunduszu za okres od 1 stycznia 2021 do 30 czerwca 2021 wykazujący wynik z operacji w kwocie -1 103 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 półroczny (od 1 stycznia 2021) kończący się 30 czerwca 2021, 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 S.A.:

Łukasz Kędzior
Prezes Zarządu

Jacek Babiński
Wiceprezes Zarządu

Mateusz Kowalski
Wiceprezes Zarządu

Osoba, której powierzono prowadzenie ksiąg rachunkowych

Zbigniew Czumaj
Główny Księgowy Funduszy
Dyr. Departamentu Księgowości
Funduszy

Spis treści

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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Zestawienie lokat

Tabela główna

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2021
Zestawienie Lokat - Tabela Główna

SKŁADNIKI LOKAT	30.06.2021			31.12.2020		
	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	305 780	306 593	5.71%	337 339	337 405	7.80%
Dłużne papiery wartościowe	4 631 223	4 656 332	87.03%	3 672 315	3 751 756	86.86%
Instrumenty pochodne	0	-14 130	-0.29%	0	-74 930	-1.67%
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	170 000	170 126	3.18%	100 000	100 023	2.32%
Waluty	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Nieruchomości	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Statki morskie	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Inne	0	0	0.00%	0	0	0.00%
Suma:	5 107 003	5 118 921	95.63%	4 109 654	4 114 254	95.31%

Tabele uzupełniające

LISTY ZASTAWNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu	Warunki oprocentowania	Rodzaj listu	Podstawa emisji	Wartość nominalna	Liczba	Wartość wg ceny nabycia w tys.	Wartość wg wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Aktywny rynek nieregulowany											0	0	0.00%
Aktywny rynek regulowany											0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku											305 780	306 593	5.71%
mBank Hipoteczny S.A. (PLRHNHP00433)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank Hipoteczny S.A.	Polska	28.04.2022	1.02%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	30 000.	30 000	29 823	0.56%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. (PLBPHHP00176)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Bank Hipoteczny S.A.	Polska	24.09.2021	0.24%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	1 850.	8 381	8 366	0.16%
PKO Bank Hipoteczny S.A. (PLPKOHP00132)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	30.09.2024	0.81%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	40.	20 000	20 000	0.37%
mBank Hipoteczny S.A. (PLRHNHP00573)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank Hipoteczny S.A.	Polska	12.09.2022	0.96%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	100 000.	300.	30 155	30 083	0.56%
PKO Bank Hipoteczny S.A. (PLPKOHP0058)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	10.09.2021	2.69%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	104.	52 695	53 221	0.99%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. (PLBPHHP00184)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Bank Hipoteczny S.A.	Polska	22.03.2023	1.20%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	10 000.	10 097	10 093	0.19%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. (PLBPHHP00259)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Bank Hipoteczny S.A.	Polska	26.05.2023	0.96%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	35 000.	35 028	35 051	0.65%
PKO Bank Hipoteczny S.A. (PLPKOHP0074)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	25.04.2024	0.70%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	500 000.	10.	4 980	5 018	0.09%
mBank Hipoteczny S.A. (PLRHNHP00540)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank Hipoteczny S.A.	Polska	21.09.2026	1.18%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	100 000.	60.	28 650	29 013	0.54%
mBank Hipoteczny S.A. (PLRHNHP00557)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank Hipoteczny S.A.	Polska	21.09.2026	1.18%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	100 000.	150.	72 237	72 330	1.35%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. (PLBPHHP00267)	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Bank Hipoteczny S.A.	Polska	24.02.2027	1.00%	Hipoteczny List Zastawny	Warunki Emisji Listów Zastawnych	1 000.	13 526.	13 557	13 595	0.25%
Suma:											305 780	306 593	5.71%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 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									988 331	987 247	18.44%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%
Obligacje									988 331	987 247	18.44%
Aktywny rynek nieregulowany									330 676	329 720	6.16%
mFinance France S.A. XS1143974159	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	mFinance France S.A.	Francja	26.11.2021	2.00 (Stały kupon)	1 000.	24926	115 576	114 930	2.15%
PS0422 PLO000109492	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.04.2022	2.25 (Stały kupon)	1 000.	100	102	102	0.00%
Santander Bank Polska S.A. XS1849525057	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Santander Bank Polska S.A.	Polska	20.09.2021	0.75 (Stały kupon)	1 000.	12250	54 549	55 863	1.04%
Skarb Państwa (Polska) XS1306382364	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	14.10.2021	0.88 (Stały kupon)	1 000.	13041	59 995	59 542	1.11%
Skarb Państwa (Polska) XS1536786939	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	20.12.2021	0.50 (Stały kupon)	1 000.	16500	75 028	75 111	1.40%
Skarb Państwa (Polska) XS0282701514	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	18.01.2022	4.50 (Stały kupon)	1 000.	1000	4 767	4 738	0.09%
CEZ A.S. Seria REGS XS0764313614	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	CEZ A.S.	Czechy	03.04.2022	4.25 (Stały kupon)	1 000.	3800	16 124	14 880	0.28%
Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A. XS1650147660	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	Polska	25.07.2021	0.75 (Stały kupon)	1 000.	1000	4 535	4 554	0.09%
Aktywny rynek regulowany									1 175	1 183	0.02%
PKN Orlen S.A. Seria A PLPKN0000158	Aktywny rynek regulowany	Warsaw Stock Exchange	PKN Orlen S.A.	Polska	19.09.2021	1.25 (Zmienny kupon)	100.	11762	1 175	1 183	0.02%
Nienotowane na aktywnym rynku									656 480	656 344	12.26%
Enea S.A. Seria EX122017	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Enea S.A.	Polska	15.06.2022	1.20 (Zmienny kupon)	1 000 000.	101	101 646	101 283	1.89%
Enea S.A. Seria EV052016	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Enea S.A.	Polska	15.06.2022	1.20 (Zmienny kupon)	1 000 000.	45	45 202	45 097	0.84%
Gmina Milicz Seria B19 PLO276400028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Milicz	Polska	22.11.2021	2.05 (Zmienny kupon)	1 000.	1800	1 804	1 805	0.03%
Miasto Łódź Seria LODZ 1022 101022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Łódź	Polska	11.04.2022	1.30 (Zmienny kupon)	1 000.	8265	8 318	8 313	0.16%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Seria 5 PLPKOHP00181	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	20.12.2021	0.81 (Zmienny kupon)	100.	2759	272	276	0.01%
Miasto Poznań Seria H	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miasto Poznań	Polska	29.12.2021	1.05 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 023	5 008	0.09%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Seria PKOBH210726 PLO219200204	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	26.07.2021	0.00 (Zerowy kupon)	500 000.	40	19 978	19 995	0.37%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Seria PKOBH210906 PLO219200220	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	06.09.2021	0.00 (Zerowy kupon)	500 000.	239	119 296	119 423	2.23%
Santander Leasing S.A. Seria H PLO243200089	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Leasing S.A.	Polska	11.03.2022	0.36 (Zmienny kupon)	1 000.	109530	109 530	109 551	2.05%
mLeasing Sp. z o.o. Seria ML05210821 PLO243700328	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mLeasing Sp. z o.o.	Polska	20.08.2021	0.00 (Zerowy kupon)	100 000.	335	33 456	33 476	0.63%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Seria PKOBH220124 PLO219200261	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	24.01.2022	0.00 (Zerowy kupon)	500 000.	140	69 777	69 813	1.30%
Pekao Leasing Sp. z o.o. Seria PEKALE63 PLO234800301	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Pekao Leasing Sp. z o.o.	Polska	01.04.2022	0.00 (Zerowy kupon)	10 000.	500	22 490	22 604	0.42%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Seria PKOBH220124A PLO219200279	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	24.01.2022	0.00 (Zerowy kupon)	500 000.	240	119 688	119 700	2.24%
O terminie wykupu powyżej 1 roku									3 642 892	3 669 085	68.59%
Bony pieniężne									0	0	0.00%
Bony skarbowe									0	0	0.00%
Inne									0	0	0.00%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

										3 642 892	3 669 085	68.59%	
										2 275 182	2 306 902	43.10%	
Obligacje													
Aktywny rynek nieregulowany													
PKO Finance AB XS0783934085	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PKO FINANCE AB	Szwecja	26.09.2022	4.63 (Stały kupon)	1 000.	24239	100 106	97 846	1.83%		
Skarb Państwa (Polska) XS0794399674	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	19.01.2023	3.75 (Stały kupon)	1 000.	14895	73 388	72 941	1.36%		
Skarb Państwa (Polska) US857524AC63	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	22.01.2024	4.00 (Stały kupon)	1 000.	95	365	400	0.01%		
WZ0124 PL0000107454	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.01.2024	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	132099	132 849	132 717	2.48%		
WZ0126 PL0000108817	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.01.2026	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	500	486	502	0.01%		
Orlen Capital AB XS1429673327	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	ORLEN CAPITAL AB	Szwecja	07.06.2023	2.50 (Stały kupon)	1 000.	4200	19 694	19 877	0.37%		
WZ1122 PL0000109377	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.11.2022	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	300	289	301	0.01%		
Ministry of Finance - Hungary (HU) HU0000403068	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Hungary (HU)	Węgry	26.06.2024	3.00 (Stały kupon)	10 000.	600000	79 578	80 181	1.50%		
Ministry of Finance - Czech Republic (CZ) CZ0001004600	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	Czechy	25.10.2023	0.45 (Stały kupon)	10 000.	80000	131 645	139 860	2.61%		
WZ0524 PL0000110615	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	27.05.2024	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	490846	493 420	492 829	9.20%		
Skarb Państwa (Polska) XS1015428821	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	15.01.2024	3.00 (Stały kupon)	1 000.	14172	70 402	70 566	1.32%		
Skarb Państwa (Polska) XS0841073793	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	09.07.2024	3.38 (Stały kupon)	1 000.	30675	155 517	159 002	2.97%		
WZ0528 PL0000110383	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.05.2028	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	300	291	300	0.01%		
Skarb Państwa (Polska) XS047933311	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	20.01.2025	5.25 (Stały kupon)	1 000.	10710	59 584	59 167	1.10%		
mBank S.A. Seria EMTN XS1876097715	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	mBank S.A.	Polska	05.09.2022	1.06 (Stały kupon)	1 000.	6000	26 193	27 607	0.52%		
Ministry of Finance - Hungary (HU) HU0000403571	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Hungary (HU)	Węgry	24.10.2024	2.50 (Stały kupon)	10 000.	100000	13 170	13 395	0.25%		
Skarb Państwa (Polska) XS1288467605	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	09.09.2025	1.50 (Stały kupon)	1 000.	3000	13 334	14 722	0.27%		
PS0424 PL0000111191	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.04.2024	2.50 (Stały kupon)	1 000.	4000	4 270	4 231	0.08%		
PS1024 PL0000111720	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.10.2024	2.25 (Stały kupon)	1 000.	300	309	319	0.01%		
WZ0525 PL0000111738	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	26.05.2025	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	2495	2 433	2 503	0.05%		
CEZ A.S. Seria REGS XS0764314695	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	CEZ A.S.	Czechy	03.04.2042	5.63 (Stały kupon)	1 000.	1000	5 174	4 720	0.09%		
Ministry of Finance - Czech Republic (CZ) CZ0001005870	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	Czechy	14.02.2025	1.25 (Stały kupon)	10 000.	58000	96 874	102 806	1.92%		
Ministry of Finance - Hungary (HU) HU0000404280	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Hungary (HU)	Węgry	23.08.2023	1.50 (Stały kupon)	10 000.	1720000	218 179	224 928	4.20%		
Megyer Fejlesztési bank Zárkötven Mukodo Bank XS2010030752	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Magyar Fejlesztési bank Zárkötven Mukodo Bank	Węgry	24.06.2025	1.38 (Stały kupon)	1 000.	2500	11 071	11 849	0.22%		
Skarb Państwa (Polska) XS2114767457	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	10.02.2025	0.00 (Zerowy kupon)	1 000.	5000	22 328	22 810	0.43%		
Skarb Państwa (Polska) XS2199493169	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Skarb Państwa (Polska)	Polska	07.07.2023	0.00 (Zerowy kupon)	1 000.	57000	257 217	259 781	4.85%		
DS1030 PL0000112736	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.10.2030	1.25 (Stały kupon)	1 000.	110000	106 365	107 359	2.00%		
Ministry of Finance - Czech Republic (CZ) CZ0001005037	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	Czechy	10.02.2027	0.25 (Stały kupon)	10 000.	12000	19 379	19 682	0.37%		
MLL Hungarian Oil and Gas Plc. XS232045463	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	MLL Hungarian Oil and Gas Plc.	Węgry	08.10.2027	1.50 (Stały kupon)	1 000.	2000	9 015	9 529	0.18%		
Ministry of Finance - Romania (RO) XS2258400162	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Romania (RO)	Rumunia	03.12.2040	2.63 (Stały kupon)	1 000.	400	1 802	1 826	0.03%		
Ministry of Finance - Czech Republic (CZ) CZ0001006167	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	Czechy	12.12.2024	0.00 (Zerowy kupon)	10 000.	43000	72 247	72 612	1.36%		
Ministry of Finance - Czech Republic (CZ) CZ0001004105	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	Czechy	19.11.2027	0.39 (Zmienny kupon)	10 000.	35000	60 788	61 941	1.16%		
WZ1126 PL0000113130	Aktywny rynek nieregulowany	PL - Rynek Treasury BondSpot Poland	Skarb Państwa (Polska)	Polska	25.11.2026	0.25 (Zmienny kupon)	1 000.	4000	4 010	4 008	0.07%		
PKN Orlen S.A. XS2346125573	Aktywny rynek nieregulowany	Over The Counter - Bloomberg Quotations	PKN Orlen S.A.	Polska	27.05.2028	1.13 (Stały kupon)	1 000.	3000	13 410	13 785	0.26%		
Nienotowane na aktywnym rynku													
J.P. Morgan Chase & Co Seria E005 XS1569783513	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	16.06.2027	1.20 (Zmienny kupon)	50 000.	600	30 000	30 014	0.56%		
Gielda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. Seria C PLGPW0000066	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gielda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.	Polska	06.10.2022	3.19 (Stały kupon)	100.	130000	13 390	13 316	0.25%		
Goldman Sachs International Seria E005 XS1510672963	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	08.05.2028	1.24 (Zmienny kupon)	100 000.	450	45 000	45 082	0.84%		
PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. Seria PGE002210526 PLPGER0000069	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PGE Polska Grupa Energetyczna S.A.	Polska	21.05.2026	1.45 (Zmienny kupon)	1 000.	20000	20 000	20 032	0.37%		
Enea S.A. Seria ENEA0624 PLENEA000096	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Enea S.A.	Polska	26.06.2024	1.45 (Zmienny kupon)	100 000.	247	24 722	24 719	0.46%		
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	2 006	0.04%		
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	2 417	0.05%		
Gmina Masta Tarnów Seria B19 PLO266300022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Tarnów	Polska	20.11.2029	2.35 (Zmienny kupon)	1 000.	4650	4 358	4 362	0.08%		
Gmina Masta Tarnów Seria A19 PLO266300014	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Tarnów	Polska	20.11.2031	2.55 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	4 922	4 929	0.09%		
Gmina Ośno Lubuskie Seria A19 PLO295500018	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Ośno Lubuskie	Polska	22.11.2032	2.85 (Zmienny kupon)	1 000.	1000	1 011	1 013	0.02%		
Bank Gospodarstwa Krajowego Seria BOK022350184 PL0000500252	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	28.10.2023	0.64 (Zmienny kupon)	1 000.	15000	15 100	15 113	0.28%		
Gmina Ośno Lubuskie Seria A20 PLO295500026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Ośno 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	1.05 (Zmienny kupon)	10 000.	1000	10 005	10 028	0.19%		
Bank Gospodarstwa Krajowego Seria IDS1022 PL0000500070	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	25.10.2022	5.75 (Stały kupon)	1 000.	13730	14 911	15 127	0.28%		
Bank Gospodarstwa Krajowego PL000050026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	27.04.2027	1.88 (Stały kupon)	1 000.	226000	224 641	224 260	4.19%		
Bank Gospodarstwa Krajowego PL000050027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	05.06.2030	2.13 (Stały kupon)	1 000.	150000	150 137	146 795	2.74%		
Masto Łódź Seria LODZ0924	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Łódź	Polska	30.09.2024	1.35 (Zmienny kupon)	1 000.	5000	5 055	5 059	0.09%		
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000019	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju S.A.	Polska	29.03.2024	1.38 (Stały kupon)	1 000 000.	1	1 000	1 007	0.02%		
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju S.A.	Polska	31.03.2025	1.63 (Stały kupon)	1 000 000.	105	104 665	105 127	1.96%		
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000043	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju S.A.	Polska	07.06.2027	1.75 (Stały kupon)	1 000 000.	60	59 801	59 054	1.10%		
Województwo Pomorskie Seria WPOM G 151222	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Województwo Pomorskie	Polska	15.12.2022	1.15 (Zmienny kupon)	1 000.	4400	4 429	4 419	0.08%		



PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Bank Gospodarstwa Krajowego PLO00050028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	03.07.2025	1,25 (Stały kupon)	1 000,	63380	62 952	63 684	1,19%
Gmina Jablonna Serie A20 PLO304200028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Jablonna	Polska	20.11.2026	1,25 (Zmienny kupon)	1 000,	4000	4 009	4 013	0,07%
Gmina Masta Lubań Serie C20 PLO313500036	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Masta Lubań	Polska	30.09.2032	1,82 (Zmienny kupon)	1 000,	1150	1 153	1 158	0,02%
Gmina Suchy Las Serie B20 PLO311400025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	16.09.2024	1,33 (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	2 003	0,04%
Gmina Dopiewo Serie B20 PLO266500084	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Dopiewo	Polska	07.12.2027	1,28 (Zmienny kupon)	1 000,	2500	2 505	2 507	0,05%
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	1 002	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	1 504	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 Kępy Serie C20 PLO321700018	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Kępy	Polska	25.11.2033	2,04 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 003	1 005	0,02%
Gmina Lesznowola Serie A20 PLO275200056	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	15.01.2029	1,45 (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	1,45 (Zmienny kupon)	1 000,	1200	1 203	1 211	0,02%
Gmina Lesznowola Serie G20 PLO275200031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	15.01.2032	1,45 (Zmienny kupon)	1 000,	4000	4 013	4 038	0,08%
Gmina Lesznowola Serie H20 PLO275200064	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lesznowola	Polska	17.01.2033	1,45 (Zmienny kupon)	1 000,	2000	2 007	2 020	0,04%
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	0,04%
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	4 005	0,07%
Gmina Słupsk Serie A2020 PLO263000047	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Słupsk	Polska	30.10.2029	1,61 (Zmienny kupon)	1 000,	2000	2 005	2 010	0,04%
Gmina Miejska Legionowo Serie C20 PLO310500039	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Miejska Legionowo	Polska	20.11.2023	1,31 (Zmienny kupon)	1 000,	1500	1 505	1 506	0,03%
Gmina Lomianki Serie A20 PLO306100010	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lomianki	Polska	17.11.2025	1,26 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 001	1 003	0,02%
Masto Poznań Serie A2020 PLO318600015	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań	Polska	16.11.2023	0,90 (Zmienny kupon)	1 000,	10000	10 012	10 021	0,19%
Masto Poznań Serie E2020 PLO318600023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań	Polska	20.11.2024	1,02 (Zmienny kupon)	1 000,	15000	15 030	15 043	0,28%
Masto Poznań Serie C2020 PLO318600031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań	Polska	26.11.2025	1,03 (Zmienny kupon)	1 000,	5000	5 006	5 010	0,09%
Masto Poznań Serie E2020 PLO318600056	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań	Polska	26.11.2027	1,30 (Zmienny kupon)	1 000,	5000	5 015	5 019	0,09%
Gmina Suchy Las Serie A20 PLO311400033	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	30.09.2026	1,33 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 002	1 005	0,02%
Gmina Suchy Las Serie B20 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	0,03%
Gmina Suchy Las Serie E20 PLO311400058	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Suchy Las	Polska	12.11.2030	1,32 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 003	1 004	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	0,04%
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	0,04%
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	0,07%
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	2 007	0,04%
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	2 005	0,04%
Gmina Uniejów Serie A20 PLO338000013	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Uniejów	Polska	22.11.2027	2,25 (Zmienny kupon)	1 000,	850	853	855	0,02%
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	0,06%
Masto Poznań Serie F2020 PLO318600064	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Poznań	Polska	22.12.2028	1,35 (Zmienny kupon)	1 000,	10000	10 033	10 034	0,19%
Masto Toruń Serie B20 PLO338600011	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Toruń	Polska	29.12.2027	1,40 (Zmienny kupon)	1 000,	1500	1 501	1 501	0,03%
Masto Toruń Serie C20 PLO338600045	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Toruń	Polska	29.12.2028	1,40 (Zmienny kupon)	1 000,	2500	2 502	2 502	0,05%
Masto Toruń Serie D20 PLO338600037	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Toruń	Polska	31.12.2029	1 000,	2500	2 502	2 502	0,05%	
Gmina Biała Rawska Serie A20 PLO266400059	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Biała Rawska	Polska	15.12.2032	1,54 (Zmienny kupon)	1 000,	1300	1 304	1 305	0,02%
Gmina Biała Rawska Serie B20 PLO264000067	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Biała Rawska	Polska	15.12.2033	1,54 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 004	1 004	0,02%
Bank Gospodarstwa Krajowego PLO00050031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	13.03.2028	1,75 (Stały kupon)	1 000,	161855	161 217	158 662	2,96%
Gmina Iwanowice Serie A20 PLO275500026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Iwanowice	Polska	18.12.2034	1,20 (Zmienny kupon)	1 000,	1200	1 205	1 205	0,02%
Gmina Krasne Serie A20 PLO320600029	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Krasne	Polska	07.12.2027	1,63 (Zmienny kupon)	1 000,	500	503	503	0,01%
Gmina Krasne Serie B20 PLO320600011	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Krasne	Polska	18.12.2031	1,63 (Zmienny kupon)	1 000,	800	806	807	0,02%
Gmina Słupsk Serie B2020 PLO263000054	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Słupsk	Polska	14.12.2030	1,62 (Zmienny kupon)	1 000,	3500	3 509	3 511	0,07%
Gmina Lomianki Serie F2020 PLO306100028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lomianki	Polska	15.12.2026	1,27 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 002	1 002	0,02%
Gmina Lomianki Serie F20 PLO306100069	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lomianki	Polska	16.12.2030	1,27 (Zmienny kupon)	1 000,	1500	1 504	1 505	0,03%
Masto Mysłowice Serie B20 PLO332300022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Mysłowice	Polska	30.12.2030	1,37 (Zmienny kupon)	1 000,	3000	3 008	3 008	0,06%
Masto Mysłowice Serie C20 PLO332300030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Mysłowice	Polska	30.12.2031	1,37 (Zmienny kupon)	1 000,	1000	1 003	1 003	0,02%
Masto Mysłowice Serie E20 PLO332300055	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Mysłowice	Polska	30.12.2033	1,37 (Zmienny kupon)	1 000,	7000	7 025	7 024	0,13%
Miejskie Przedsiębiorstwo Oczyszczania w M. St. Warszawie Sp. z o.o. Serie A201 PLO276700047	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Miejskie Przedsiębiorstwo Oczyszczania w M. St. Warszawie Sp. z o.o.	Polska	31.12.2040	2,91 (Zmienny kupon)	10 000,	500	5 000	5 000	0,09%
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000050	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Polski Fundusz Rozwoju S.A.	Polska	05.03.2030	2,00 (Stały kupon)	1 000 000,	25	25 258	24 368	0,46%
PKO Bank Hipoteczny S.A. Serie PKOBH221003 PLO219200238	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKO Bank Hipoteczny S.A.	Polska	03.10.2022	0,56 (Zmienny kupon)	500 000,	100	50 000	50 071	0,33%
PKN Orlen S.A. Serie D PLO3037100016	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	PKN Orlen S.A.	Polska	25.03.2031	2,88 (Stały kupon)	100 000,	180	17 898	18 037	0,34%
Powiat Płocki Serie X	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Powiat Płocki	Polska	28.11.2029	1,55 (Zmienny kupon)	1 000,	2000	2 007	2 009	0,04%
Toyota Leasing Polska Sp. z o.o. Serie TLP0324 PLO338400016	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Toyota Leasing Polska Sp. z o.o.	Polska	18.03.2024	0,86 (Zmienny kupon)	100 000,	60	6 000	6 002	0,11%
Masto Chorzów - Masto na prawach Powiatu Serie A20 PLO336200012	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Chorzów - Masto na prawach Powiatu	Polska	21.12.2029	1,30 (Zmienny kupon)	1 000,	3000	3 007	3 008	0,06%
Gmina Lublin Serie A21 PLO299500010	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Gmina Lublin	Polska	30.04.2031	1,15 (Zmienny kupon)	1 000,	20000	20 114	20 149	0,38%
Masto Słupsk Serie C	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Słupsk	Polska	24.05.2024	2,41 (Zmienny kupon)	100 000,	25	2 558	2 563	0,05%
Masto Słupsk Serie E	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Masto Słupsk	Polska	25.05.2026	2,41 (Zmienny kupon)	100 000,	20	2 069	2 073	0,04%
Santander Consumer Bank S.A. Serie SCB00047 PLO204400017	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Consumer Bank S.A.	Polska	03.04.2023	0,75 (Zmienny kupon)	1 000,	50000	50 000	50 092	0,94%
Toyota Leasing Polska Sp. z o.o. Serie TLP0524 PLO338400024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Toyota Leasing Polska Sp. z o.o.	Polska	20.05.2024	0,86 (Zmienny kupon)	100 000,	87	8 700	8 708	0,16%
Volkswagen Financial Services Polska Sp. z o.o. Serie VWFS003 120423 PLO309000035	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Volkswagen Financial Services Polska Sp. z o.o.	Polska	12.04.2023	0,89 (Zmienny kupon)	1 000,	80000	80 000	80 154	1,50%
Suma:								4 631 223		4 656 332	87,03%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 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	-14 128	-0.29%
Aktywny rynek regulowany							0	0	0.00%
Aktywny rynek nieregulowany							0	0	0.00%
Nienotowane na aktywnym rynku							0	-14 128	-0.29%
Forward Waluta CZK FWB09048 15.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	CZK	1	0	1	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07305 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	-23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07313 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	-25	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07329 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07330 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	7	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07340 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	9	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07341 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	1	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07351 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	19	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07361 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07362 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	9	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07363 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EUR	1	0	14	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07364 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	EUR	1	0	-14	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07400 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EUR	1	0	-13	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07414 21.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	512	0.01%
Forward Waluta EUR FWB09013 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	EUR	1	0	499	0.01%
Forward Waluta EUR FWB09056 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EUR	1	0	-43	0.00%
Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	EUR	1	0	675	0.01%
Forward Waluta EUR FWB11001 16.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	EUR	1	0	-126	0.00%
Forward Waluta EUR FWB11002 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EUR	1	0	1 340	0.03%
Forward Waluta EUR FWC01004 21.01.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EUR	1	0	73	0.00%
Forward Waluta EUR FWC04001 01.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	EUR	1	0	-166	0.00%
Forward Waluta HUF FWB07321 16.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	HUF	1	0	22	0.00%
Forward Waluta HUF FWB07396 16.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	HUF	1	0	-14	0.00%
Forward Waluta USD FWB09005 17.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	USD	1	0	790	0.01%
Forward Waluta USD FWB09023 17.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	USD	1	0	261	0.00%
Forward Waluta USD FWB10006 20.10.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	USD	1	0	-65	0.00%
Interest Rate Swap CC210914 24.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-8 436	-8 352	-0.16%
Interest Rate Swap CC210914 24.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	8 436	8 437	0.16%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-17 236	-18 075	-0.34%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 870	12 874	0.24%
Interest Rate Swap CC220941 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-8 717	-9 038	-0.17%
Interest Rate Swap CC220941 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	8 717	8 722	0.16%
Interest Rate Swap CC220959 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	LIBOR USD STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-26 202	-25 160	-0.47%
Interest Rate Swap CC220959 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	26 202	26 206	0.49%
Interest Rate Swap CC22101 26.10.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA/WIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-25 268	-25 413	-0.47%
Interest Rate Swap CC22101 26.10.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	25 268	25 282	0.47%
Interest Rate Swap CC23014 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna EURIBOR	1	-50 220	-49 793	-0.93%
Interest Rate Swap CC23014 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	50 220	50 273	0.94%
Interest Rate Swap CC23015 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-14 784	-14 837	-0.28%
Interest Rate Swap CC23015 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	14 784	14 792	0.28%
Interest Rate Swap CC23018 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 247	-12 175	-0.23%
Interest Rate Swap CC23018 19.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 247	12 254	0.23%
Interest Rate Swap CC230611 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 137	-9 046	-0.17%
Interest Rate Swap CC230611 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	9 137	9 140	0.17%
Interest Rate Swap CC23069 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 679	-5 659	-0.11%
Interest Rate Swap CC23069 07.06.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 679	5 681	0.11%
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	-59 317	-1.11%
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	58 946	1.10%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Interest Rate Swap CC230715 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-61 880	-63 879	-1.19%
Interest Rate Swap CC230715 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	61 880	62 764	1.17%
Interest Rate Swap CC23078 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-44 675	-45 628	-0.85%
Interest Rate Swap CC23078 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	44 675	45 293	0.85%
Interest Rate Swap CC230811 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-25 520	-25 722	-0.48%
Interest Rate Swap CC230811 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	25 520	25 622	0.48%
Interest Rate Swap CC230815 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-12 444	-12 861	-0.24%
Interest Rate Swap CC230815 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 444	12 492	0.23%
Interest Rate Swap CC230818 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-24 888	-25 722	-0.48%
Interest Rate Swap CC230818 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	24 888	24 979	0.47%
Interest Rate Swap CC230821 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-24 789	-25 722	-0.48%
Interest Rate Swap CC230821 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	24 789	24 861	0.46%
Interest Rate Swap CC230825 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-12 534	-12 861	-0.24%
Interest Rate Swap CC230825 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR	1	12 534	12 559	0.23%
Interest Rate Swap CC230827 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-25 024	-25 722	-0.48%
Interest Rate Swap CC230827 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	25 024	25 077	0.47%
Interest Rate Swap CC23083 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-13 024	-12 777	-0.24%
Interest Rate Swap CC23083 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	13 024	13 029	0.24%
Interest Rate Swap CC23085 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-15 162	-15 154	-0.28%
Interest Rate Swap CC23085 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	15 162	15 179	0.28%
Interest Rate Swap CC23088 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-13 007	-12 867	-0.24%
Interest Rate Swap CC23088 23.08.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	13 007	13 012	0.24%
Interest Rate Swap CC231010 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-17 245	-17 739	-0.33%
Interest Rate Swap CC231010 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR	1	17 245	17 429	0.33%
Interest Rate Swap CC23103 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	BUBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-48 880	-50 446	-0.94%
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	48 905	0.91%
Interest Rate Swap CC23104 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-48 985	-50 471	-0.94%
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	49 010	0.92%
Interest Rate Swap CC23109 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-16 980	-17 012	-0.32%
Interest Rate Swap CC23109 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	16 980	16 989	0.32%
Interest Rate Swap CC240133 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-13 855	-13 782	-0.26%
Interest Rate Swap CC240133 15.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	13 855	13 872	0.26%
Interest Rate Swap CC240134 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-24 690	-24 634	-0.46%
Interest Rate Swap CC240134 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	24 690	24 702	0.46%
Interest Rate Swap CC240135 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-26 856	-26 914	-0.50%
Interest Rate Swap CC240135 05.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	26 856	26 870	0.50%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 049	-5 383	-0.10%
Interest Rate Swap CC240714 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 049	5 055	0.09%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-10 011	-10 628	-0.20%
Interest Rate Swap CC240716 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	10 011	10 023	0.19%
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	-29 800	-0.56%
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	28 322	0.53%
Interest Rate Swap CC24073 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	9 120	9 131	0.17%
Interest Rate Swap CC24073 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-9 120	-9 788	-0.18%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Interest Rate Swap CC240733 08.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-20 360	-20 167	-0.38%
Interest Rate Swap CC240733 08.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	20 360	20 371	0.38%
Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	15 747	15 767	0.29%
Interest Rate Swap CC24075 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-15 747	-16 476	-0.31%
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	-5 330	-0.10%
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	4 980	0.09%
Interest Rate Swap CC24124 12.12.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-34 850	-35 453	-0.66%
Interest Rate Swap CC24124 12.12.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	34 850	35 168	0.66%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-6 909	-8 914	-0.17%
Interest Rate Swap CC250113 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	6 909	8 361	0.16%
Interest Rate Swap CC250121 27.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-45 385	-45 164	-0.84%
Interest Rate Swap CC250121 27.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	45 385	45 484	0.85%
Interest Rate Swap CC250123 27.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna EURIBOR	1	-45 384	-45 164	-0.84%
Interest Rate Swap CC250123 27.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	45 384	45 475	0.85%
Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	11 494	11 508	0.21%
Interest Rate Swap CC25014 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-11 494	-12 083	-0.23%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-5 714	-6 085	-0.11%
Interest Rate Swap CC25018 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	5 714	5 721	0.11%
Interest Rate Swap CC250213 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-41 167	-41 530	-0.78%
Interest Rate Swap CC250213 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	41 167	41 186	0.77%
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	-22 893	-0.43%
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	22 811	0.43%
Interest Rate Swap CC250230 17.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-16 846	-17 733	-0.33%
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	17 182	0.32%
Interest Rate Swap CC25026 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-41 186	-41 545	-0.78%
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	41 205	0.77%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-13 526	-14 738	-0.28%
Interest Rate Swap CC25093 09.09.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	13 526	13 540	0.25%
Interest Rate Swap CC26014 19.01.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna EURIBOR	1	-52 299	-51 933	-0.97%
Interest Rate Swap CC26014 19.01.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR	1	52 299	52 520	0.98%
Interest Rate Swap CC26023 02.02.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna EURIBOR	1	-36 285	-36 136	-0.67%
Interest Rate Swap CC26023 02.02.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	36 285	36 350	0.68%
Interest Rate Swap CC26058 27.05.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-13 446	-13 555	-0.25%
Interest Rate Swap CC26058 27.05.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	13 446	13 510	0.25%
Interest Rate Swap CC26091 03.03.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	EURIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	72 480	73 086	1.36%
Interest Rate Swap CC26091 21.09.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-72 480	-72 321	-1.35%
Interest Rate Swap CC26094 29.01.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna EURIBOR	1	-25 774	-25 990	-0.49%
Interest Rate Swap CC26094 29.01.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	25 774	25 947	0.48%
Interest Rate Swap CC270212 10.02.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-20 000	-19 056	-0.36%
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	20 009	0.37%
Interest Rate Swap CC27105 08.10.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 583	-4 364	-0.08%
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	0.09%
Interest Rate Swap CC271110 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-17 350	-17 732	-0.33%
Interest Rate Swap CC271110 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR	1	17 350	17 715	0.33%
Interest Rate Swap CC271112 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STALA - ZMIENNAWIBOR STOPA STALA - ZMIENNA	1	-17 580	-17 732	-0.33%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Interest Rate Swap CC271112 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	17 580	17 837	0.33%
Interest Rate Swap CC271118 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA/WIBOR STOPA STAŁA-ZMIENNA	1	-26 064	-26 599	-0.50%
Interest Rate Swap CI230322R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-317	-0.01%
Interest Rate Swap CI230326R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-267	0.00%
Interest Rate Swap CI230330R 17.03.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-91	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 STAŁAZMIENNA	1	0	-460	-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	5	0.00%
Interest Rate Swap CI230718R 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	41	0.00%
Interest Rate Swap CI230719R 07.07.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	54	0.00%
Interest Rate Swap CI23128R 11.12.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	120	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	-151	0.00%
Interest Rate Swap CI240734R 09.07.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	138	0.00%
Interest Rate Swap CI250128R 20.01.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	137	0.00%
Interest Rate Swap CI250225R 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	793	0.01%
Interest Rate Swap CI250237R 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-521	-0.01%
Interest Rate Swap CI250240R 14.02.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-539	-0.01%
Interest Rate Swap CI250629R 24.06.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	65	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 STAŁAZMIENNA	1	0	-93	0.00%
Interest Rate Swap CI260440R 06.04.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	-970	-0.02%
Interest Rate Swap CI260929R 20.09.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	665	0.01%
Interest Rate Swap CI260939R 20.09.2026	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	92	0.00%
Interest Rate Swap CI280566R 27.05.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	-46	0.00%
Interest Rate Swap CI42048R 03.04.2042	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁAZMIENNA	1	0	615	0.01%
Interest Rate Swap IR210713R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	680	0.01%
Interest Rate Swap IR21078R 26.07.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-815	-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	-161	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	-98	0.00%
Interest Rate Swap IR21114R 08.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-13	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	-1 376	-0.03%
Interest Rate Swap IR22027R 07.02.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 212	-0.02%
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	-1 076	-0.02%
Interest Rate Swap IR230132R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 432	-0.03%
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	-798	-0.01%
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	-823	-0.02%
Interest Rate Swap IR230139R 25.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 898	-0.04%
Interest Rate Swap IR231011R 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	56	0.00%
Interest Rate Swap IR23108R 25.10.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 739	-0.03%
Interest Rate Swap IR240114R 25.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-174	0.00%
Interest Rate Swap IR240116R 25.01.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-28	0.00%
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	-1 043	-0.02%
Interest Rate Swap IR240517R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-1 174	-0.02%
Interest Rate Swap IR240524R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-938	-0.02%
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	-871	-0.02%
Interest Rate Swap IR240531R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-639	-0.01%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Interest Rate Swap IR240545R 25.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-86	0.00%
Interest Rate Swap IR240547R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-136	0.00%
Interest Rate Swap IR240550R 24.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank SA	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	37	0.00%
Interest Rate Swap IR240553R 27.05.2024	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-1	0.00%
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	-412	-0.01%
Interest Rate Swap IR250313R 31.03.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-402	-0.01%
Interest Rate Swap IR25033R 31.03.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	424	0.01%
Interest Rate Swap IR250716R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	-731	-0.01%
Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 945	-0.04%
Interest Rate Swap IR270410R 27.04.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 274	0.02%
Interest Rate Swap IR270411R 27.04.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 257	0.02%
Interest Rate Swap IR270416R 27.04.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	2 224	0.04%
Interest Rate Swap IR270418R 27.04.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	638	0.01%
Interest Rate Swap IR27044R 27.04.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR	1	0	2 195	0.04%
Interest Rate Swap IR27063R 07.06.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 181	0.02%
Interest Rate Swap IR27065R 07.06.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 658	0.03%
Interest Rate Swap IR28032R 12.03.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	113	0.00%
Interest Rate Swap IR280420R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	2 560	0.05%
Interest Rate Swap IR280431R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	880	0.02%
Interest Rate Swap IR280436R 25.04.2028	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 290	0.02%
Interest Rate Swap IR30031R 05.03.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 032	0.02%
Interest Rate Swap IR30038R 18.03.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	mBank S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	160	0.00%
Interest Rate Swap IR300610R 05.06.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	2 962	0.06%
Interest Rate Swap IR300626R 05.06.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	Stopa zmienna WIBOR/Stopa stała WIBOR	1	0	404	0.01%
Interest Rate Swap IR30062R 05.06.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 407	0.03%
Interest Rate Swap IR30064R 05.06.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	1 412	0.03%
Interest Rate Swap IR301012R 25.10.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-463	-0.01%
Interest Rate Swap IR30102R 25.10.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	ING Bank Śląski S.A.	Polska	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	947	0.02%
Interest Rate Swap IR30109R 25.10.2030	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-354	-0.01%
Interest Rate Swap IR310316R 19.03.2031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-74	0.00%
Interest Rate Swap IR31051R 25.05.2031	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała WIBOR/Stopa zmienna WIBOR	1	0	-1 723	-0.03%
Interest Rate Swap CC21096 20.09.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	17 236	17 252	0.32%
Interest Rate Swap CC21101 14.10.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 647	-9 013	-0.17%
Interest Rate Swap CC21101 14.10.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 647	8 654	0.16%
Interest Rate Swap CC21111 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 286	-4 520	-0.08%
Interest Rate Swap CC21111 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	4 286	4 287	0.08%
Interest Rate Swap CC21116 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa stała EURIBOR	1	-4 456	-4 700	-0.09%
Interest Rate Swap CC21116 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. Morgan Chase & Co	Stany Zjednoczone	Stopa zmienna WIBOR	1	4 456	4 458	0.08%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 572	-9 023	-0.17%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 572	8 574	0.16%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-8 592	-9 021	-0.17%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	8 592	8 594	0.16%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 897	-13 532	-0.25%
Interest Rate Swap CC21121 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 897	12 900	0.24%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Interest Rate Swap CC211216 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 834	-13 533	-0.25%
Interest Rate Swap CC211216 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	12 834	12 837	0.24%
Interest Rate Swap CC211217 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	46 000	45 256	0.85%
Interest Rate Swap CC211217 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	-46 000	-46 010	-0.86%
Interest Rate Swap CC211220 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 453	-4 506	-0.08%
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	0.08%
Interest Rate Swap CC211221 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-58 260	-58 579	-1.09%
Interest Rate Swap CC211221 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	58 260	58 272	1.09%
Interest Rate Swap CC211222 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa stała EURIBOR	1	-16 153	-15 765	-0.29%
Interest Rate Swap CC211222 20.12.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Santander Bank Polska S.A.	Polska	Stopa zmienna WIBOR	1	16 153	16 156	0.30%
Interest Rate Swap CC22011 18.01.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-4 324	-4 511	-0.08%
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	0.08%
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	-12 745	-0.24%
Interest Rate Swap CC22083 24.08.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	Stopa zmienna WIBOR	1	12 674	12 679	0.24%
Interest Rate Swap CC220915 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR	1	-12 870	-13 625	-0.25%
Interest Rate Swap CC227118 19.11.2027	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa zmienna WIBOR	1	26 064	26 611	0.50%
Interest Rate Swap CI211115R 26.11.2021	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	25	0.00%
Interest Rate Swap CI22031R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-331	-0.01%
Interest Rate Swap CI220354R 23.03.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	40	0.00%
Interest Rate Swap CI220415R 04.04.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-12	0.00%
Interest Rate Swap CI220926R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	The Goldman Sachs Group Inc.	Stany Zjednoczone	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-93	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 STAŁA/ZMIENNA	1	0	-75	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 STAŁA/ZMIENNA	1	0	-227	0.00%
Interest Rate Swap CI220936R 05.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	24	0.00%
Interest Rate Swap CI220950R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-141	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 STAŁA/ZMIENNA	1	0	-153	0.00%
Interest Rate Swap CI220953R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-168	0.00%
Interest Rate Swap CI220957R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-61	0.00%
Interest Rate Swap CI220958R 26.09.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	LIBOR USD STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-5	0.00%
Interest Rate Swap CI221110R 28.11.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-114	0.00%
Interest Rate Swap CI22114R 16.12.2025	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-137	0.00%
Interest Rate Swap CI22118R 20.11.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	Wielka Brytania	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-134	0.00%
Interest Rate Swap CI221211R 12.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-93	0.00%
Interest Rate Swap CI221214R 23.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-96	0.00%
Interest Rate Swap CI22123R 05.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	Stopa stała EURIBOR/Stopa zmienna EURIBOR	1	0	72	0.00%
Interest Rate Swap CI22124R 05.12.2022	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	J.P. MORGAN AG	Niemcy	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-95	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	143	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	8	0.00%
Interest Rate Swap CI23016R 06.01.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	BNP PARIBAS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-308	-0.01%
Interest Rate Swap CI230231R 10.02.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	Goldman Sachs Bank Europe SE	Niemcy	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-115	0.00%
Interest Rate Swap CI230234R 10.02.2023	Nienotowane na aktywnym rynku	Nie dotyczy	SOCIETE GENERALE PARIS	Francja	PRIBOR STOPA STAŁA/ZMIENNA	1	0	-112	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 STAŁA/ZMIENNA	1	0	-421	-0.01%
Suma:							0	-14 128	-0.29%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 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						170 000		170 126	3.18%
Lokata terminowa 364 dniowa do 2021-11-05	Bank BGŻ BNP PARIBAS S.A.	Polska	PLN	0.15 (Stały kupon)	100 000	100 000	100 097	100 097	1.87%
Lokata terminowa 273 dniowa do 2021-10-12	Bank BGŻ BNP PARIBAS S.A.	Polska	PLN	0.09 (Stały kupon)	70 000	70 000	70 029	70 029	1.31%
W walutach państw nienależących do OECD						0		0	0.00%
Suma:						170 000		170 126	3.18%

