

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

INNE INFORMACJE UJAWNIANE W ZWIĄZKU Z WYMOGAMI PRAWA

publikowane wraz ze sprawozdaniem finansowym

ZA OKRES PÓŁROCZNY KOŃCZĄCY SIĘ 30 CZERWCA 2021 ROKU

Warszawa, dnia 18.08.2021 roku.

Zarząd Pekao TFI S.A.:

Łukasz Kędzior
Prezes Zarządu

Jacek Babiński
Wiceprezes Zarządu

Mateusz Kowalski
Wiceprezes Zarządu

Sprawozdanie finansowe sporządza się w wersji elektronicznej oraz zostaje podpisane z wykorzystaniem kwalifikowanych podpisów elektronicznych.

W związku z wymogami w zakresie ujawniania informacji przez fundusze – wskazanymi w odpowiednich przepisach Unii Europejskiej – razem ze sprawozdaniem finansowym funduszu publikowane są inne informacje wymagane przepisami prawa.

Przepisy, w związku z którymi dokonywane są te ujawnienia

Rozporządzenie UE NR 2015/2365 (SFTR): ... Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 [SFTR] ;

Zakres informacji

1. Ujawnienia dotyczące stosowania określonych technik inwestycyjnych i inwestycjach w określone instrumenty finansowe.

Na podstawie art. 13 Rozporządzenia 2015/2365 (SFTR) sporządzane są informacje o stosowaniu: (i) transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz (ii) swapów przychodu całkowitego. Celem tego ujawnienia jest zapewnienie, by uczestnicy byli w stanie podejmować swoje decyzje inwestycyjne z uwzględnieniem ogólnego profilu ryzyka i zysku funduszu, podczas, gdy transakcje finansowane z użycie papierów wartościowych są powszechnie stosowane w celu sprawnego zarządzania portfelem, przy osiągnięciu celu inwestycyjnego lub w celu zwiększenia rentowności.

Ujawnienia SFTR (dotyczące stosowania określonych technik inwestycyjnych i inwestycjach w określone instrumenty finansowe)

Towarzystwo jest zobowiązane do przekazywania informacji o stosowaniu przez Fundusz: (i) transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz (ii) swapów przychodu całkowitego. Celem tego ujawnienia jest zapewnienie, by uczestnicy byli w stanie podejmować swoje decyzje inwestycyjne z uwzględnieniem ogólnego profilu ryzyka i zysku funduszu, podczas, gdy transakcje finansowane z użycie papierów wartościowych są powszechnie stosowane w celu sprawnego zarządzania portfelem, przy osiągnięciu celu inwestycyjnego lub w celu zwiększenia rentowności.

Pojęcia powyższe oznaczają – w odniesieniu do Funduszu:

- *Transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych* – transakcje 'udzielanie pożyczek papierów wartościowych', 'zaciąganie pożyczek papierów wartościowych', 'transakcje zwrotne kupno-sprzedaż' (BSB) lub 'transakcje zwrotną sprzedaż-kupno' (SBB) oraz 'transakcja odkupu', 'transakcję z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego' Fundusz nie zaciąga pożyczek papierów wartościowych.
- swap przychodu całkowitego – specyficzny kontrakt pochodny opisany w SFTR – Fundusz nie zawierał takich kontraktów.

Transakcje takie prezentowane są w 'Notach objaśniających' (Nota 7) do sprawozdania finansowego oraz poniżej, a ogólny opis / informacje zaprezentowany zostały w treści *Prospektu Informacyjnego Funduszu* [w Rozdziale VI], gdzie zostały przedstawione także kryteria doboru kontrahentów oraz wskazania co do maksymalnych poziomów takich transakcji. W Prospekcie Informacyjnym Funduszu wskazane są m.in.:

