Informacja o technikach efektywnego zarządzania portfelem, w tym o umowach mających za przedmiot instrumenty pochodne

(zgodnie z Wytycznymi 35 i 40 Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych)

Fundusz może stosować techniki efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Funduszu pod warunkiem, że są one zgodne z celem inwestycyjnym Funduszu.

Stosowanie tych technik realizowane jest poprzez zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne, w tym także niewystandaryzowane instrumenty pochodne. Ponadto Fundusz w celu zwiększenia ekspozycji może udzielać pożyczek papierów wartościowych, tj.: zawierać umowy, na podstawie których Fundusz przenosi na pożyczkobiorcę własność określonej liczby papierów wartościowych, a pożyczkobiorca zobowiązuje się do zwrotnego przeniesienia własności tej samej liczby równoważnych papierów wartościowych w terminie wynikającym z umowy lub na żądanie Funduszu oraz do przekazania odpowiedniego zabezpieczenia i zapłaty wynagrodzenia.

Na dzień bilansowy ekspozycja Funduszu uzyskana poprzez techniki efektywnego zarządzania, w tym poprzez finansowe instrumenty pochodne przedstawia się następująco:

W zakresie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne

Nazwa Funduszu	Rodzaj transakcji	Tożsamość kontrahenta	Wartość ekspozycji bazowej na dzień bilansowy (w tys. zł) *	Wartość ekspozycji na dzień bilansowy (w tys. zł) **	Wartość otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł) ***
PZU FIO Ochrony Majątku	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	2 024	3	0
PZU FIO Ochrony Majątku	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	2 152	10	0

** Wartość ekspozycji bazowej została wykazana według wartości referencyjnej instrumentu pochodnego, zgodnie z Rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych*

*** Wartość ekspozycji została wykazana według wyceny na dzień bilansowy, przy czym wycena wystandaryzowanych instrumentów pochodnych została wykazana w wartości równej zero w związku z ujęciem w środkach pieniężnych efektu dziennych rozliczeń na rynku.*

**** Zabezpieczenie otrzymane przez Subfundusz zostało złożone w formie środków pieniężnych. Zabezpieczenia otrzymane w walucie obcej przeliczone są według średnich kursów NBP z dnia 31 grudnia 2020 r.*

W zakresie transakcji udzielania pożyczek papierów wartościowych

Na dzień bilansowy Fundusz nie posiadał żadnych udzielonych pożyczek papierów wartościowych.

Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym z uwzględnieniem poniesionych kosztów i opłat w okresie sprawozdawczym

Nazwa Funduszu	Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem w odniesieniu do całego okresu objętego sprawozdaniem wraz z poniesionymi bezpośrednimi i pośrednimi operacyjnymi kosztami i opłatami (w tys.)
PZU FIO Ochrony Majątku	-796