Tabele dodatkowe

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			789 471	782 957	14.62%
Dłużne papiery wartościowe		601 426	789 471	782 957	14.62%
Suma:			789 471	782 957	14.62%

*) 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	107 227	2.01%
Grupa Kapitałowa mBank S.A.	27 889	0.52%
Grupa ING	-1 456	-0.03%
Grupa Banku PKO BP	99 794	1.87%
Grupa PZU S.A.	89 886	1.65%
Suma:	323 340	6.02%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 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 PL0000500260	105 184	1.96%
Bank Gospodarstwa Krajowego PL0000500278	48 932	0.91%
Bank Gospodarstwa Krajowego PL0000500286	63 684	1.19%
Enea S.A. Seria ENEA0624 PLENEA000096	24 719	0.46%
Enea S.A. Seria EX122017	96 269	1.80%
Forward Waluta EUR FWB07305 21.07.2021	-23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07313 21.07.2021	-26	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07329 21.07.2021	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07330 21.07.2021	7	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07340 21.07.2021	9	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07341 21.07.2021	1	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07351 21.07.2021	19	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07361 21.07.2021	23	0.00%
Forward Waluta EUR FWB07414 21.07.2021	0	0.00%
Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021	512	0.01%
Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021	675	0.01%
Forward Waluta HUF FWB07396 16.07.2021	-14	0.00%
Forward Waluta USD FWB09023 17.09.2021	261	0.00%
Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. Seria C PLGPW0000066	13 316	0.25%
Gmina Biała Rawska Seria A20 PLO260400059	1 305	0.02%
Gmina Biała Rawska Seria B20 PLO260400067	1 004	0.02%
Gmina Dopiewo Seria B/20 PLO266500084	2 507	0.05%
Gmina Iwanowice Seria A20 PLO275500026	1 205	0.02%
Gmina Kęty Seria C20 PLO321700018	1 005	0.02%
Gmina Krasne Seria A20 PLO320600029	503	0.01%
Gmina Krasne Seria B20 PLO320600011	807	0.02%
Gmina Lesznowola Seria D20 PLO275200056	1 009	0.02%
Gmina Lesznowola Seria E20 PLO275200049	1 211	0.02%
Gmina Lesznowola Seria G20 PLO275200031	4 038	0.08%
Gmina Lesznowola Seria H20 PLO275200064	2 020	0.04%
Gmina Lublin Seria A21 PLO299500010	20 149	0.38%
Gmina Łomianki Seria A20 PLO306100010	1 003	0.02%
Gmina Łomianki Seria B20 PLO306100028	1 002	0.02%
Gmina Łomianki Seria F20 PLO306100069	1 505	0.03%
Gmina Miasta Jaworzna Seria A20 PLO318800011	1 004	0.02%
Gmina Miasta Jaworzna Seria B20 PLO318800029	1 004	0.02%
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	1 158	0.02%
Gmina Miejska Tczew Seria A20 PLO314000038	2 007	0.04%
Gmina Miejska Tczew Seria B20 PLO314000020	4 016	0.07%
Gmina Miejska Tczew Seria C20 PLO314000012	2 007	0.04%
Gmina Piaseczno Seria A20 PLO259600032	4 005	0.07%
Gmina Słupsk Seria A/2020 PLO263000047	2 010	0.04%
Gmina Słupsk Seria B/2020 PLO263000054	3 511	0.07%
Gmina Suchy Las Seria B20 PLO311400025	1 005	0.02%

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Gmina Suchy Las Seria C20 PLO311400033	1 005	0.02%
Gmina Suchy Las Seria D20 PLO311400041	1 608	0.03%
Gmina Suchy Las Seria E20 PLO311400058	1 004	0.02%
Gmina Suchy Las Seria F20 PLO311400066	2 008	0.04%
Interest Rate Swap CC220959 26.09.2022	26 206	0.49%
Interest Rate Swap CC220959 26.09.2022	-25 160	-0.47%
Interest Rate Swap CC26058 27.05.2026	13 510	0.25%
Interest Rate Swap CC26058 27.05.2026	-13 555	-0.25%
Interest Rate Swap CC26094 29.01.2026	25 947	0.48%
Interest Rate Swap CC26094 29.01.2026	-25 990	-0.49%
Interest Rate Swap IR21078R 26.07.2021	-878	-0.02%
Interest Rate Swap IR231011R 25.10.2023	-1 543	-0.03%
Interest Rate Swap IR23108R 25.10.2023	-3 283	-0.06%
Interest Rate Swap IR250313R 31.03.2025	-933	-0.02%
Interest Rate Swap IR25033R 31.03.2025	-509	-0.01%
Interest Rate Swap IR25077R 25.07.2025	-3 944	-0.07%
Interest Rate Swap IR27044R 27.04.2027	-2 058	-0.04%
mFinance France S.A. XS1143974159	2 305	0.04%
Miasto Chorzów - Miasto na prawach Powiatu Seria A20 PLO336200012	3 008	0.06%
Miasto Łódź Seria LODZ 1022 101022	8 313	0.16%
Miasto Łódź Seria LODZ0924	5 059	0.09%
Miasto Mysłowice Seria B20 PLO332300022	3 008	0.06%
Miasto Mysłowice Seria C20 PLO332300030	1 003	0.02%
Miasto Mysłowice Seria E20 PLO332300055	7 024	0.13%
Miasto Poznań Seria A2020 PLO318600015	10 021	0.19%
Miasto Poznań Seria B2020 PLO318600023	15 043	0.28%
Miasto Poznań Seria C2020 PLO318600031	5 010	0.09%
Miasto Poznań Seria E2020 PLO318600056	5 019	0.09%
Miasto Poznań Seria F2020 PLO318600064	10 034	0.19%
Miasto Poznań Seria H	5 008	0.09%
Miasto Słupsk Seria C	2 563	0.05%
Miasto Słupsk Seria E	2 073	0.04%
Miasto Toruń Seria B20 PLO338600011	1 501	0.03%
Miasto Toruń Seria C20 PLO338600045	2 502	0.05%
Miasto Toruń Seria D20 PLO338600037	2 502	0.05%
Miasto Zabrze Seria ZAB BB 020423	10 028	0.19%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. PLBPHHP00176	8 366	0.16%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. PLBPHHP00184	10 093	0.19%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. PLBPHHP00259	35 051	0.65%
Pekao Bank Hipoteczny S.A. PLBPHHP00267	13 595	0.25%
Pekao Leasing Sp z o.o. Seria PEKALE63 PLO234800301	22 604	0.42%
PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. Seria PGE002210526 PLPGER000069	20 032	0.37%
PKN Orlen S.A. Seria D PLO037100016	18 037	0.34%
PKO Bank Hipoteczny S.A. PLPKOHP00074	5 018	0.09%
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000019	1 007	0.02%
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000027	100 121	1.87%
Polski Fundusz Rozwoju S.A. PLPFR0000050	24 368	0.46%
Toyota Leasing Polska Sp. z o.o. Seria TLP0324 PLO338400016	6 002	0.11%
Toyota Leasing Polska Sp. z o.o. Seria TLP0524 PLO338400024	8 708	0.16%
Volkswagen Financial Services Polska Sp. z o.o. Seria VWFS003 120423 PLO309000035	80 154	1.50%
Województwo Pomorskie Seria WPOM G 151222	4 419	0.08%
WZ0524 PL0000110615	100 404	1.87%
WZ1126 PL0000113130	4 008	0.07%
Suma:	979 028	18.29%

Bilans

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2021

Bilans

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

BILANS	30.06.2021	31.12.2020
I. Aktywa	5 355 570	4 318 988
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	183 965	84 239
2. Należności	2	25 500
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	0	0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	2 637 805	1 861 061
- dłużne papiery wartościowe	2 637 805	1 861 061
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	2 533 798	2 348 188
- dłużne papiery wartościowe	2 325 120	2 228 100
6. Nieruchomości	0	0
7. Pozostałe aktywa	0	0
II. Zobowiązania	964 817	206 100
III. Aktywa netto (I - II)	4 390 753	4 112 888
IV. Kapitał funduszu	4 011 588	3 732 620
1. Kapitał wpłacony	14 396 857	13 663 934
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-10 385 269	-9 931 314
V. Dochody zatrzymane	391 514	401 760
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	367 581	352 444
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	23 933	49 316
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	-12 349	-21 492
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	4 390 753	4 112 888
Liczba zarejestrowanych jednostek uczestnictwa	334 920 442.533	316 905 446.090
Kategoria A	334 409 871.800	316 905 446.090
Kategoria E	0.000	0.000
Kategoria F	0.000	0.000
Kategoria I	510 570.733	0.000
Kategoria J	0.000	0.000
Kategoria K	0.000	0.000
Kategoria L	0.000	0.000
Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa *	13.11	12.98
Kategoria A	12.98	12.98
Kategoria E	100.00	100.00
Kategoria F	100.00	100.00
Kategoria I	99.91	100.00
Kategoria J	1 000.00	1 000.00
Kategoria K	1 000.00	1 000.00
Kategoria L	1 000.00	1 000.00

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

Rachunek wyniku z operacji

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2021

Rachunek Wyniku

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

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	01-01-2021 - 30-06-2021	01-01-2020 - 31-12-2020	01-01-2020 - 30-06-2020
I. Przychody z lokat	32 129	97 011	60 228
Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0	0
Przychody odsetkowe	32 092	97 011	60 228
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0
Dodatnie saldo różnic kursowych	0	0	0
Pozostałe	37	0	0
II. Koszty funduszu	16 992	40 796	28 419
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	10 952	32 831	16 983
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0
Oplaty dla depozytariusza	457	633	245
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów	0	0	0
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	3	12	3
Usługi w zakresie rachunkowości	0	0	0
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0
Usługi prawne	0	0	0
Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0	0
Koszty odsetkowe	1 587	7 209	6 281
Koszty związane z prowadzeniem nieruchomości	0	0	0
Ujemne saldo różnic kursowych	3 907	65	4 884
Pozostałe	86	46	23
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	16 992	40 796	28 419
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	15 137	56 215	31 809
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	-16 240	-4 141	-31 905
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-25 383	8 856	-26 273
- z tytułu różnic kursowych	-2 977	26 739	31 113
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	9 143	-12 997	-5 632
- z tytułu różnic kursowych	10 284	-7 591	5 942
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	-1 103	52 074	-96

Wynik z operacji przypadający na jednostkę uczestnictwa *	0.13	0.21	0.04
Kategoria A	0.00	0.21	0.04
Kategoria I	-0.09	0.00	0.00
Kategoria E	0.00	0.00	0.00
Kategoria F	0.00	0.00	0.00
Kategoria J	0.00	0.00	0.00
Kategoria K	0.00	0.00	0.00
Kategoria L	0.00	0.00	0.00

*) 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')

**) Jednostki uczestnictwa nowych kategorii wpisane do statutów subfunduszy 31.12.2020 w danych za poprzednie okresy zostały zaprezentowane z wartością zerową.