- ogólny opis transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ogólny opis swapów przychodu całkowitego stosowanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania i uzasadnienie ich stosowania,
- ogólne dane, które należy zgłaszać w odniesieniu do poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego:
- rodzaje aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji,
- maksymalny odsetek zarządzanych aktywów, które mogą być przedmiotem tych transakcji,
- szacowany odsetek zarządzanych aktywów, które będą przedmiotem poszczególnych rodzajów tych transakcji,
- kryteria wyboru kontrahentów (w tym status prawny, kraj pochodzenia, minimalny rating kredytowy),
- akceptowalne zabezpieczenia: opis akceptowalnych zabezpieczeń w odniesieniu do rodzajów aktywów, wystawcy, terminu zapadalności, płynności, a także zasad dywersyfikacji i korelacji zabezpieczeń,
- wycena zabezpieczeń: opis stosowanej metody wyceny zabezpieczeń i jej uzasadnienie oraz informacja, czy stosowana jest codzienna wycena według wartości rynkowej i codzienne zmienne depozyty zabezpieczające,
- zarządzanie ryzykiem: opis ryzyk związanych z transakcjami finansowanymi z użyciem papierów wartościowych i swapami przychodu całkowitego, jak również ryzyk związanych z zarządzaniem zabezpieczeniami, takich jak: ryzyko operacyjne, ryzyko płynności, ryzyko kontrahenta, ryzyko przechowywania i ryzyka prawne, a także, w stosownych przypadkach, ryzyk wynikających z ponownego wykorzystania tych zabezpieczeń,
- opis sposobu przechowywania aktywów podlegających transakcjom finansowanym z użyciem papierów wartościowych i swapom przychodu całkowitego oraz otrzymanych zabezpieczeń (np. u depozytariusza funduszu),
- opis wszelkich ograniczeń (regulacyjnych lub dobrowolnych) dotyczących ponownego wykorzystania zabezpieczeń,
- zasady dotyczące podziału zysków z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego: opis tego, jaki odsetek dochodów generowanych przez transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapy przychodu całkowitego jest przekazywany do przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania, a także opis kosztów i opłat przypisanych zarządzającemu lub stronom trzecim (np. tzw. "agent lender"). Prospekt emisyjny lub informacje ujawniane inwestorom wskazują również, czy są to jednostki powiązane z zarządzającym.

Stosowanie transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, według stanu na dzień bilansowy:

Dane ogólne:

- kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów,

W przypadku, gdy istnieją przypadki udzielenia (na datę bilansową) pożyczek papierów wartościowych wraz z szczegółowymi danymi tych umów są zaprezentowane w tabeli 1 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 8)

- kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania.

Dane dotyczące koncentracji:

- 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy),
- 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia).

Zbiórce dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego - w podziale na poniższe kategorie:

- rodzaj i jakość zabezpieczeń,

- okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności,
- waluta zabezpieczeń,

- okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte,

- kraj, w którym kontrahenci mają siedzibę,

- rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne).

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom,

- zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych.

Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego:

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego:

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach.

W tabeli 2 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7)

ND

Podmioty, z którymi na datę bilansową zawarte są kontrakty w tabeli 2 poniżej, wraz z informacją w zakresie wolumenu transakcji pozostających do rozliczenia (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7)

Nie jest stosowana obecnie polityka zabezpieczenia takich transakcji. Instrumenty finansowe będące przedmiotem transakcji stanowią odpowiedni poziom zabezpieczenia jej pełnego wykonania, a ponadto z kontrahentami podpisywane są odpowiednie umowy zabezpieczające. W szczególności tabeli (poniżej) zaprezentowane zostały oznaczenia odpowiednich instrumentów finansowych.

W przypadku części umów ramowych (zgodnie ze standardami międzynarodowymi) uzgodniona jest wymiana depozytów zabezpieczających – w pieniądzu.

ND

PLN – w przypadku polskich kontrahentów

EUR – w przypadku umów ramowych z podmiotami zagranicznymi

Szczegółowe informacje co do transakcji BSB i SBB pozostających do rozliczenia (na datę bilansową) zawarte są w tabeli 2 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 7), w tym ze wskazaniem okresu do zapadalności

Informacje co do transakcji pożyczek papierów wartościowych pozostających do rozliczenia (na datę bilansową) zawarte są w tabeli 1 poniżej (oraz w sprawozdaniu finansowym – w Nocie 5) – przy zawieraniu tych transakcji nie był wskazany termin zwrotu takiej pożyczki. Podmioty wskazane w Tabelach 1, 2 poniżej, odpowiednio z:

(i) Polski, (ii) Francji, (iii) Austrii, (iv) Wielkiej Brytanii (oraz po opuszczeniu przez Wielką Brytanię Unii Europejskiej: Niemcy, Holandia)
Rozliczenie dwustronne

W odniesieniu do transakcji BSB i SBB otrzymane depozyty zabezpieczające może być reinwestowany. Depozyt zabezpieczający otrzymany w związku z transakcjami pożyczania papierów wartościowych może być wykorzystywany w inwestycjach.

ND

Otrzymane depozyty zabezpieczające przechowywane są u Depozytariusza Funduszu.

W odniesieniu do transakcji pożyczek papierów wartościowych ma miejsce otrzymanie depozytu zabezpieczającego rozliczanego codziennie i przy zamknięciu pożyczki.

Saldy na rachunkach otrzymanych depozytów zabezpieczających wykazywane są w Nocie 4.

Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. "agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego.

Koszty lub opłaty związane z transakcjami (w szczególności prowizje i opłaty bankowe oraz prowizje i opłaty transakcyjne), są pokrywane przez Fundusz/ subfundusz bezpośrednio.

Przychody wynikające z transakcji są przychodami Funduszu / subfunduszu i stanowią jego dochód.

Wynik na transakcjach typu BSB i SBB jest ujawniany (za okres sprawozdawczy) w zestawieniu 'Rachunku wyniku' – jako element pozycji (odpowiednio) 'Przychody odsetkowe' i 'Koszty odsetkowe'.

Wskazane w powyższej tabeli, jako 'ND' dane nie są dostępne i nie ma obowiązku ich ujawniania w niniejszym sprawozdaniu lub nie dotyczą.

Odpowiednio: odwołania powyżej do Not odnoszą się do odpowiednich 'Not objaśniających' w sprawozdaniach finansowych jednostkowych dla każdego subfunduszu.

Tabela 1: Informacje o udzielonych pożyczkach papierów wartościowych – na datę bilansową.

- Subfundusze nie udzielały ani nie miały na datę bilansową udzielonych pożyczek papierów wartościowych.
- Fundusz nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych (nie jest to dozwolone postanowieniami Ustawy ani Statutu).

Tabela 2: Informacje o zawartych transakcjach bsb/sbb/repo/reverse repo - na datę bilansową.

Transakcje typu Buy-sell back										
30.06.2021										
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
Pekao Dynamicznych Spółek										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	10 039	PLN	Bez terminu	7.23%	WZ0524	PL0000110615	10 000	10 039
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						7.23%			10 039	
Pekao Akcji – Aktywna Selekcja										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	11 053	PLN	Bez terminu	10.33%	WZ0124	PL0000107454	11 000	11 053
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						10.33%			11 053	
Pekao Obligacji Plus										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	13 051	PLN	Bez terminu	0.49%	WZ0524	PL0000110615	13 000	13 051
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						0.49%			13 051	
Pekao Stabilnego Wzrostu										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	8 032	PLN	Bez terminu	2.88%	WZ0524	PL0000110615	8 000	8 032
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						2.88%			8 032	
Pekao Zrównoważony										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	12 047	PLN	Bez terminu	1.60%	WZ0524	PL0000110615	12 000	12 047
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						1.60%			12 047	
Pekao Akcji Polskich										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	25 099	PLN	Bez terminu	5.11%	WZ0524	PL0000110615	25 000	25 099
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						5.11%			25 099	
Pekao Małych i Średnich Spółek Rynku Polskiego										
1.	IPOPEMA SECURITIES SA	BSB	16 063	PLN	Bez terminu	8.70%	WZ0524	PL0000110615	16 000	16 063
1. - pozycja. PODSUMOWANIE						8.70%			16 063	