Zestawienie zmian w aktywach netto

Sprawozdanie półroczne - za okres półroczny kończący się 30.06.2021

Zestawienie zmian

[Kwoty w tys. zł / wartości JU w zł]

ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	01-01-2021 - 30-06-2021	01-01-2020 - 31-12-2020
I. Zmiana wartości aktywów netto		
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	4 112 888	5 010 447
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy	-1 103	52 074
a) przychody z lokat netto	15 137	56 215
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-25 383	8 856
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	9 143	-12 997
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	-1 103	52 074
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)	278 968	-949 633
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału)	732 923	1 338 240
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału)	-453 955	-2 287 873
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym (3-4+-5)	277 865	-897 559
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	4 390 753	4 112 888
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	4 357 696	4 101 389
II. Zmiana liczby jednostek uczestnictwa		
Zmiana liczby jednostek w okresie sprawozdawczym w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	52 202 430.536	104 227 620.864
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	34 698 004.759	179 583 463.191
Saldo zmian	17 504 425.710	-75 355 842.308
Kategoria I		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	543 377.724	0.000
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	32 806.991	0.000
Saldo zmian	510 570.733	0.000
Zmiana liczby jednostek od początku działalności funduszu w rozbiciu na kategorie		
Kategoria A		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	1 183 916 046.900	1 131 713 616.364
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	849 506 175.070	814 808 170.311
Saldo zmian	334 409 871.800	316 905 446.090
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	334 409 871.800	316 905 446.090
Kategoria I		
Liczba zbytych jednostek uczestnictwa	543 377.724	0.000
Liczba odkupionych jednostek uczestnictwa	32 806.991	0.000
Saldo zmian	510 570.733	0.000
Przewidywana liczba jednostek uczestnictwa	510 570.733	0.000

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

III. Zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa				
1. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A	12.98		12.77	
Kategoria E	100.00		100.00	
Kategoria F	100.00		100.00	
Kategoria I	100.00		100.00	
Kategoria J	1 000.00		1 000.00	
Kategoria K	1 000.00		1 000.00	
Kategoria L	1 000.00		1 000.00	
2. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego				
Kategoria A	12.98		12.98	
Kategoria E	100.00		100.00	
Kategoria F	100.00		100.00	
Kategoria I	99.91		100.00	
Kategoria J	1 000.00		1 000.00	
Kategoria K	1 000.00		1 000.00	
Kategoria L	1 000.00		1 000.00	
3. Procentowa zmiana wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	0.00%		1.64%	
Kategoria E	0.00%		0.00%	
Kategoria F	0.00%		0.00%	
Kategoria I	-0.18%		0.00%	
Kategoria J	0.00%		0.00%	
Kategoria K	0.00%		0.00%	
Kategoria L	0.00%		0.00%	
4. Minimalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	12.96	17.05.2021	12.64	23.03.2020
Kategoria E	100.00	04.01.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria F	100.00	04.01.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria I	99.76	17.05.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria J	1 000.00	04.01.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria K	1 000.00	15.04.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria L	1 000.00	04.01.2021	1 000.00	31.12.2020
5. Maksymalna wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa w okresie sprawozdawczym i data wyceny				
Kategoria A	13.03	26.04.2021	12.99	28.12.2020
Kategoria E	100.00	04.01.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria F	100.00	04.01.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria I	100.33	27.04.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria J	1 000.00	04.01.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria K	1 000.00	15.04.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria L	1 000.00	04.01.2021	1 000.00	31.12.2020
6. Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa wg ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym				
Kategoria A	12.98	30.06.2021	12.98	30.12.2020
Kategoria E	100.00	30.06.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria F	100.00	30.06.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria I	99.91	30.06.2021	100.00	31.12.2020
Kategoria J	1 000.00	30.06.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria K	1 000.00	30.06.2021	1 000.00	31.12.2020
Kategoria L	1 000.00	30.06.2021	1 000.00	31.12.2020
Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:		0.79%	0.99%	
Wynagrodzenie dla Towarzystwa		0.51%	0.80%	
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję		-	-	
Opłaty dla depozytariusza		0.02%	0.02%	
Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów		-	-	
Usługi w zakresie rachunkowości		-	-	
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu		-	-	

**) Jednostki uczestnictwa nowych kategorii wpisane do statutów subfunduszy 31.12.2020 w danych za poprzednie okresy zostały zaprezentowane z wartością zerową.*

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.....	9
Nota - 7	Transakcje przy zobowiązaniu się Subfunduszu lub drugiej strony do odkupu ...	17
Nota - 8	Kredyty i pożyczki.....	17
Nota - 9	Waluty i różnice kursowe.....	18
Nota - 10	Dochody i ich dystrybucja.....	20
Nota - 11	Koszty Subfunduszu.....	21
Nota - 12	Dane porównawcze o Jednostkach Uczestnictwa.....	22

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*). W roku 2021 (1.07.2021 po dacie bilansowej) Fundusz dostosował metody i zasady wyceny aktywów Funduszu (odpowiednio aktualizując politykę rachunkowości Funduszu) w związku z dostosowaniem do przepisów *Rozporządzenia o rachunkowości funduszy* w brzmieniu nadanym *Rozporządzeniem Ministra Finansów, Funduszy i Polityki Regionalnej z 28.12.2020 zmieniającym Rozporządzenie o rachunkowości funduszy*. Dodatkowo informacje w tym zakresie są zaprezentowane w niniejszym sprawozdaniu finansowym (podrozdział '*Zmiana rozporządzenia dot. szczególnych zasad rachunkowości funduszy*') i w prospekcie informacyjnym Funduszu – w wersji ogłoszonej 1.07.2021.

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 S.A.

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 sporządzane jest dla sprawozdania połączonych.

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 oszacowania kwot odzyskiwanych, w prezentacji takich instrumentów jako termin zapadalności wskazany jest termin kontraktowy, pierwotny, a stopy oprocentowania są historyczne.

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

'*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*'

lokata nienotowane na aktywnym rynku'. Prezentacja depozytów obejmuje wartości z uwzględnieniem odsetek naliczonych (bez dodatkowych ujawnień w należnościach).

W 'Zestawieniu lokat - Tabeli Główniej' ujawniane są instrumenty pochodne – zgodnie z prezentacją w 'Zestawieniu lokat – tabelach uzupełniających' – zarówno o ujemnej, jak i dodatniej wartości. W zestawieniu 'Bilans' wyłącznie pozycje na których wynik z wyceny jest dodatni prezentowane są (w ramach pozycji 'Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku'), a składniki lokat o wartości ujemnej stanowią zobowiązanie (i są prezentowane w Nocie 3, przy czym są uwzględnione w 'Zestawieniu lokat – tabelach uzupełniających' oraz Nocie 6).

Prezentacja i klasyfikacja rynków notowania instrumentów dłużnych dokonywana jest w zakresie ich wykorzystania do ustalania wartości godziwej. Pomijane są rynki o relatywnie – w stosunku do posiadanego pakietu instrumentu – niewielkich obrotach. W sytuacji braku danych z rynku – wycena odbywa się 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 '1.4 Przychody z lokat – Dodatnie różnice kursowe'. W przypadku nadwyżki ujemnych różnic kursowych nad dodatnimi – prezentowana jest ona w pozycji '11.12 Koszty funduszu – Ujemne saldo różnic kursowych'.

Jednostkowe sprawozdanie półroczne stanowi składnik połączonego sprawozdania finansowego półrocznego, które w całości i w zakresie poszczególnych sprawozdań jednostkowych: podlega przeglądowi biegłego rewidenta, podlega przekazaniu do Komisji (za pośrednictwem systemu ESPI) i jest ogłaszane na stronie www.pekaotfi.pl.

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 umarzane.
- 11) Przychody z odsetek ujmowane są w księgach rachunkowych na zasadzie memoriałowej.
- 12) Koszty operacyjne ujmowane są w księgach rachunkowych na zasadzie memoriałowej.
- 13) 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 wyliczanej 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 ustalaną 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“)
Serwisy: 'Bloomberg Professional Service', 'Bloomberg Data License'
Dostawcą Cen wykorzystywanych przez Fundusz jest Bloomberg. Najczęściej wykorzystywane są kursy BGN ('Bloomberg Generic Price').
- 3) Modele wykorzystywane na potrzeby wyceny specyficznych instrumentów:
 - Podstawowym modelem stosowanym w zakresie wyliczania wartości pozycji w instrumentach pochodnych typu *swap* (*interest rate swap* oraz *cross-currency interest rate swap*), kontrakty terminowe na przyszłą stopę procentową (*forward rate agreement*) oraz kontraktów terminowej wymiany walut (*currency forward*) oraz określonych instrumentów dłużnych jest metoda wyliczania zdyskontowanych przepływów pieniężnych.
 - 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 rozliczanymi 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	30.06.2021	31.12.2020
Należności	2	25 500
Z tytułu zbytych lokat	0	25 500
Z tytułu instrumentów pochodnych	0	0
Z tytułu zbytych jednostek uczestnictwa albo w ydanych certyfikatów inwestycyjnych	0	0
Z tytułu dywidend	0	0
Z tytułu odsetek	2	0
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	30.06.2021	31.12.2020
Zobowiązania	964 817	206 100
Z tytułu nabytych aktywów	0	1
Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	827 801	86 176
Z tytułu instrumentów pochodnych	52 682	94 995
Z tytułu wpłat na jednostki uczestnictwa albo certyfikaty inwestycyjne	3 709	11 801
Z tytułu odkupionych jednostek uczestnictwa albo w wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	71 551	3 926
Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0	0
Z tytułu 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	9 074	9 201
w tym:		
Zobowiązania z tytułu depozytów zabezpieczających	6 864	5 800
Zobowiązania z tytułu podatku	423	500
Zobowiązania z tytułu wynagrodzenia za zarządzanie	1 654	2 757

Nota - 4 Środki pieniężne i ich ekwiwalenty

Zestawienie środków pieniężnych i ich ekwiwalentów:

NOTA-4 I. STRUKTURA ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH NA RACHUNKACH BANKOWYCH	30.06.2021		31.12.2020	
	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		183 965		84 239
J.P. MORGAN SECURITIES PLC		4 788		6 230
EUR	1 059	4 788	1 350	6 230
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL		0		11 814
EUR	0	0	2 560	11 814
Santander Bank Polska S.A.		0		9 050
PLN	0	0	9 050	9 050
Pow szeczna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.		2 290		2 680
PLN	2 290	2 290	2 680	2 680
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		1 040		1 061
EUR	230	1 040	230	1 061
Santander Biuro Maklerskie		183		187
EUR	40	183	40	187
Bank Handlowy w Warszawie S.A.		0		0
PLN	0	0	0	0
ING Bank Śląski S.A.		640		5 760
PLN	640	640	5 760	5 760
Bank Polska Kasa Opieki S.A.		145 144		9 996
CZK	1	0	1	0
EUR	32 099	145 115	0	2
HUF	1	0	715	9
PLN	0	0	9 865	9 865
USD	8	29	32	120
mBank SA		0		1 180
PLN	0	0	1 180	1 180
BNP PARIBAS		4 973		12 967
EUR	1 100	4 973	2 810	12 967
J.P. MORGAN AG		0		277
EUR	0	0	60	277
BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.		14 961		9 100
PLN	14 961	14 961	9 100	9 100
SOCIETE GENERALE PARIS		9 946		13 937
EUR	2 200	9 946	3 020	13 937

^{*) Dla rozróżnienia przeznaczenia przechnowymienia srodkow w banku depozytariuszu: (a) "Bank Polska Kasa Opieki S.A." - srodki 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	30.06.2021		31.12.2020	
	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	1 584	277	2 297	381
EUR	6 350	28 895	11 845	53 147
HUF	21 948	277	65 101	817
PLN	15 448	15 448	25 172	25 172
USD	319	1 251	2 000	7 732

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	opis ryzyka	Poziom obciążenia ryzykiem	..	Udział w aktywach	Uwagi
1. ryzyko walutowe					
	struktura walutowa [przedstawiona w nocie 9]				
	waluty	166 074	tys. zł	3.1%	
	dłużne papiery wartościowe	1 914 055	tys. zł	35.7%	
	należności – w walutach	141 548	tys. zł	2.6%	
	zobowiązania w walutach	1 279 266	tys. zł	--	
	wartość niezabezpieczona (w podziale na waluty)			0.0%	
		649	tys. EUR		
		-88	tys. USD		
		3 917	tys. CZK		
		69 837	tys. HUF		
2. ryzyko kredytowe					
	obligacje Skarbu Państwa	2 317 667	tys. zł	43.3%	
	korporacyjne papiery wartościowe	1 406 549	tys. zł	26.3%	
	obligacje skarbowe zagraniczne	717 231	tys. zł	13.4%	
	depozyty bankowe	170 126	tys. zł	3.2%	
3. ryzyko przepływów środków pieniężnych wynikającym ze stopy procentowej					
	obligacje o zmiennej stopie procentowej	1 652 392	tys. zł	--	
4. ryzyko wartości godziwej wynikające ze stopy procentowej					
	instrumenty o stałej stopie procentowej (lub zerowej)	3 310 533	tys. zł	--	
5. 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)	1 419 208	tys. zł	26.5%	

Informacje uzupełniające w zakresie ryzyka

- 1) W okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki nierozliczenia się transakcji zawieranych przez Subfundusz.
- 2) Ryzyko kredytowe i ryzyko rozliczeniowe
 - Ryzyko kredytowe 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 (5) z zaangażowaniem ponad 5% aktywów	
1. Skarb Państwa (Polska)	28.8%
2. Bank Gospodarstwa Krajowego	11.6%
3. Ministry of Finance - Czech Republic (CZ)	7.4%
4. PKO Bank Hipoteczny S.A.	7.1%
5. Ministry of Finance - Hungary (HU)	6.0%

3) Ryzyko walutowe

- Ryzyko walutowe ma związek ze zmiennością kursów walut i potencjalną utratą wartości lokat wyrażoną w złotych w przypadku, gdy Subfundusz ma część aktywów denominowanych w walutach obcych oraz odpowiednim zwiększeniem wartości (w złotych) zobowiązań wyrażonych w walutach.
- Subfundusz stosuje zabezpieczenie ryzyka walutowego (związanego ze składnikami portfela bądź środkami pieniężnymi wyrażonymi w walutach innych niż złote) poprzez dokonywanie transakcji terminowej wymiany walut (FX Fwd) po ustalonym kursie wymiany. Informacje na temat wartości i warunków tych zabezpieczeń przedstawione są w 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 S.A. 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 S.A. 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 S.A.) **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 30 czerwca 2021 Fundusz posiadał w portfelu inwestycyjnym Subfunduszu instrumenty pochodne:

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

Kontrakty *FX FWD*, *IRS*

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

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

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

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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Zestawienie posiadanych instrumentów pochodnych

strona 1 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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
1.	Forward Waluta CZK FWB09048 15.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	1	Santander Bank Polska S.A.	1 282 000	CZK	227 908	PLN	15.09.2021	1 282 000	CZK	227 908	PLN	15.09.2021	15.09.2021
2.	Forward Waluta EUR FWB09001 20.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	512	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	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
3.	Forward Waluta EUR FWB10001 14.10.2021 (0)	-	Forward	IRH	675	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	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
4.	Forward Waluta EUR FWB11001 16.11.2021 (0)	-	Forward	IRH	-126	Santander Bank Polska S.A.	5 000 000	EUR	22 537 400	PLN	16.11.2021	5 000 000	EUR	22 537 400	PLN	16.11.2021	16.11.2021
5.	Forward Waluta EUR FWB11002 26.11.2021 (0)	-	Forward	IRH	1 340	BNP PARIBAS	11 730 000	EUR	54 520 043	PLN	26.11.2021	11 730 000	EUR	54 520 043	PLN	26.11.2021	26.11.2021
6.	Forward Waluta EUR FWB07305 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	-23	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	500 000	EUR	2 237 697	PLN	21.07.2021	500 000	EUR	2 237 697	PLN	21.07.2021	21.07.2021
7.	Forward Waluta EUR FWB07313 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	-25	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	980 000	EUR	4 406 179	PLN	21.07.2021	980 000	EUR	4 406 179	PLN	21.07.2021	21.07.2021
8.	Forward Waluta EUR FWB07329 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	0	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	820 000	EUR	3 708 446	PLN	21.07.2021	820 000	EUR	3 708 446	PLN	21.07.2021	21.07.2021
9.	Forward Waluta EUR FWB07330 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	7	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	670 000	EUR	3 036 572	PLN	21.07.2021	670 000	EUR	3 036 572	PLN	21.07.2021	21.07.2021
10.	Forward Waluta EUR FWB07340 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	9	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	720 000	EUR	3 265 187	PLN	21.07.2021	720 000	EUR	3 265 187	PLN	21.07.2021	21.07.2021
11.	Forward Waluta EUR FWB07341 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	1	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	10 278 000	EUR	46 478 966	PLN	21.07.2021	10 278 000	EUR	46 478 966	PLN	21.07.2021	21.07.2021
12.	Forward Waluta EUR FWB07351 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	19	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	650 000	EUR	2 958 705	PLN	21.07.2021	650 000	EUR	2 958 705	PLN	21.07.2021	21.07.2021
13.	Forward Waluta EUR FWB07361 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	23	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	780 000	EUR	3 550 524	PLN	21.07.2021	780 000	EUR	3 550 524	PLN	21.07.2021	21.07.2021
14.	Forward Waluta EUR FWB07362 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	9	SOCIETE GENERALE PARIS	1 070 000	EUR	4 847 992	PLN	21.07.2021	1 070 000	EUR	4 847 992	PLN	21.07.2021	21.07.2021
15.	Forward Waluta EUR FWB07363 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	14	SOCIETE GENERALE PARIS	1 070 000	EUR	4 852 283	PLN	21.07.2021	1 070 000	EUR	4 852 283	PLN	21.07.2021	21.07.2021
16.	Forward Waluta EUR FWB07364 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	-14	Santander Bank Polska S.A.	4 852 343	PLN	1 070 000	EUR	21.07.2021	4 852 343	PLN	1 070 000	EUR	21.07.2021	21.07.2021
17.	Forward Waluta EUR FWB09013 20.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	499	Santander Bank Polska S.A.	17 370 000	EUR	79 133 899	PLN	20.09.2021	17 370 000	EUR	79 133 899	PLN	20.09.2021	20.09.2021
18.	Forward Waluta EUR FWB09056 20.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	-43	BNP PARIBAS	13 000 000	EUR	58 809 062	PLN	20.09.2021	13 000 000	EUR	58 809 062	PLN	20.09.2021	20.09.2021
19.	Forward Waluta EUR FWB04004 21.01.2022 (0)	-	Forward	IRH	73	BNP PARIBAS	7 001 000	EUR	31 857 049	PLN	21.01.2022	7 001 000	EUR	31 857 049	PLN	21.01.2022	21.01.2022
20.	Forward Waluta EUR FWB04001 01.04.2022 (0)	-	Forward	IRH	-166	BNP PARIBAS	4 850 000	EUR	21 896 091	PLN	01.04.2022	4 850 000	EUR	21 896 091	PLN	01.04.2022	01.04.2022
21.	Forward Waluta EUR FWB07400 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	-13	BNP PARIBAS	11 317 933	PLN	2 500 000	EUR	21.07.2021	11 317 933	PLN	2 500 000	EUR	21.07.2021	21.07.2021
22.	Forward Waluta EUR FWB07414 21.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	0	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	320 000	EUR	1 446 935	PLN	21.07.2021	320 000	EUR	1 446 935	PLN	21.07.2021	21.07.2021
23.	Forward Waluta HUF FWB07321 16.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	22	BNP PARIBAS	466 909 000	HUF	6 021 176	PLN	16.07.2021	466 909 000	HUF	6 021 176	PLN	16.07.2021	16.07.2021
24.	Forward Waluta HUF FWB07396 16.07.2021 (0)	-	Forward	IRH	-14	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	2 326 860	PLN	180 000 000	HUF	16.07.2021	2 326 860	PLN	180 000 000	HUF	16.07.2021	16.07.2021
25.	Forward Waluta USD FWB09005 17.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	790	SOCIETE GENERALE PARIS	17 000 000	USD	65 434 700	PLN	17.09.2021	17 000 000	USD	65 434 700	PLN	17.09.2021	17.09.2021
26.	Forward Waluta USD FWB09023 17.09.2021 (0)	-	Forward	IRH	261	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	37 004 800	PLN	9 800 000	USD	17.09.2021	37 004 800	PLN	9 800 000	USD	17.09.2021	17.09.2021
27.	Forward Waluta USD FWB10006 20.10.2021 (0)	-	Forward	IRH	-65	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	16 415 000	USD	62 354 676	PLN	20.10.2021	16 415 000	USD	62 354 676	PLN	20.10.2021	20.10.2021
28.	Interest Rate Swap CC23103 25.10.2023 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-50 446	The Goldman Sachs Group Inc.	296 354 056	CZK			25.10.2023	296 700 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
29.	Interest Rate Swap CC23104 25.10.2023 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-50 471	The Goldman Sachs Group Inc.	296 503 881	CZK			25.10.2023	296 850 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
30.	Interest Rate Swap CC250213 14.02.2025 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-41 530	BNP PARIBAS	250 365 000	CZK			14.02.2025	250 000 000	CZK			14.02.2025	14.02.2025
31.	Interest Rate Swap CC25026 14.02.2025 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-41 545	The Goldman Sachs Group Inc.	250 456 250	CZK			14.02.2025	250 000 000	CZK			14.02.2025	14.02.2025
32.	Interest Rate Swap CC23109 25.10.2023 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-17 012	SOCIETE GENERALE PARIS	99 901 146	CZK			25.10.2023	100 000 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
33.	Interest Rate Swap CC250230 17.02.2025 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-17 733	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	106 716 515	CZK			17.02.2025	100 000 000	CZK			17.02.2025	17.02.2025
34.	Interest Rate Swap CC270212 10.02.2027 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-19 056	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	119 942 817	CZK			10.02.2027	120 000 000	CZK			10.02.2027	10.02.2027
35.	Interest Rate Swap CC231010 25.10.2023 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-17 739	Goldman Sachs Bank Europe SE	103 896 856	CZK			25.10.2023	100 000 000	CZK			25.10.2023	25.10.2023
36.	Interest Rate Swap CC24124 12.12.2024 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-35 453	SOCIETE GENERALE PARIS	212 573 568	CZK			12.12.2024	200 000 000	CZK			12.12.2024	12.12.2024
37.	Interest Rate Swap CC27110 19.11.2027 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-17 732	J.P. MORGAN A.G.	112 189 910	CZK			19.11.2027	100 000 000	CZK			19.11.2027	19.11.2027
38.	Interest Rate Swap CC27118 19.11.2027 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-26 599	BNP PARIBAS	168 284 865	CZK			19.11.2027	150 000 000	CZK			19.11.2027	19.11.2027
39.	Interest Rate Swap CC271112 19.11.2027 (0)	Krótki	CIRS	IRH	-17 732	BNP PARIBAS	112 189 910	CZK			19.11.2027	100 000 000	CZK			19.11.2027	19.11.2027