PEKAO FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Inne informacje - ujawniane na 30 czerwca 2021 roku

Transakcje typu *Sell-buy-back / repo*

30.06.2021

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
Pekao Obligacji – Dynamiczna Alokacja 2									
1. Haitong Bank SA Oddział w Polsce	SBB	9 366	PLN	Bez terminu	0.63%	PS1026	PL0000113460	10 000	9 366
2. BNP PARIBAS	SBB	32 506	PLN	Bez terminu	2.19%	DS0726	PL0000108866	30 000	32 506
3. BNP PARIBAS	SBB	43 485	PLN	Bez terminu	2.93%	DS0727	PL0000109427	40 000	43 485
4. BNP PARIBAS	SBB	14 059	PLN	Bez terminu	0.95%	PS1026	PL0000113460	15 000	14 059
5. BNP PARIBAS	SBB	23 486	PLN	Bez terminu	1.58%	PS1026	PL0000113460	25 000	23 486
6. J.P. Morgan AG	SBB	58 632	PLN	Bez terminu	3.95%	DS1029	PL0000111498	60 000	58 632
7. J.P. Morgan AG	SBB	21 566	PLN	Bez terminu	1.45%	DS1030	PL0000112736	25 000	21 566
7. - pozycji. PODSUMOWANIE					13.68%				203 100
Pekao Konserwatywny									
1. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	129 949	PLN	Bez terminu	2.98%	FP270401	PL0000500260	130 000	129 949
2. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	99 695	PLN	Bez terminu	2.29%	FP270401	PL0000500260	100 000	99 695
3. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	148 296	PLN	Bez terminu	3.40%	FP280301	PL0000500310	150 000	148 296
4. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	147 552	PLN	Bez terminu	3.38%	FP300601	PL0000500278	150 000	147 552
5. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	103 406	PLN	Bez terminu	2.37%	WZ0524	PL0000110615	103 000	103 406
6. RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	1 018 000	HUF	Bez terminu	0.30%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	13 091
7. BNP PARIBAS	SBB	3 050 156	HUF	Bez terminu	0.90%	HU230801	HU0000404280	3 000 000	39 450
8. BNP PARIBAS	SBB	1 019 835	HUF	Bez terminu	0.30%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	13 140
9. BNP PARIBAS	SBB	163 622	PLN	Bez terminu	3.75%	WZ0524	PL0000110615	163 000	163 622
10. BNP PARIBAS	SBB	68 268	PLN	Bez terminu	1.57%	WZ0524	PL0000110615	68 000	68 268
11. J.P. Morgan AG	SBB	139 911	CZK	Bez terminu	0.57%	CZ271101	CZ0001004105	148 000	24 821
12. J.P. Morgan AG	SBB	42 421	PLN	Bez terminu	0.97%	DS1030	PL0000112736	50 000	42 421
13. J.P. Morgan AG	SBB	2 258 439	HUF	Bez terminu	0.67%	HU230801	HU0000404280	2 320 000	29 067
14. J.P. Morgan AG	SBB	871 251	HUF	Bez terminu	0.26%	HU230801	HU0000404280	895 000	11 213
15. J.P. Morgan AG	SBB	973 465	HUF	Bez terminu	0.29%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	12 529
16. J.P. Morgan AG	SBB	2 027 794	HUF	Bez terminu	0.60%	HU240601	HU0000403068	2 000 000	26 062
17. J.P. Morgan AG	SBB	950 049	HUF	Bez terminu	0.28%	HU241001	HU0000403571	961 000	12 210
17. - pozycji. PODSUMOWANIE					24.88%				1 084 792