OPIS 'CEL otwarcia pozycji': IRH Ograniczenie ryzyka w walutach obcych
 ORI Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w walutach obcych

Specyficzne instrumenty: IRS Interest Rate Swap
 CIRS Cross Currency Interest Swap
 Forward Terminowa wymiana walut (FX Forward)
 FRA Forward Rate Agreement
 CDS Credit Default Swap
 Future giełdowy kontrakt future

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 1 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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 instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
40.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 788	SOCIETE GENERALE PARIS	2 139 419	EUR			09.07.2024	2 120 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
41.	Interest Rate Sw ap CC21096 20.09.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-18 075	SOCIETE GENERALE PARIS	3 993 418	EUR			20.09.2021	4 000 000	EUR		20.09.2021	20.09.2021	
42.	Interest Rate Sw ap CC24075 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-16 476	SOCIETE GENERALE PARIS	3 601 133	EUR			09.07.2024	3 585 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
43.	Interest Rate Sw ap CC25014 20.01.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-12 083	SOCIETE GENERALE PARIS	2 639 388	EUR			20.01.2025	2 620 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025	
44.	Interest Rate Sw ap CC25093 09.09.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-14 738	The Goldman Sachs Group Inc.	3 217 676	EUR			09.09.2025	3 175 000	EUR		09.09.2025	09.09.2025	
45.	Interest Rate Sw ap CC21116 26.11.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-4 700	J.P. Morgan Chase & Co	1 037 338	EUR			26.11.2021	1 039 000	EUR		26.11.2021	26.11.2021	
46.	Interest Rate Sw ap CC220915 05.09.2022 (0)	Krótka	IRS	IRH	-13 625	BNP PARIBAS	2 998 205	EUR			05.09.2022	3 000 000	EUR		05.09.2022	05.09.2022	
47.	Interest Rate Sw ap CC24079 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-5 330	The Goldman Sachs Group Inc.	1 165 104	EUR			09.07.2024	1 160 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
48.	Interest Rate Sw ap CC25018 20.01.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-6 085	BNP PARIBAS	1 329 240	EUR			20.01.2025	1 320 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025	
49.	Interest Rate Sw ap CC21111 26.11.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-4 520	SOCIETE GENERALE PARIS	997 625	EUR			26.11.2021	1 000 000	EUR		26.11.2021	26.11.2021	
50.	Interest Rate Sw ap CC240714 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-5 383	SOCIETE GENERALE PARIS	1 176 504	EUR			09.07.2024	1 175 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
51.	Interest Rate Sw ap CC240716 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-10 628	SOCIETE GENERALE PARIS	2 328 257	EUR			09.07.2024	2 330 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
52.	Interest Rate Sw ap CC25013 20.01.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-8 914	BNP PARIBAS	1 948 563	EUR			20.01.2025	1 610 000	EUR		20.01.2025	20.01.2025	
53.	Interest Rate Sw ap CC220941 05.09.2022 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 038	Santander Bank Polska S.A.	1 997 821	EUR			05.09.2022	2 000 000	EUR		05.09.2022	05.09.2022	
54.	Interest Rate Sw ap CC23014 19.01.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-49 793	BNP PARIBAS	11 027 752	EUR			19.01.2023	11 625 000	EUR		19.01.2023	19.01.2023	
55.	Interest Rate Sw ap CC21101 14.10.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 013	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 590	EUR			14.10.2021	2 000 000	EUR		14.10.2021	14.10.2021	
56.	Interest Rate Sw ap CC211212 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 023	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 905	EUR			20.12.2021	2 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
57.	Interest Rate Sw ap CC211214 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 021	SOCIETE GENERALE PARIS	1 990 586	EUR			20.12.2021	2 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
58.	Interest Rate Sw ap CC211215 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-13 532	SOCIETE GENERALE PARIS	2 985 948	EUR			20.12.2021	3 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
59.	Interest Rate Sw ap CC211216 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-13 533	SOCIETE GENERALE PARIS	2 986 179	EUR			20.12.2021	3 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
60.	Interest Rate Sw ap CC22011 18.01.2022 (0)	Krótka	IRS	IRH	-4 511	SOCIETE GENERALE PARIS	995 085	EUR			18.01.2022	1 000 000	EUR		18.01.2022	18.01.2022	
61.	Interest Rate Sw ap CC240722 09.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-29 800	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	6 595 707	EUR			09.07.2024	6 600 000	EUR		09.07.2024	09.07.2024	
62.	Interest Rate Sw ap CC210914 24.09.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-8 352	mBank S.A.	1 845 102	EUR			24.09.2021	1 850 000	EUR		24.09.2021	24.09.2021	
63.	Interest Rate Sw ap CC211217 20.12.2021 (0)	Długa	IRS	IRH	45 256	SOCIETE GENERALE PARIS			9 986 039	EUR	20.12.2021			10 000 000	EUR	20.12.2021	20.12.2021
64.	Interest Rate Sw ap CC230611 07.06.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-9 046	BNP PARIBAS	1 991 600	EUR			07.06.2023	2 000 000	EUR		07.06.2023	07.06.2023	
65.	Interest Rate Sw ap CC23069 07.06.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-5 659	SOCIETE GENERALE PARIS	1 245 288	EUR			07.06.2023	1 250 000	EUR		07.06.2023	07.06.2023	
66.	Interest Rate Sw ap CC240133 15.01.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-13 782	BNP PARIBAS	3 038 886	EUR			15.01.2024	3 050 000	EUR		15.01.2024	15.01.2024	
67.	Interest Rate Sw ap CC250215 10.02.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-22 893	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	5 000 000	EUR			10.02.2025	5 000 000	EUR		10.02.2025	10.02.2025	
68.	Interest Rate Sw ap CC211220 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-4 506	SOCIETE GENERALE PARIS	994 177	EUR			20.12.2021	1 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
69.	Interest Rate Sw ap CC230711 07.07.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-59 317	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	13 000 000	EUR			07.07.2023	13 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023	
70.	Interest Rate Sw ap CC230715 07.07.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-63 879	Santander Bank Polska S.A.	14 000 000	EUR			07.07.2023	14 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023	
71.	Interest Rate Sw ap CC23078 07.07.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-45 628	SOCIETE GENERALE PARIS	10 000 000	EUR			07.07.2023	10 000 000	EUR		07.07.2023	07.07.2023	
72.	Interest Rate Sw ap CC211221 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-58 579	Santander Bank Polska S.A.	12 925 782	EUR			20.12.2021	13 000 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
73.	Interest Rate Sw ap CC211222 20.12.2021 (0)	Krótka	IRS	IRH	-15 765	Santander Bank Polska S.A.	3 478 709	EUR			20.12.2021	3 500 000	EUR		20.12.2021	20.12.2021	
74.	Interest Rate Sw ap CC23015 19.01.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-14 837	SOCIETE GENERALE PARIS	3 278 821	EUR			19.01.2023	3 300 000	EUR		19.01.2023	19.01.2023	
75.	Interest Rate Sw ap CC240134 05.01.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-24 634	Santander Bank Polska S.A.	5 463 700	EUR			05.01.2024	5 500 000	EUR		05.01.2024	05.01.2024	
76.	Interest Rate Sw ap CC240135 05.01.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-26 914	Santander Bank Polska S.A.	5 963 322	EUR			05.01.2024	6 000 000	EUR		05.01.2024	05.01.2024	
77.	Interest Rate Sw ap CC27105 08.10.2027 (0)	Krótka	IRS	IRH	-4 364	SOCIETE GENERALE PARIS	993 590	EUR			08.10.2027	1 000 000	EUR		08.10.2027	08.10.2027	
78.	Interest Rate Sw ap CC23018 19.01.2023 (0)	Krótka	IRS	IRH	-12 175	SOCIETE GENERALE PARIS	2 685 825	EUR			19.01.2023	2 700 000	EUR		19.01.2023	19.01.2023	
79.	Interest Rate Sw ap CC240733 08.07.2024 (0)	Krótka	IRS	IRH	-20 167	Santander Bank Polska S.A.	4 473 303	EUR			08.07.2024	4 500 000	EUR		08.07.2024	08.07.2024	
80.	Interest Rate Sw ap CC250121 27.01.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-45 164	Santander Bank Polska S.A.	9 996 931	EUR			27.01.2025	10 000 000	EUR		27.01.2025	27.01.2025	
81.	Interest Rate Sw ap CC250123 27.01.2025 (0)	Krótka	IRS	IRH	-45 164	BNP PARIBAS	9 996 931	EUR			27.01.2025	10 000 000	EUR		27.01.2025	27.01.2025	
82.	Interest Rate Sw ap CC26014 19.01.2026 (0)	Krótka	IRS	IRH	-51 933	J.P. MORGAN AG	11 501 332	EUR			19.01.2026	11 500 000	EUR		19.01.2026	19.01.2026	
83.	Interest Rate Sw ap CC26023 02.02.2026 (0)	Krótka	IRS	IRH	-36 136	SOCIETE GENERALE PARIS	8 000 926	EUR			02.02.2026	8 000 000	EUR		02.02.2026	02.02.2026	
84.	Interest Rate Sw ap CC26091 21.09.2026 (0)	Krótka	IRS	IRH	-72 321	Santander Bank Polska S.A.	16 009 560	EUR			21.09.2026	16 000 000	EUR		21.09.2026	21.09.2026	

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

Specyficzne instrumenty: Forward Terminowa wymiany walut (FX Forward)
 IRS Interest Rate Swap
 CIRS Cross Currency Interest Swap
 Forward Terminowa wymiany walut (FX Forward)
 FRA Forward Rate Agreement
 CDS Credit Default Swap
 Future giełdowy kontrakt future

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 2 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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 zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego
						kwota	waluta	kwota	waluta							
85.	Interest Rate Sw ap CC26094 29.01.2026 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 990	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	5 753 474	EUR			29.01.2026	5 750 000	EUR		29.01.2026	29.01.2026
86.	Interest Rate Sw ap CC26068 27.05.2026 (0)	Krótką	CRS	IRH	-13 555	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	3 000 521	EUR			27.05.2026	3 000 000	EUR		27.05.2026	27.05.2026
87.	Interest Rate Sw ap CC23083 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-12 777	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 020 381 370	HUF			23.08.2023	1 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
88.	Interest Rate Sw ap CC23085 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-15 154	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	1 210 220 945	HUF			23.08.2023	1 192 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
89.	Interest Rate Sw ap CC23088 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-12 867	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	1 027 573 878	HUF			23.08.2023	1 013 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
90.	Interest Rate Sw ap CC22083 24.08.2022 (0)	Krótką	CRS	IRH	-12 745	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 006 200 000	HUF			24.08.2022	1 000 000 000	HUF		24.08.2022	24.08.2022
91.	Interest Rate Sw ap CC22101 26.10.2022 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 413	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 008 400 000	HUF			26.10.2022	2 000 000 000	HUF		26.10.2022	26.10.2022
92.	Interest Rate Sw ap CC23081 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 722	SOCIETE GENERALE PARIS	2 054 015 982	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
93.	Interest Rate Sw ap CC23081 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-12 861	SOCIETE GENERALE PARIS	1 027 007 991	HUF			23.08.2023	1 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
94.	Interest Rate Sw ap CC23081 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 722	SOCIETE GENERALE PARIS	2 054 015 982	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
95.	Interest Rate Sw ap CC23082 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 722	BNP PARIBAS	2 054 015 982	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
96.	Interest Rate Sw ap CC23082 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-12 861	J.P. MORGAN AG	1 027 007 991	HUF			23.08.2023	1 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
97.	Interest Rate Sw ap CC23082 23.08.2023 (0)	Krótką	CRS	IRH	-25 722	SOCIETE GENERALE PARIS	2 054 015 982	HUF			23.08.2023	2 000 000 000	HUF		23.08.2023	23.08.2023
98.	Interest Rate Sw ap CC24073 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	9 131	SOCIETE GENERALE PARIS			9 439 215	PLN	09.07.2024			9 120 240	PLN	09.07.2024
99.	Interest Rate Sw ap CC21096 20.09.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	17 252	SOCIETE GENERALE PARIS			17 257 486	PLN	20.09.2021			17 236 000	PLN	20.09.2021
100.	Interest Rate Sw ap CC24075 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	15 767	SOCIETE GENERALE PARIS			16 297 858	PLN	09.07.2024			15 747 113	PLN	09.07.2024
101.	Interest Rate Sw ap CC25014 20.01.2025 (0)	Długa	CRS	IRH	11 508	SOCIETE GENERALE PARIS			12 008 357	PLN	20.01.2025			11 493 940	PLN	20.01.2025
102.	Interest Rate Sw ap CC25093 09.09.2025 (0)	Długa	CRS	IRH	13 540	The Goldman Sachs Group Inc.			14 290 022	PLN	09.09.2025			13 525 500	PLN	09.09.2025
103.	Interest Rate Sw ap CC21116 26.11.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	4 458	J.P. Morgan Chase & Co			4 461 887	PLN	26.11.2021			4 456 271	PLN	26.11.2021
104.	Interest Rate Sw ap CC22091 05.09.2022 (0)	Długa	CRS	IRH	12 874	BNP PARIBAS			12 945 058	PLN	05.09.2022			12 870 000	PLN	05.09.2022
105.	Interest Rate Sw ap CC24079 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	4 980	The Goldman Sachs Group Inc.			5 147 963	PLN	09.07.2024			4 974 000	PLN	09.07.2024
106.	Interest Rate Sw ap CC25018 20.01.2025 (0)	Długa	CRS	IRH	5 721	BNP PARIBAS			5 970 026	PLN	20.01.2025			5 714 280	PLN	20.01.2025
107.	Interest Rate Sw ap CC21111 26.11.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	4 287	SOCIETE GENERALE PARIS			4 290 901	PLN	26.11.2021			4 285 500	PLN	26.11.2021
108.	Interest Rate Sw ap CC24074 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	5 055	SOCIETE GENERALE PARIS			5 225 560	PLN	09.07.2024			5 048 975	PLN	09.07.2024
109.	Interest Rate Sw ap CC24076 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	10 023	SOCIETE GENERALE PARIS			10 360 968	PLN	09.07.2024			10 010 845	PLN	09.07.2024
110.	Interest Rate Sw ap CC25013 20.01.2025 (0)	Długa	CRS	IRH	8 361	BNP PARIBAS			8 684 981	PLN	20.01.2025			8 609 315	PLN	20.01.2025
111.	Interest Rate Sw ap CC22094 05.09.2022 (0)	Długa	CRS	IRH	8 722	Santander Bank Polska S.A.			8 770 520	PLN	05.09.2022			8 716 966	PLN	05.09.2022
112.	Interest Rate Sw ap CC23014 19.01.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	50 273	BNP PARIBAS			50 753 023	PLN	19.01.2023			50 220 000	PLN	19.01.2023
113.	Interest Rate Sw ap CC21101 14.10.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	8 654	SOCIETE GENERALE PARIS			8 658 239	PLN	14.10.2021			8 647 400	PLN	14.10.2021
114.	Interest Rate Sw ap CC21121 20.12.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	8 574	SOCIETE GENERALE PARIS			8 582 686	PLN	20.12.2021			8 572 000	PLN	20.12.2021
115.	Interest Rate Sw ap CC21124 20.12.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	8 594	SOCIETE GENERALE PARIS			8 602 711	PLN	20.12.2021			8 592 000	PLN	20.12.2021
116.	Interest Rate Sw ap CC21125 20.12.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	12 900	SOCIETE GENERALE PARIS			12 913 077	PLN	20.12.2021			12 897 000	PLN	20.12.2021
117.	Interest Rate Sw ap CC21126 20.12.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	12 837	SOCIETE GENERALE PARIS			12 849 999	PLN	20.12.2021			12 834 000	PLN	20.12.2021
118.	Interest Rate Sw ap CC22011 18.01.2022 (0)	Długa	CRS	IRH	4 329	SOCIETE GENERALE PARIS			4 334 872	PLN	18.01.2022			4 323 700	PLN	18.01.2022
119.	Interest Rate Sw ap CC24072 09.07.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	28 322	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			29 272 261	PLN	09.07.2024			28 149 000	PLN	09.07.2024
120.	Interest Rate Sw ap CC21091 24.09.2021 (0)	Długa	CRS	IRH	8 437	mBank S.A.			8 439 827	PLN	24.09.2021			8 436 000	PLN	24.09.2021
121.	Interest Rate Sw ap CC21127 20.12.2021 (0)	Krótką	CRS	IRH	-46 010	SOCIETE GENERALE PARIS	46 057 342	PLN			20.12.2021	46 000 000	PLN		20.12.2021	20.12.2021
122.	Interest Rate Sw ap CC23061 07.06.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	9 140	BNP PARIBAS			9 280 317	PLN	07.06.2023			9 137 000	PLN	07.06.2023
123.	Interest Rate Sw ap CC23069 07.06.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	5 681	SOCIETE GENERALE PARIS			5 767 823	PLN	07.06.2023			5 678 750	PLN	07.06.2023
124.	Interest Rate Sw ap CC23083 23.08.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	13 029	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			13 273 919	PLN	23.08.2023			13 024 225	PLN	23.08.2023
125.	Interest Rate Sw ap CC23085 23.08.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	15 179	Bank Handlowy w Warszawie S.A.			15 464 276	PLN	23.08.2023			15 162 240	PLN	23.08.2023
126.	Interest Rate Sw ap CC23088 23.08.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	13 012	Bank Handlowy w Warszawie S.A.			13 256 357	PLN	23.08.2023			13 006 920	PLN	23.08.2023
127.	Interest Rate Sw ap CC23103 25.10.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	48 905	The Goldman Sachs Group Inc.			49 965 533	PLN	25.10.2023			48 879 736	PLN	25.10.2023
128.	Interest Rate Sw ap CC23104 25.10.2023 (0)	Długa	CRS	IRH	49 010	The Goldman Sachs Group Inc.			50 073 287	PLN	25.10.2023			48 985 149	PLN	25.10.2023
129.	Interest Rate Sw ap CC24013 15.01.2024 (0)	Długa	CRS	IRH	13 872	BNP PARIBAS			14 225 810	PLN	15.01.2024			13 854 630	PLN	15.01.2024

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' IRH
 ORI
 Specyficzne instrumenty: Forward
 IRS
 CIRS
 Forward
 FRA
 CDS
 Future

Ograniczenie ryzyka w walutach jego portfela papierów w artościowych denominowanych w walutach obcych (IRH)
 Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w artościowych
 Terminowa wymiana walut (FX Forward)
 Interest Rate Swap
 Cross Currency Interest Swap
 Terminowa wymiana walut (FX Forward)
 Forward Rate Agreement
 Credit Default Swap
 giełdowy kontrakt future

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 3 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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 w waluta do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności w waluta do otrzymania	Termin zapadalności (wygasnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta								
130.	Interest Rate Sw ap CC250213 14.02.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	41 186	BNP PARIBAS			43 025 012	PLN	14.02.2025			41 167 172	PLN	14.02.2025	14.02.2025
131.	Interest Rate Sw ap CC250215 10.02.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	22 811	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			23 811 714	PLN	10.02.2025			22 310 000	PLN	10.02.2025	10.02.2025
132.	Interest Rate Sw ap CC250226 14.02.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	41 205	The Goldman Sachs Group Inc.			43 044 858	PLN	14.02.2025			41 186 161	PLN	14.02.2025	14.02.2025
133.	Interest Rate Sw ap CC211220 20.12.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	4 453	SOCIETE GENERALE PARIS			4 458 027	PLN	20.12.2021			4 452 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
134.	Interest Rate Sw ap CC22083 24.08.2022 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 679	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			12 745 436	PLN	24.08.2022			12 674 271	PLN	24.08.2022	24.08.2022
135.	Interest Rate Sw ap CC22101 26.10.2022 (0)	Długa	CIRS	IRH	25 282	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL			25 454 803	PLN	26.10.2022			25 268 478	PLN	26.10.2022	26.10.2022
136.	Interest Rate Sw ap CC230711 07.07.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	58 946	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			59 916 258	PLN	07.07.2023			58 116 500	PLN	07.07.2023	07.07.2023
137.	Interest Rate Sw ap CC230715 07.07.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	62 764	Santander Bank Polska S.A.			63 795 756	PLN	07.07.2023			61 880 000	PLN	07.07.2023	07.07.2023
138.	Interest Rate Sw ap CC23078 07.07.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	45 293	SOCIETE GENERALE PARIS			46 038 005	PLN	07.07.2023			44 675 000	PLN	07.07.2023	07.07.2023
139.	Interest Rate Sw ap CC230811 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	25 622	SOCIETE GENERALE PARIS			26 101 563	PLN	23.08.2023			25 520 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
140.	Interest Rate Sw ap CC230815 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 492	SOCIETE GENERALE PARIS			12 726 182	PLN	23.08.2023			12 444 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
141.	Interest Rate Sw ap CC230818 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	24 979	SOCIETE GENERALE PARIS			25 446 774	PLN	23.08.2023			24 888 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
142.	Interest Rate Sw ap CC230821 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	24 861	BNP PARIBAS			25 326 798	PLN	23.08.2023			24 789 178	PLN	23.08.2023	23.08.2023
143.	Interest Rate Sw ap CC211221 20.12.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	58 272	Santander Bank Polska S.A.			58 331 818	PLN	20.12.2021			58 259 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
144.	Interest Rate Sw ap CC211222 20.12.2021 (0)	Długa	CIRS	IRH	16 156	Santander Bank Polska S.A.			16 172 550	PLN	20.12.2021			16 152 500	PLN	20.12.2021	20.12.2021
145.	Interest Rate Sw ap CC23015 19.01.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	14 792	SOCIETE GENERALE PARIS			14 933 137	PLN	19.01.2023			14 784 000	PLN	19.01.2023	19.01.2023
146.	Interest Rate Sw ap CC23109 25.10.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	16 989	SOCIETE GENERALE PARIS			17 357 188	PLN	25.10.2023			16 980 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
147.	Interest Rate Sw ap CC240134 05.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	24 702	Santander Bank Polska S.A.			25 320 467	PLN	05.01.2024			24 689 500	PLN	05.01.2024	05.01.2024
148.	Interest Rate Sw ap CC240135 05.01.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	26 870	Santander Bank Polska S.A.			27 555 153	PLN	05.01.2024			26 856 000	PLN	05.01.2024	05.01.2024
149.	Interest Rate Sw ap CC250230 17.02.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	17 182	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			17 942 896	PLN	17.02.2025			16 846 361	PLN	17.02.2025	17.02.2025
150.	Interest Rate Sw ap CC270212 10.11.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	20 009	J.P. MORGAN SECURITIES PLC			21 692 818	PLN	10.11.2026			20 000 000	PLN	10.11.2026	10.11.2026
151.	Interest Rate Sw ap CC27105 08.10.2027 (0)	Długa	CIRS	IRH	4 585	SOCIETE GENERALE PARIS			4 021 819	PLN	08.10.2027			4 583 000	PLN	08.10.2027	08.10.2027
152.	Interest Rate Sw ap CC220959 26.09.2022 (0)	Długa	CIRS	IRH	26 206	Bank Polska Kasa Opieki S.A.			26 363 913	PLN	26.09.2022			26 202 000	PLN	26.09.2022	26.09.2022
153.	Interest Rate Sw ap CC23018 19.01.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 254	SOCIETE GENERALE PARIS			12 370 747	PLN	19.01.2023			12 247 200	PLN	19.01.2023	19.01.2023
154.	Interest Rate Sw ap CC230825 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	12 559	J.P. MORGAN AG			12 794 007	PLN	23.08.2023			12 534 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
155.	Interest Rate Sw ap CC230827 23.08.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	25 077	SOCIETE GENERALE PARIS			25 547 317	PLN	23.08.2023			25 024 000	PLN	23.08.2023	23.08.2023
156.	Interest Rate Sw ap CC231010 25.10.2023 (0)	Długa	CIRS	IRH	17 429	Goldman Sachs Bank Europe SE			17 804 739	PLN	25.10.2023			17 245 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
157.	Interest Rate Sw ap CC240733 08.07.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	20 371	Santander Bank Polska S.A.			21 055 772	PLN	08.07.2024			20 360 250	PLN	08.07.2024	08.07.2024
158.	Interest Rate Sw ap CC24124 12.12.2024 (0)	Długa	CIRS	IRH	35 168	SOCIETE GENERALE PARIS			36 618 370	PLN	12.12.2024			34 850 000	PLN	12.12.2024	12.12.2024
159.	Interest Rate Sw ap CC250121 27.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	45 484	Santander Bank Polska S.A.			47 472 123	PLN	27.01.2025			45 385 000	PLN	27.01.2025	27.01.2025
160.	Interest Rate Sw ap CC250123 27.01.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	45 475	BNP PARIBAS			47 463 227	PLN	27.01.2025			45 384 000	PLN	27.01.2025	27.01.2025
161.	Interest Rate Sw ap CC26014 19.01.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	52 520	J.P. MORGAN AG			55 801 878	PLN	19.01.2026			52 298 500	PLN	19.01.2026	19.01.2026
162.	Interest Rate Sw ap CC26023 02.02.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	36 350	SOCIETE GENERALE PARIS			38 652 266	PLN	02.02.2026			36 284 800	PLN	02.02.2026	02.02.2026
163.	Interest Rate Sw ap CC26091 03.03.2025 (0)	Długa	CIRS	IRH	73 086	Santander Bank Polska S.A.			78 629 884	PLN	03.03.2025			72 480 000	PLN	03.03.2025	03.03.2025
164.	Interest Rate Sw ap CC26094 29.01.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	25 947	Bank Polska Kasa Opieki S.A.			27 916 620	PLN	29.01.2026			25 774 375	PLN	29.01.2026	29.01.2026
165.	Interest Rate Sw ap CC271110 19.11.2027 (0)	Długa	CIRS	IRH	17 715	J.P. MORGAN AG			19 464 539	PLN	19.11.2027			17 350 000	PLN	19.11.2027	19.11.2027
166.	Interest Rate Sw ap CC27118 19.11.2027 (0)	Długa	CIRS	IRH	26 611	BNP PARIBAS			29 239 193	PLN	19.11.2027			26 064 292	PLN	19.11.2027	19.11.2027
167.	Interest Rate Sw ap CC26058 27.05.2026 (0)	Długa	CIRS	IRH	13 510	Bank Polska Kasa Opieki S.A.			14 449 001	PLN	27.05.2026			13 446 000	PLN	27.05.2026	27.05.2026
168.	Interest Rate Sw ap CC271112 19.11.2027 (0)	Długa	CIRS	IRH	17 837	BNP PARIBAS			19 605 236	PLN	19.11.2027			17 580 438	PLN	19.11.2027	19.11.2027
169.	Interest Rate Sw ap CC220959 26.09.2022 (0)	Krótko	CIRS	IRH	-25 160	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	6 634 329	USD			26.09.2022	6 600 000	USD			26.09.2022	26.09.2022
170.	Interest Rate Sw ap C22110R 28.11.2022 (0)	-	IRS	IRH	-114	J.P. MORGAN AG	1 804 832	CZK	1 148 833	CZK	28.11.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	28.11.2022	28.11.2022
171.	Interest Rate Sw ap C22114R 16.12.2025 (0)	-	IRS	IRH	-137	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 770 076	CZK	986 167	CZK	16.12.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	16.12.2025	16.12.2025
172.	Interest Rate Sw ap C22118R 20.11.2022 (0)	-	IRS	IRH	-134	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1 765 119	CZK	994 972	CZK	20.11.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	20.11.2022	20.11.2022
173.	Interest Rate Sw ap C22121R 12.12.2022 (0)	-	IRS	IRH	-93	J.P. MORGAN AG	1 862 991	CZK	1 330 014	CZK	12.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	12.12.2022	12.12.2022
174.	Interest Rate Sw ap C22124R 05.12.2022 (0)	-	IRS	IRH	-95	J.P. MORGAN AG	1 838 077	CZK	1 291 167	CZK	05.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	05.12.2022	05.12.2022

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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 4 Tabela N-6						30.06.2021 --- 268 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 (wyciągnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
175.	Interest Rate Sw ap C250225R 14.02.2025 (0)	-	IRS	IRH	793	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 190 000	CZK	6 836 875	CZK	14.02.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	14.02.2025	14.02.2025
176.	Interest Rate Sw ap C221214R 23.12.2022 (0)	-	IRS	IRH	-96	J.P. MORGAN AG	1 921 432	CZK	1 368 750	CZK	23.12.2022	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	23.12.2022	23.12.2022
177.	Interest Rate Sw ap C23016R 06.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-308	BNP PARIBAS	4 558 177	CZK	2 798 333	CZK	06.01.2023	200 000 000	CZK	200 000 000	CZK	06.01.2023	06.01.2023
178.	Interest Rate Sw ap C230231R 10.02.2023 (0)	-	IRS	IRH	-115	Goldman Sachs Bank Europe SE	2 444 353	CZK	1 784 444	CZK	10.02.2023	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	10.02.2023	10.02.2023
179.	Interest Rate Sw ap C230234R 10.02.2023 (0)	-	IRS	IRH	-112	SOCIETE GENERALE PARIS	2 444 353	CZK	1 804 722	CZK	10.02.2023	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	10.02.2023	10.02.2023
180.	Interest Rate Sw ap C250237R 14.02.2025 (0)	-	IRS	IRH	-521	BNP PARIBAS	6 836 875	CZK	3 775 722	CZK	14.02.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	14.02.2025	14.02.2025
181.	Interest Rate Sw ap C250240R 14.02.2025 (0)	-	IRS	IRH	-539	BNP PARIBAS	6 836 875	CZK	3 670 278	CZK	14.02.2025	100 000 000	CZK	100 000 000	CZK	14.02.2025	14.02.2025
182.	Interest Rate Sw ap C211115R 26.11.2021 (0)	-	IRS	IRH	25	BNP PARIBAS	4 423	EUR	9 903	EUR	26.11.2021	1 700 000	EUR	1 700 000	EUR	26.11.2021	26.11.2021
183.	Interest Rate Sw ap C220936R 05.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	24	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	14 895	EUR	20 224	EUR	05.09.2022	2 000 000	EUR	2 000 000	EUR	05.09.2022	05.09.2022
184.	Interest Rate Sw ap C23012R 19.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	8	SOCIETE GENERALE PARIS	97 428	EUR	99 160	EUR	19.01.2023	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	19.01.2023	19.01.2023
185.	Interest Rate Sw ap C240719R 09.07.2024 (0)	-	IRS	IRH	-151	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	79 473	EUR	46 200	EUR	09.07.2024	5 500 000	EUR	5 500 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024
186.	Interest Rate Sw ap C22123R 05.12.2022 (0)	-	IRS	IRH	72	BNP PARIBAS	36 139	EUR	51 894	EUR	05.12.2022	5 000 000	EUR	5 000 000	EUR	05.12.2022	05.12.2022
187.	Interest Rate Sw ap C22127R 07.12.2022 (0)	-	IRS	IRH	143	J.P. MORGAN AG	71 963	EUR	103 400	EUR	07.12.2022	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	07.12.2022	07.12.2022
188.	Interest Rate Sw ap C230613R 07.06.2023 (0)	-	IRS	IRH	5	J.P. MORGAN AG	9 261	EUR	10 300	EUR	07.06.2023	1 000 000	EUR	1 000 000	EUR	07.06.2023	07.06.2023
189.	Interest Rate Sw ap C23128R 11.12.2023 (0)	-	IRS	IRH	120	SOCIETE GENERALE PARIS	53 551	EUR	79 950	EUR	11.12.2023	5 000 000	EUR	5 000 000	EUR	11.12.2023	11.12.2023
190.	Interest Rate Sw ap C25062R 24.06.2025 (0)	-	IRS	IRH	65	J.P. MORGAN AG	33 018	EUR	47 100	EUR	24.06.2025	2 500 000	EUR	2 500 000	EUR	24.06.2025	24.06.2025
191.	Interest Rate Sw ap C230718R 07.07.2023 (0)	-	IRS	IRH	41	J.P. MORGAN AG	115 353	EUR	124 197	EUR	07.07.2023	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	07.07.2023	07.07.2023
192.	Interest Rate Sw ap C230719R 07.07.2023 (0)	-	IRS	IRH	54	J.P. MORGAN AG	115 117	EUR	126 867	EUR	07.07.2023	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	07.07.2023	07.07.2023
193.	Interest Rate Sw ap C240734R 09.07.2024 (0)	-	IRS	IRH	138	Goldman Sachs Bank Europe SE	143 808	EUR	173 958	EUR	09.07.2024	10 000 000	EUR	10 000 000	EUR	09.07.2024	09.07.2024
194.	Interest Rate Sw ap C250128R 20.01.2025 (0)	-	IRS	IRH	137	BNP PARIBAS	96 533	EUR	126 475	EUR	20.01.2025	6 500 000	EUR	6 500 000	EUR	20.01.2025	20.01.2025
195.	Interest Rate Sw ap C26092R 20.09.2026 (0)	-	IRS	IRH	665	J.P. MORGAN AG	209 103	EUR	354 133	EUR	20.09.2026	15 000 000	EUR	15 000 000	EUR	20.09.2026	20.09.2026
196.	Interest Rate Sw ap C26093R 20.09.2026 (0)	-	IRS	IRH	92	J.P. MORGAN AG	83 641	EUR	103 464	EUR	20.09.2026	6 000 000	EUR	6 000 000	EUR	20.09.2026	20.09.2026
197.	Interest Rate Sw ap C28056R 27.05.2028 (0)	-	IRS	IRH	-46	SOCIETE GENERALE PARIS	25 639	EUR	15 552	EUR	27.05.2028	3 000 000	EUR	3 000 000	EUR	27.05.2028	27.05.2028
198.	Interest Rate Sw ap IR230114R 25.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-1 076	SOCIETE GENERALE PARIS	1 524 000	PLN	442 220	PLN	25.01.2023	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
199.	Interest Rate Sw ap IR23013R 25.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-1 898	ING Bank Śląski S.A.	2 682 400	PLN	773 885	PLN	25.01.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
200.	Interest Rate Sw ap IR25077R 25.07.2025 (0)	-	IRS	IRH	-1 945	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	4 030 223	PLN	2 059 032	PLN	25.07.2025	38 000 000	PLN	38 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
201.	Interest Rate Sw ap IR21078R 26.07.2021 (0)	-	IRS	IRH	-815	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	877 793	PLN	62 329	PLN	26.07.2021	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
202.	Interest Rate Sw ap IR280420R 25.04.2028 (0)	-	IRS	IRH	2 560	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	4 936 694	PLN	7 593 716	PLN	25.04.2028	45 000 000	PLN	45 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
203.	Interest Rate Sw ap IR210713R 26.07.2021 (0)	-	IRS	IRH	680	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	42 466	PLN	722 167	PLN	26.07.2021	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	26.07.2021	26.07.2021
204.	Interest Rate Sw ap IR21093R 10.09.2021 (0)	-	IRS	IRH	-161	BNP PARIBAS	173 853	PLN	12 603	PLN	10.09.2021	10 000 000	PLN	10 000 000	PLN	10.09.2021	10.09.2021
205.	Interest Rate Sw ap IR220211R 14.02.2022 (0)	-	IRS	IRH	-1 376	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 591 849	PLN	213 424	PLN	14.02.2022	100 000 000	PLN	100 000 000	PLN	14.02.2022	14.02.2022
206.	Interest Rate Sw ap IR22027R 07.02.2022 (0)	-	IRS	IRH	-1 212	ING Bank Śląski S.A.	1 436 055	PLN	222 368	PLN	07.02.2022	80 000 000	PLN	80 000 000	PLN	07.02.2022	07.02.2022
207.	Interest Rate Sw ap IR230132R 25.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-1 432	Powstanie Kasa Oszczędności Bank Polski S.A.	2 205 000	PLN	764 782	PLN	25.01.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
208.	Interest Rate Sw ap IR230135R 25.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-798	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 355 000	PLN	552 775	PLN	25.01.2023	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
209.	Interest Rate Sw ap IR230137R 25.01.2023 (0)	-	IRS	IRH	-823	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 380 000	PLN	552 775	PLN	25.01.2023	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	25.01.2023	25.01.2023
210.	Interest Rate Sw ap IR231011R 25.10.2023 (0)	-	IRS	IRH	56	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	1 564 395	PLN	1 615 253	PLN	25.10.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
211.	Interest Rate Sw ap IR23108R 25.10.2023 (0)	-	IRS	IRH	-1 739	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	3 314 415	PLN	1 564 395	PLN	25.10.2023	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	25.10.2023	25.10.2023
212.	Interest Rate Sw ap IR21094R 10.09.2021 (0)	-	IRS	IRH	-98	BNP PARIBAS	151 072	PLN	52 932	PLN	10.09.2021	42 000 000	PLN	42 000 000	PLN	10.09.2021	10.09.2021
213.	Interest Rate Sw ap IR241030R 25.10.2024 (0)	-	IRS	IRH	-412	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	795 400	PLN	371 746	PLN	25.10.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.10.2024	25.10.2024
214.	Interest Rate Sw ap IR25033R 31.03.2025 (0)	-	IRS	IRH	424	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	520 356	PLN	957 908	PLN	31.03.2025	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	31.03.2025	31.03.2025
215.	Interest Rate Sw ap IR250716R 25.07.2025 (0)	-	IRS	IRH	-731	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 059 032	PLN	1 295 971	PLN	25.07.2025	38 000 000	PLN	38 000 000	PLN	25.07.2025	25.07.2025
216.	Interest Rate Sw ap IR270410R 27.04.2027 (0)	-	IRS	IRH	1 274	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 332 000	PLN	2 676 903	PLN	27.04.2027	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
217.	Interest Rate Sw ap IR270411R 27.04.2027 (0)	-	IRS	IRH	1 257	Santander Bank Polska S.A.	1 350 000	PLN	2 676 903	PLN	27.04.2027	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
218.	Interest Rate Sw ap IR270416R 27.04.2027 (0)	-	IRS	IRH	2 224	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	2 115 000	PLN	4 461 505	PLN	27.04.2027	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
219.	Interest Rate Sw ap IR27044R 27.04.2027 (0)	-	IRS	IRH	2 195	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	2 145 000	PLN	4 461 505	PLN	27.04.2027	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027