Pekao Konserwatywny Plus									
1. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	99 695	PLN	Bez terminu	4.17%	FP270401	PL0000500260	100 000	99 695
2. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	118 637	PLN	Bez terminu	4.96%	FP280301	PL0000500310	120 000	118 637
3. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	127 877	PLN	Bez terminu	5.35%	FP300601	PL0000500278	130 000	127 877
4. IPOPEMA SECURITIES SA	SBB	48 929	PLN	Bez terminu	2.05%	FP300601	PL0000500278	50 000	48 929
5. RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	SBB	1 018 000	HUF	Bez terminu	0.55%	HU230801	HU0000404280	1 000 000	13 091
6. BNP PARIBAS	SBB	48 036	PLN	Bez terminu	2.01%	DS1030	PL0000112736	50 000	48 036
7. BNP PARIBAS	SBB	110 420	PLN	Bez terminu	4.62%	WZ0524	PL0000110615	110 000	110 420
8. BNP PARIBAS	SBB	3 012	PLN	Bez terminu	0.13%	WZ0524	PL0000110615	3 000	3 012
9. J.P. Morgan AG	SBB	105 359	CZK	Bez terminu	0.78%	CZ300501	CZ0001004477	120 000	18 692
10. J.P. Morgan AG	SBB	2 175 694	HUF	Bez terminu	1.17%	HU230801	HU0000404280	2 235 000	28 002
11. J.P. Morgan AG	SBB	950 095	HUF	Bez terminu	0.51%	HU260401	HU0000404611	1 000 000	12 228
12. J.P. Morgan AG	SBB	1 709 632	HUF	Bez terminu	0.92%	HU270401	HU0000404157	1 845 000	22 003
13. J.P. Morgan AG	SBB	926 630	HUF	Bez terminu	0.50%	HU270401	HU0000404157	1 000 000	11 926
13. - pozycji. PODSUMOWANIE					27.72%				662 548
Pekao Obligacji Plus									
1. Haitong Bank SA Oddział w Polsce	SBB	5 166	PLN	Bez terminu	0.19%	DS0727	PL0000109427	4 800	5 166
2. BNP PARIBAS	SBB	200 091	CZK	Bez terminu	1.32%	CZ241201	CZ0001006167	210 000	35 479
3. BNP PARIBAS	SBB	200 466	CZK	Bez terminu	1.32%	CZ250201	CZ0001005870	201 000	35 545
4. BNP PARIBAS	SBB	32 506	PLN	Bez terminu	1.21%	DS0726	PL0000108866	30 000	32 506
5. BNP PARIBAS	SBB	85 914	PLN	Bez terminu	3.20%	DS0726	PL0000108866	80 000	85 914
6. BNP PARIBAS	SBB	47 221	PLN	Bez terminu	1.76%	PS1026	PL0000113460	50 000	47 221
7. BNP PARIBAS	SBB	14 059	PLN	Bez terminu	0.52%	PS1026	PL0000113460	15 000	14 059
8. J.P. Morgan AG	SBB	68 404	PLN	Bez terminu	2.54%	DS1029	PL0000111498	70 000	68 404
9. J.P. Morgan AG	SBB	2 027 794	HUF	Bez terminu	0.97%	HU240601	HU0000403068	2 000 000	26 062
10. J.P. Morgan AG	SBB	51 223	PLN	Bez terminu	1.90%	PS1026	PL0000113460	60 000	51 223
10. - pozycji. PODSUMOWANIE					14.93%				401 579
Pekao Zrównoważony									
1. J.P. Morgan AG	SBB	19 517	PLN	Bez terminu	2.59%	DS0727	PL0000109427	20 000	19 517
1. - pozycja. PODSUMOWANIE					2.59%				19 517

Wskazane w niniejszym zestawieniu kwoty oznaczają wartości w wycenie kontraktów na datę bilansową :

- Zagregowana wartość dla wszystkich subfunduszy dla kontraktów *bsb* 95 384 tys. zł
- Zagregowana wartość dla wszystkich subfunduszy dla kontraktów *sbb* 2 371 536 tys. zł

----- ***** -----