OPIS 'CEL otwarcia pozycji'

IRH Ograniczenie ryzyka w walutowo ego portfelu papierów w wartościowych denotowanych w w walutach obcych (RH)
 ORI Ograniczenie ryzyka Inw estycyjnego portfelu papierów w wartościowych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 5 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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 do wykonania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Kwota będąca podstawą przyszłych płatności do otrzymania	Termin zapadalności (wygaśnięcia) instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta		kwota	waluta	kwota	waluta			
220.	Interest Rate Sw ap IR27063R 07.06.2027 (0)	-	IRS	IRH	1 181	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 035 000	PLN	2 281 403	PLN	07.06.2027	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	07.06.2027	07.06.2027
221.	Interest Rate Sw ap IR27065R 07.06.2027 (0)	-	IRS	IRH	1 658	ING Bank Śląski S.A.	1 443 750	PLN	3 193 964	PLN	07.06.2027	35 000 000	PLN	35 000 000	PLN	07.06.2027	07.06.2027
222.	Interest Rate Sw ap IR200610R 05.06.2030 (0)	-	IRS	IRH	2 962	GULLMANN SAUHS	2 914 225	PLN	6 145 908	PLN	05.06.2030	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
223.	Interest Rate Sw ap IR20062R 05.06.2030 (0)	-	IRS	IRH	1 407	INTERMATIONAL	1 536 264	PLN	3 072 954	PLN	05.06.2030	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
224.	Interest Rate Sw ap IR20064R 05.06.2030 (0)	-	IRS	IRH	1 412	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 530 867	PLN	3 072 954	PLN	05.06.2030	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
225.	Interest Rate Sw ap IR250313R 31.03.2025 (0)	-	IRS	IRH	-402	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	957 908	PLN	542 371	PLN	31.03.2025	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	31.03.2025	31.03.2025
226.	Interest Rate Sw ap IR280431R 25.04.2028 (0)	-	IRS	IRH	880	GULLMANN SAUHS	1 252 846	PLN	2 194 086	PLN	25.04.2028	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
227.	Interest Rate Sw ap IR280436R 25.04.2028 (0)	-	IRS	IRH	1 290	INTERMATIONAL	1 365 532	PLN	2 742 608	PLN	25.04.2028	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.04.2028	25.04.2028
228.	Interest Rate Sw ap IR21114R 08.11.2021 (0)	-	IRS	IRH	-13	ING Bank Śląski S.A.	130 658	PLN	117 537	PLN	08.11.2021	100 000 000	PLN	100 000 000	PLN	08.11.2021	08.11.2021
229.	Interest Rate Sw ap IR240433R 25.04.2024 (0)	-	IRS	IRH	-1 043	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	1 651 594	PLN	588 552	PLN	25.04.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.04.2024	25.04.2024
230.	Interest Rate Sw ap IR240517R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-1 174	ROW SZECHCINIŃSKI NABIA USZCZĘPNIOSCI	1 929 265	PLN	730 730	PLN	27.05.2024	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
231.	Interest Rate Sw ap IR240524R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-938	ING Bank Śląski S.A.	1 607 721	PLN	650 289	PLN	27.05.2024	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
232.	Interest Rate Sw ap IR240529R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-871	J.P. MORGAN AG	1 607 721	PLN	717 950	PLN	27.05.2024	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
233.	Interest Rate Sw ap IR240114R 25.01.2024 (0)	-	IRS	IRH	-174	Santander Bank Polska S.A.	541 596	PLN	363 824	PLN	25.01.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	25.01.2024	25.01.2024
234.	Interest Rate Sw ap IR240116R 25.01.2024 (0)	-	IRS	IRH	-28	BNP PARIBAS	671 838	PLN	641 248	PLN	25.01.2024	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	25.01.2024	25.01.2024
235.	Interest Rate Sw ap IR240517R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-639	J.P. MORGAN AG	996 188	PLN	344 221	PLN	27.05.2024	35 000 000	PLN	35 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
236.	Interest Rate Sw ap IR270418R 27.04.2027 (0)	-	IRS	IRH	638	SOCIETE GENERALE PARIS	3 768 000	PLN	4 461 505	PLN	27.04.2027	50 000 000	PLN	50 000 000	PLN	27.04.2027	27.04.2027
237.	Interest Rate Sw ap IR20031R 05.03.2030 (0)	-	IRS	IRH	1 032	J.P. MORGAN AG	2 587 500	PLN	3 726 395	PLN	05.03.2030	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	05.03.2030	05.03.2030
238.	Interest Rate Sw ap IR20038R 18.03.2030 (0)	-	IRS	IRH	1 600	mBank S.A.	10 212 214	PLN	10 480 837	PLN	18.03.2030	70 000 000	PLN	70 000 000	PLN	18.03.2030	18.03.2030
239.	Interest Rate Sw ap IR20102R 25.10.2030 (0)	-	IRS	IRH	947	ING Bank Śląski S.A.	5 403 248	PLN	6 492 256	PLN	25.10.2030	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.10.2030	25.10.2030
240.	Interest Rate Sw ap IR210316R 19.03.2031 (0)	-	IRS	IRH	-74	Goldman Sachs Bank Europe SE	4 317 500	PLN	4 280 968	PLN	19.03.2031	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	19.03.2031	19.03.2031
241.	Interest Rate Sw ap IR240545R 25.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-86	J.P. MORGAN AG	321 544	PLN	233 803	PLN	25.05.2024	10 000 000	PLN	10 000 000	PLN	25.05.2024	25.05.2024
242.	Interest Rate Sw ap IR240547R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-136	Santander Bank Polska S.A.	643 088	PLN	503 392	PLN	27.05.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
243.	Interest Rate Sw ap IR240550R 24.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	37	mBank SA	640 041	PLN	676 518	PLN	24.05.2024	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	24.05.2024	24.05.2024
244.	Interest Rate Sw ap IR240553R 27.05.2024 (0)	-	IRS	IRH	-1	Santander Bank Polska S.A.	960 917	PLN	957 515	PLN	27.05.2024	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	27.05.2024	27.05.2024
245.	Interest Rate Sw ap IR28032R 12.03.2028 (0)	-	IRS	IRH	113	SOCIETE GENERALE PARIS	2 544 681	PLN	2 683 335	PLN	12.03.2028	25 000 000	PLN	25 000 000	PLN	12.03.2028	12.03.2028
246.	Interest Rate Sw ap IR200626R 05.06.2030 (0)	-	IRS	IRH	404	Goldman Sachs Bank Europe SE	3 072 954	PLN	3 482 678	PLN	05.06.2030	20 000 000	PLN	20 000 000	PLN	05.06.2030	05.06.2030
247.	Interest Rate Sw ap IR201012R 25.10.2030 (0)	-	IRS	IRH	-463	BNP PARIBAS	6 925 068	PLN	6 479 828	PLN	25.10.2030	40 000 000	PLN	40 000 000	PLN	25.10.2030	25.10.2030
248.	Interest Rate Sw ap IR20109R 25.10.2030 (0)	-	IRS	IRH	-354	Goldman Sachs Bank Europe SE	5 202 894	PLN	4 863 822	PLN	25.10.2030	30 000 000	PLN	30 000 000	PLN	25.10.2030	25.10.2030
249.	Interest Rate Sw ap IR21051R 25.05.2031 (0)	-	IRS	IRH	-1 723	SOCIETE GENERALE PARIS	12 258 358	PLN	10 484 479	PLN	25.05.2031	60 000 000	PLN	60 000 000	PLN	25.05.2031	25.05.2031
250.	Interest Rate Sw ap C23033R 17.03.2023 (0)	-	IRS	IRH	-460	The Goldman Sachs Group Inc.	133 078	USD	11 871	USD	17.03.2023	2 300 000	USD	2 300 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
251.	Interest Rate Sw ap C22031R 23.03.2022 (0)	-	IRS	IRH	-331	SOCIETE GENERALE PARIS	90 660	USD	3 692	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
252.	Interest Rate Sw ap C220926R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-93	The Goldman Sachs Group Inc.	27 390	USD	2 920	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
253.	Interest Rate Sw ap C220928R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-75	The Goldman Sachs Group Inc.	22 665	USD	2 920	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
254.	Interest Rate Sw ap C220932R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-227	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	68 400	USD	8 760	USD	26.09.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
255.	Interest Rate Sw ap C260415R 06.04.2026 (0)	-	IRS	IRH	-93	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	418 231	USD	393 656	USD	06.04.2026	10 000 000	USD	10 000 000	USD	06.04.2026	06.04.2026
256.	Interest Rate Sw ap C220950R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-141	BNP PARIBAS	42 608	USD	5 548	USD	26.09.2022	1 900 000	USD	1 900 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
257.	Interest Rate Sw ap C220951R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-153	The Goldman Sachs Group Inc.	46 200	USD	5 840	USD	26.09.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
258.	Interest Rate Sw ap C230319R 17.03.2023 (0)	-	IRS	IRH	-421	The Goldman Sachs Group Inc.	131 600	USD	20 645	USD	17.03.2023	4 000 000	USD	4 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
259.	Interest Rate Sw ap C230322R 17.03.2023 (0)	-	IRS	IRH	-317	The Goldman Sachs Group Inc.	99 000	USD	15 484	USD	17.03.2023	3 000 000	USD	3 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
260.	Interest Rate Sw ap C220354R 23.03.2022 (0)	-	IRS	IRH	40	SOCIETE GENERALE PARIS	3 692	USD	14 250	USD	23.03.2022	3 000 000	USD	3 000 000	USD	23.03.2022	23.03.2022
261.	Interest Rate Sw ap C220953R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-168	GULLMANN SAUHS	52 879	USD	8 614	USD	26.09.2022	2 950 000	USD	2 950 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
262.	Interest Rate Sw ap C220957R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-61	GULLMANN SAUHS	21 795	USD	5 840	USD	26.09.2022	2 000 000	USD	2 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
263.	Interest Rate Sw ap C230326R 17.03.2023 (0)	-	IRS	IRH	-267	GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	96 150	USD	25 806	USD	17.03.2023	5 000 000	USD	5 000 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
264.	Interest Rate Sw ap C220415R 04.04.2022 (0)	-	IRS	IRH	-12	GULLMANN SAUHS	9 976	USD	6 732	USD	04.04.2022	3 800 000	USD	3 800 000	USD	04.04.2022	04.04.2022

OPIS 'CEL otwarcia pozycji' IRH
ORI
Ograniczenie ryzyka w alutach jego portfela papierów w wartościowych denotowanych w walutach obcych (IRH)
Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w wartościowych

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

strona 6 Tabela N-6		30.06.2021 --- 268 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 zapadalności instrumentu pochodnego	Termin wykonania instrumentu pochodnego	
						kwota	waluta	kwota	waluta								kwota
265.	Interest Rate Sw ap CI220958R 26.09.2022 (0)	-	IRS	IRH	-5	SOCIETE GENERALE PARIS	4 245	USD	2 920	USD	26.09.2022	1 000 000	USD	1 000 000	USD	26.09.2022	26.09.2022
266.	Interest Rate Sw ap CH2048R 03.04.2042 (0)	-	IRS	IRH	615	GULLMAN SAHLS	95 356	USD	53 744	USD	03.04.2042	1 000 000	USD	1 000 000	USD	03.04.2042	03.04.2042
267.	Interest Rate Sw ap CI230330R 17.03.2023 (0)	-	IRS	IRH	-91	GULLMAN SAHLS	73 805	USD	49 764	USD	17.03.2023	14 300 000	USD	14 300 000	USD	17.03.2023	17.03.2023
268.	Interest Rate Sw ap CI260440R 06.04.2026 (0)	-	IRS	IRH	-970	J.P. MORGAN SECURITIES PLC	450 080	USD	187 750	USD	06.04.2026	10 000 000	USD	10 000 000	USD	06.04.2026	06.04.2026
OPIS 'CEL otwarcia pozycji'					IRH	Ograniczenie ryzyka w walutowego portfela papierów w wartościowych denominowanych w walutach obcych (IRH)											
					ORI	Ograniczenie ryzyka inwestycyjnego portfela papierów w wartościowych											

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

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

Subfundusz nie miał na datę bilansową transakcji przy zobowiązaniu się Subfunduszu do odkupu (BSB). Ta sama informacja dotyczy poprzedniego okresu sprawozdawczego.

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

W odniesieniu do transakcji na 30.06.2021

30.06.2021		Transakcje typu Sell-buy-back (w tym repo)						AKTYWNE kontrakty SBB: 15		
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	179 451	PLN	Bez terminu	3.35%	FP270401	PL0000500260	180 000	179 451
2.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	100 841	PLN	Bez terminu	1.88%	FP280301	PL0000500310	102 000	100 841
3.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	78 694	PLN	Bez terminu	1.47%	FP300601	PL0000500278	80 000	78 694
4.	IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	68 500	PLN	Bez terminu	1.28%	FP300601	PL0000500278	70 000	68 500
5.	Haitong Bank SA Oddział w Polsce	SBB	15 335	PLN	Bez terminu	0.29%	DS1030	PL0000112736	16 000	15 335
6.	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	1 018 000	HUF	Bez terminu	0.24%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	13 091
7.	BNP PARIBAS	SBB	1 019 835	HUF	Bez terminu	0.25%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	13 140
8.	BNP PARIBAS	SBB	127 485	PLN	Bez terminu	2.38%	WZ0524	PL0000110615	127 000	127 485
9.	BNP PARIBAS	SBB	67 264	PLN	Bez terminu	1.26%	WZ0524	PL0000110615	67 000	67 264
10.	J.P. Morgan AG	SBB	233 689	CZK	Bez terminu	0.77%	CZ271101	CZ0001004105	247 200	41 457
11.	J.P. Morgan AG	SBB	42 421	PLN	Bez terminu	0.79%	DS1030	PL0000112736	50 000	42 421
12.	J.P. Morgan AG	SBB	973 465	HUF	Bez terminu	0.23%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	12 529
13.	J.P. Morgan AG	SBB	2 063 746	HUF	Bez terminu	0.50%	HU230801	HU0000404280	2 120 000	26 561
14.	J.P. Morgan AG	SBB	871 251	HUF	Bez terminu	0.21%	HU230801	HU0000404280	895 000	11 213
15.	J.P. Morgan AG	SBB	2 316 847	HUF	Bez terminu	0.56%	HU230801	HU0000404280	2 380 000	29 819
15. - pozycji.		PODSUMOWANIE				15.46%			827 801	

W odniesieniu do transakcji na 31.12.2020

31.12.2020		Transakcje typu Sell-buy-back (w tym repo)						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	

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

4) Zobowiązania z tytułu papierów wartościowych pożyczonych przez Subfundusz w trybie przepisów rozporządzenia o pożyczkach papierów wartościowych

Subfundusz nie miał na datę bilansową pożyczonych papierów wartościowych (udzielonych pożyczek - w charakterze pożyczkodawcy) ani zaciągniętych pożyczek papierów wartościowych (w charakterze pożyczkobiorcy). Ta sama informacja dotyczy poprzedniego okresu sprawozdawczego.

Nota - 8 Kredyty i pożyczki

Subfundusz nie miał na datę bilansową ani w okresie sprawozdawczym udzielonych pożyczek ani zaciągniętych kredytów. Ta sama informacja dotyczy poprzedniego okresu sprawozdawczego.

Nota - 9 Waluty i różnice kursowe

1) Zestawienie walutowej struktury pozycji bilansu:

NOTA-9 I. WALUTOWA STRUKTURA POZYCJI BILANSU	30.06.2021		31.12.2020	
	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie w tys.	Wartość na dzień bilansowy w walucie sprawozdania finansowego w tys.
I. Aktywa		5 355 570		4 318 988
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty		183 965		84 239
EUR	36 728	166 045	10 070	46 475
HUF	1	0	715	9
PLN	17 891	17 891	37 635	37 635
USD	8	29	32	120
2. Należności		2		25 500
EUR	31 310	141 548	0	0
PLN	-141 546	-141 546	25 500	25 500
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu		0		0
4. Składniki lokat notowane na aktyw nym rynku, w tym:		2 637 805		1 861 061
- dłużne papiery wartościowe		2 637 805		1 861 061
CZK	2 238 583	396 901	1 641 952	287 835
EUR	234 073	1 058 200	194 938	899 609
HUF	24 786 252	318 504	18 674 874	236 013
PLN	746 354	746 354	284 061	284 061
USD	30 983	117 846	40 853	153 543
5. Składniki lokat nienotowane na aktyw nym rynku, w tym:		2 533 798		2 348 188
CZK	-353 036	-62 593	477 354	83 681
EUR	-90 621	-409 685	5 668	26 161
HUF	-3 173 168	-40 776	-8 169 248	-103 242
PLN	745 186	745 186	113 071	113 071
USD	-6 165	-23 454	111	417
- dłużne papiery wartościowe		2 325 120		2 228 100
EUR	29 268	132 313	1 850	8 535
PLN	2 192 807	2 192 807	2 219 565	2 219 565
6. Nieruchomości	0	0	0	0
7. Pozostałe aktywa		0		0
II. Zobowiązania		964 817		206 100
CZK	2 114 153	374 840	1 849 899	324 286
EUR	115 243	520 990	164 792	760 470
HUF	29 532 138	379 486	10 835 575	137 011
PLN	-314 449	-314 449	-1 024 822	-1 024 822
USD	1 037	3 950	2 437	9 155

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 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 124/A/NBP/2021 z dnia 2021-06-30			
	Nazwa waluty	Kod waluty	Kurs średni
1.	dolar amerykański	1 USD	3,8035
2.	euro	1 EUR	4,5208
3.	forint (Węgry)	100 HUF	1,2850
4.	korona czeska	1 CZK	0,1773

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

NOTA-9 II. DODATNIE I UJEMNE RÓŻNICE KURSOWE W PRZEKROJU LOKAT FUNDUSZU	30.06.2021			
	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	0	0	2 977	3 982
Instrumenty pochodne	0	14 266	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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
 Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

NOTA-9 II. DODATNIE I UJEMNE RÓŻNICE KURSOWE W PRZEKROJU LOKAT FUNDUSZU	31.12.2020				30.06.2020			
	Dodatnie różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Dodatnie różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe zrealizowane w walucie sprawozdania w tys.	Ujemne różnice kursowe niezrealizowane w walucie sprawozdania w tys.
Akcje	0	0	0	0	0	0	0	0
Warranty subskrypcyjne	0	0	0	0	0	0	0	0
Prawa do akcji	0	0	0	0	0	0	0	0
Prawa poboru	0	0	0	0	0	0	0	0
Kwity depozytowe	0	0	0	0	0	0	0	0
Listy zastawne	0	0	0	0	0	0	0	0
Dłużne papiery wartościowe	26 739	46 291	0	0	31 113	24 136	0	0
Instrumenty pochodne	0	0	0	53 882	0	0	0	18 194
Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	0	0	0	0	0	0	0	0
Jednostki uczestnictwa	0	0	0	0	0	0	0	0
Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0	0	0	0	0	0
Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w spólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	0	0	0	0	0	0	0	0
Wierzytelności	0	0	0	0	0	0	0	0
Weksle	0	0	0	0	0	0	0	0
Depozyty	0	0	0	0	0	0	0	0
Waluty	0	0	0	0	0	0	0	0
Nieruchomości	0	0	0	0	0	0	0	0
Statki morskie	0	0	0	0	0	0	0	0
Inne	0	0	0	0	0	0	0	0

Nota - 10 Dochody i ich dystrybucja

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

NOTA-10 ZREALIZOWANY I NIEZREALIZOWANY ZYSK (STRATA) ZE ZBYCIA LOKAT	30.06.2021		31.12.2020		30.06.2020	
	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat w tys.	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.	Wartość zrealizowanego zysku (straty) ze zbycia lokat	Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku z wyceny aktywów w tys.
Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	-8 545	-24 845	51 346	37 111	40 512	32 591
Instrumenty pochodne	0	0	-9	0	14	0
Dłużne papiery wartościowe	-8 545	-24 845	51 355	37 111	40 498	32 591
Składniki lokat notowane na aktywnym rynku	-16 838	33 988	-42 490	-50 108	-66 785	-38 223
Listy zastawne	371	60	99	-47	0	-39
Instrumenty pochodne	-20 599	60 802	-53 958	-67 992	-65 972	-44 339
Dłużne papiery wartościowe	3 390	-26 874	11 369	17 931	-813	6 155
Nieruchomości	0	0	0	0	0	0
Pozostałe	0	0	0	0	0	0
Suma:	-25 383	9 143	8 856	-12 997	-26 273	-5 632

- 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 %	0.45 %	23.05.2018
E	1.00 %	0.45 %	31.12.2020
F	0.95 %	0.45 %	
I	1.00 %	0.45 %	31.12.2020
J	2.50 %	0.45 %	31.12.2020
K	2.00 %	0.36 %	31.12.2020
L	1.50 %	0.45 %	31.12.2020

- Stawki - w granicach poziomu maksymalnego określonego w Statucie – są zmieniane w drodze uchwały Zarządu Towarzystwa.
- W okresie od 31.12.2020 do 31.01.2021 – zgodnie z uchwałą Zarządu stawka (jednakowa dla JU wszystkich kategorii) wynosiła 0.80 % (dla JU kat. A – stawka ta obowiązywała od 23.05.2018).
- Od 1.02.2021 stawka wynosi (jednakowo dla wszystkich kategorii) – 0.45%, z zastrzeżeniem późniejszej zmiany (od 15.04.2021) dla JU kategorii J. Stawki te mają charakter czasowy – obowiązują do 31.12.2021, a od 1.01.2022 mają obowiązywać stawki 0.80 %.
- Stawka dla JU kat. K (od 15.04.2021) ma charakter czasowy – obowiązuje do 31.12.2021. Od 1.01.2022 ma obowiązywać stawka 0.64%.
- 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.

	1. półrocze 2021	rok 2020
Subfundusz naliczył wynagrodzenie za zarządzanie w wysokości (tys. zł)	10 952	32 831

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 subfunduszem – ujawniane szczegółowo w niniejszej notcie.
- koszty obsługi transakcji na aktywach subfunduszu (w tym opłaty), opłaty za wykonywanie czynności i usług bankowych w związku z Aktywami Subfunduszu bądź zobowiązaniami Subfunduszu:
 - opłaty i prowizje maklerskie – ujmowane w kosztach konkretnych transakcji,
 - opłaty i prowizje bankowe (z zastrzeżeniem odmiennych zasad w odniesieniu do depozytariusza),
 - prowizje 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,
 - opłaty i prowizje z tytułu korzystania z wielostronnych platform obrotu (MTF) oraz ze zorganizowanych platform obrotu (OTF) – w zakresie transakcji przeprowadzanych na rzecz Subfunduszu;
- podatki i opłaty oraz inne koszty wynikające z przepisów prawa lub regulacji wewnętrznych sądów, związane z subfunduszem:
 - 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,
 - podatki,
- koszty likwidacji;

(v) koszty obsługi prawnej (w tym pomocy prawnej i doradztwa podatkowego), niezwiązane z działalnością inwestycyjną Funduszu dokonywaną na rzecz Subfunduszu

Koszty określone powyżej (iii)(b) i (v) są pokrywane przez subfundusz do progu 0.1 % aktywów netto subfunduszu, a ewentualna nadwyżkę pokrywa (zwraca subfunduszowi) Towarzystwo. Są to koszty limitowane.

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

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	30.06.2021	31.12.2020	31.12.2019	31.12.2018
Wartość Aktywów Netto	4 390 753 tys. zł	4 112 888 tys. zł	5 010 447 tys. zł	4 850 490 tys. zł
Wartość JU A [zł]	12.98	12.98	12.77	12.57
Wartość JU E,F [zł]	100.00	100.00	--	--
Wartość JU I [zł]	99.91	100.00	--	--
Wartość JU J, K, L [zł]	1 000.00	1 000.00	--	--

JU kategorii I zostały wpisane do Statutu Funduszu 31.12.2020.

JU kategorii E, F, J, K, L zostały wpisane do Statutu Funduszu 31.12.2020 i do daty bilansowej nie zostały zbyte.

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.

Od 1.07.2021 (po dacie bilansowej) wycena portfela odbywa się w wartości godziwej (z określonymi wyjątkami). Informacja o zmianie zasad rachunkowości funduszy została zaprezentowana odrębnie w niniejszym sprawozdaniu.

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.

Przed 31.12.2020 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, K, L. Na datę bilansową nie dla każdej kategorii Jednostki Uczestnictwa 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

W roku 2021 weszła w życie zmiana w przepisach dot. szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych (Rozporządzenie Ministra Finansów, Funduszy i Polityki Regionalnej z 28.12.2020 zmieniające przepisy zostało ogłoszone 31.12.2020: Dz. U. poz. 2436).

Zgodnie z § 4 pkt. 1 rozporządzenia zmieniającego dostosowanie rachunkowości do przepisów w brzmieniu nadanym tym rozporządzeniem nastąpiło 1.07.2021. W związku z tym – stosownie do § 2 ust.1 pkt.1-2 rozporządzenia zmieniającego, niniejsze półroczne sprawozdanie finansowe Funduszu na dzień 30.06.2021 r. sporządzone zostało zgodnie z brzmieniem nadanym rozporządzeniem Ministra Finansów z dnia 24 grudnia 2007 r. w sprawie szczególnych zasad rachunkowości funduszy inwestycyjnych.

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 uzgadnianiu 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, w tym:
 - W przypadku składników lokat, których wartość godziwa jest szacowana inaczej niż bezpośrednio jako cena z aktywnego rynku (poziom 2 albo 3 hierarchii wartości godziwej), fundusz jest zobowiązany informować uczestników i potencjalnych uczestników funduszu w sprawozdaniach finansowych funduszu o łącznym udziale takich lokat w aktywach netto funduszu oraz o związanym z nimi ryzyku.
 - Ujawnienie w części 'Informacja dodatkowa'
 - *Zbiorcza wartość aktywów i zobowiązań sklasyfikowanych na poszczególnych poziomach (poziom 1, 2 lub 3) hierarchii wartości godziwej. W przypadku składników lokat, których wartość godziwa jest szacowana na poziomie 2 albo poziomie 3 hierarchii wartości godziwej, fundusz przedstawia informacje o łącznym udziale takich lokat w aktywach netto funduszu oraz o związanym z nimi ryzyku*
 - *Kwoty przeniesień między poziomem 1 a poziomem 2 hierarchii wartości godziwej, powody tych przeniesień i stosowane przez fundusz zasady ustalania, kiedy przeniesienia między poziomami powinny nastąpić. Informacje o przeniesieniu na każdy poziom są ujawniane i opisywane oddzielnie od informacji o przeniesieniu z każdego poziomu*
 - *W przypadku regularnych wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 2 albo poziomie 3 hierarchii wartości godziwej - opis techniki (technik) wyceny oraz dane wejściowe wykorzystane w wycenie wartości godziwej. Jeżeli nastąpiła zmiana techniki wyceny, w szczególności zastąpienie metody rynkowej metodą przychodów lub zastosowanie dodatkowej techniki wyceny, fundusz ujawnia zmianę i jej powody. W przypadku wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 3 hierarchii wartości godziwej fundusz przedstawia informacje ilościowe na temat nieobserwowalnych danych wejściowych wykorzystanych w wycenie wartości godziwej. Fundusz nie musi tworzyć ilościowych informacji w celu spełnienia wymogu ujawniania informacji, jeżeli ilościowe nieobserwowalne dane wejściowe nie zostały opracowane przez fundusz przy okazji wyceny wartości godziwej (np. kiedy fundusz wykorzystuje ceny z wcześniejszych transakcji lub informacje o cenach strony trzeciej bez korekty). Ujawniając informacje, fundusz nie może jednak pomijać ilościowych nieobserwowalnych danych wejściowych, które są istotne dla wyceny wartości godziwej i do których fundusz ma racjonalny dostęp*
 - *W przypadku wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 3 hierarchii wartości godziwej - uzgodnienie bilansu otwarcia i bilansu zamknięcia, przy czym oddzielnie ujawnia się zmiany, które w trakcie przypisywanego okresu dotyczyły:*
 - a) *łącznych zysków lub strat za okres ujęty w wyniku z operacji oraz pozycji wyniku z operacji, w których ujęto te zyski lub straty*
 - b) *operacji kupna, sprzedaży, emisji i rozliczeń (każdy z tych rodzajów zmian ujawnia się oddzielnie)*
 - c) *kwot przeniesień na poziom lub z poziomu 3 hierarchii wartości godziwej, powodów tych przeniesień i stosowanych przez fundusz zasad ustalania, kiedy przeniesienie między poziomami powinno nastąpić. Informacje o przeniesieniu na poziom 3 są ujawniane i opisywane oddzielnie od informacji o przeniesieniu z poziomu 3*

- W przypadku wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 3 hierarchii wartości godziwej - kwota łącznych zysków lub strat za okres ujęty w wyniku z operacji, ujęta w wyniku z operacji, która jest przypisywana zmianie niezrealizowanych zysków lub strat związanych z tymi aktywami lub zobowiązaniami posiadanymi na koniec okresu sprawozdawczego oraz pozycję (pozycje) wyniku z operacji, w której ujęto niezrealizowane zyski lub straty
- W przypadku regularnych i nieregularnych wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 3 hierarchii wartości godziwej - opis procesu wyceny przeprowadzonego przez fundusz, w tym na przykład informacje, jak fundusz podejmuje decyzje w sprawie zasad i procedur wyceny oraz analizuje zmiany wycen wartości godziwej w kolejnych okresach
- W przypadku wycen wartości godziwej sklasyfikowanych na poziomie 3 hierarchii wartości godziwej w zakresie:
 - a) wszystkich takich wycen - opisowa prezentacja wrażliwości wyceny wartości godziwej na zmiany nieobserwowalnych danych wejściowych, jeżeli zmiana tych danych wejściowych dająca inną kwotę może prowadzić do wyraźnie wyższej lub niższej wyceny wartości godziwej. Jeżeli istnieją powiązania między tymi danymi wejściowymi a innymi nieobserwowalnymi danymi wejściowymi wykorzystywanymi w wycenie wartości godziwej, fundusz przedstawia również opis tych powiązań i sposobu, w jaki mogą wzmocnić lub złagodzić wpływ zmian nieobserwowalnych danych wejściowych na wycenę wartości godziwej. W opisowej prezentacji wrażliwości na zmiany nieobserwowalnych danych wejściowych uwzględnia się ujawnione nieobserwowalne dane wejściowe
 - b) aktywów finansowych i zobowiązań finansowych, jeżeli zmiana jednego elementu lub większej ilości nieobserwowalnych danych wejściowych w celu odzwierciedlenia racjonalnie możliwych alternatywnych założeń istotnie zmieniałaby wartość godziwą - stwierdzenie tego faktu przez fundusz i ujawnienie skutków tych zmian. Fundusz ujawnia informacje na temat tego, jak obliczono skutek zmiany w celu odzwierciedlenia racjonalnie możliwego alternatywnego założenia
- Informacje o ustanowionych zastawach rejestrowych
- Informacje o dokonanych odpisach aktualizujących wartość aktywów funduszu
- Informacje o aktywach funduszu, w odniesieniu do których minął termin płatności lub występują opóźnienia w regulowaniu odsetek lub innych zobowiązań umownych
- Informacje o przestrzeganiu ustawowych ograniczeń inwestycyjnych;

Wartość składników portfela wycenianych 30.06.2021 zgodnie z dotychczasowymi przepisami w dniu 1.07.2021 (ustalona zgodnie ze zmienionymi przepisami przy zastosowaniu oszacowania wartości godziwej na poziomie 2 lub 3 hierarchii wartości godziwej) nie uległa istotnej zmianie - 0.02 % Wartości Aktywów Netto Subfunduszu.

Wpływ pandemii COVID-19 na Subfundusz

W roku 2020 i w 2021 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. W 2021 sytuacja na rynkach zaczęła się poprawiać. Początek kwietnia 2020 przyniósł istotne zmniejszenie skali zleceń odkupienia (po okresie marca) i w maju, czerwcu 2020 sytuacja uległa uspokojeniu, w szczególności także w związku z obniżkami oprocentowania lokat bankowych. W drugiej połowie 2020 wartość aktywów netto subfunduszy oraz wartości aktywów na jednostkę zaczęły wzrastać. Tendencja wzrostowa trwała w pierwszej połowie 2021: środki uczestników stopniowo powracają do funduszy inwestycyjnych, a wyniki inwestowania się poprawiają.

W 2020 Towarzystwo podejmowało działania w obszarze zarządzania portfelem, w tym zarządzania ryzykiem dla ograniczenia skutków pandemii, m.in. w zakresie decyzji uczestników o wypłatach – bez pogorszenia jakości kluczowych procesów operacyjnych. W pierwszej połowie 2021 stopień trudności wynikających z reakcji rynków na sytuację gospodarczą był istotnie mniejszy, niemniej spółka działała nadal w szczególnym reżimie sanitarnym i w formie szerokiego wykorzystania pracy zdalnej, przy utrzymaniu wdrożonych rozwiązań dotyczących sposobu zarządzania portfelem lokat, w tym uwzględniania ryzyka. Wynikało to m.in. z obserwowanej zmiany dynamiki rozwoju pandemii oraz wynikającej stąd poprawy wskaźników gospodarczych.

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 o stanie rachunków uczestników Towarzystwo oferuje system automatycznej obsługi i informacji [eFunduszePekao](https://www.pekaotfi.pl/). 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

PEKAO FUNDUSZY GLOBALNYCH SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY
Subfundusz PEKAO SPOKOJNA INWESTYCJA
Sprawozdanie Jednostkowe za okres półroczny kończący się 30 czerwca 2021 roku

Oznaczenia w systemach	ISIN JU PLPPTFI00394	IZFiA PIO046	Nr krajowy (KNF) PLSFIO00075
<i>Podstawowe dane na 30 czerwca 2021</i>			
Wartość aktywów netto	4 390 753 tys. zł	Wartość JU kat. A	12.98 zł

Warszawa, dnia 18.08.2021 roku.