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 Subfunduszu pod warunkiem, że są one zgodne z celem inwestycyjnym Subfunduszu.

Stosowanie tych technik realizowane jest poprzez zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne, w tym także niewystandaryzowane instrumenty pochodne. Ponadto Subfundusz w celu zwiększenia ekspozycji może udzielać pożyczek papierów wartościowych, tj.: zawierać umowy, na podstawie których Subfundusz 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 Subfunduszu oraz do przekazania odpowiedniego zabezpieczenia i zapłaty wynagrodzenia.

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

W zakresie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne

Nazwa Subfunduszu	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 Akcji Krakowiak	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	113 522	738	0
PZU Akcji Krakowiak	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	11 799	106	0
PZU Akcji Krakowiak	FX Swap umowa	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	10 530	-130	0
PZU Akcji Krakowiak	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	35 525	86	230
PZU Akcji Krakowiak	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	1 726	17	0
PZU Akcji Krakowiak	Kontrakt terminowy	GPW SA	18 135	0	0
PZU Akcji MISS	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	1 978	14	0
PZU Akcji MISS	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	589	3	0
PZU Akcji Polskich	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	1 058	9	0
PZU Akcji Polskich	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	1 765	8	0
PZU Akcji Polskich	Kontrakt terminowy	GPW SA	1 701	0	0
PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	Forward umowa	BNP PARIBAS	12 536	-13	0
PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	30 247	156	0
PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	4 231	30	0

PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	FX Swap umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	6 945	7	0
PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	Kontrakt terminowy	Chicago Mercantile Exchange	1 435	0	0
PZU Akcji Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	6 025	43	0
PZU Akcji Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	4 917	-8	0
PZU Aktywny Akcji Globalnych	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	6 048	45	0
PZU Aktywny Akcji Globalnych	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	996	-2	0
PZU Aktywny Akcji Globalnych	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	2 152	19	0
PZU Dłużny Aktywny	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	7 589	30	0
PZU Dłużny Aktywny	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	3 680	-42	0
PZU Dłużny Aktywny	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	3 910	-40	0
PZU Dłużny Aktywny	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	524	0	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	Forward umowa	BNP PARIBAS	258	-5	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	Forward umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	320	-3	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	79 712	281	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	89 341	1 067	1 390
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	4 875	33	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	630	0	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	3 471	18	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	IRS	Goldman Sachs Bank Europe SE	65 215	-179	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	IRS	BNP PARIBAS	243 700	-763	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	IRS	BANK OF AMERICA	5 420	-42	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	IRS	J.P. Morgan AG	10 840	-239	0
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	2 358	0	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	22 793	151	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	14 798	70	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	22 748	33	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	9 094	-170	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	205	0	0
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	Kontrakt terminowy	Chicago Board of Trade	779	0	0
PZU Mazurek	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	303 064	2 625	2 162
PZU Mazurek	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	244 599	1 259	1 702
PZU Mazurek	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	79 662	622	690
PZU Mazurek	FX Swap umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	4 599	5	0

PZU Mazurek	FX Swap umowa	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	7 678	-94	0
PZU Mazurek	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	7 552	76	0
PZU Mazurek	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	6 549	0	0
PZU Medyczny	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	25 091	130	0
PZU Medyczny	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	65 050	-503	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	30 816	121	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	330 545	-4 720	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	Credit Agricole Bank Polska S.A.	111 065	358	580
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	18 445	10	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	4 599	5	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	122 815	400	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	IRS	Goldman Sachs Bank Europe SE	12 464	-1 715	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	IRS	BNP PARIBAS	6 667	-1 151	0
PZU Obligacji Krótkoterminowych	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	5 125	0	0
PZU Polonez	Forward umowa	BNP PARIBAS	495	-11	0
PZU Polonez	Forward umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	415	-4	0
PZU Polonez	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	506 009	4 172	4 783
PZU Polonez	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	9 199	47	0
PZU Polonez	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	279 086	2 846	3 420
PZU Polonez	FX Swap umowa	DEUTSCHE BANK POLSKA S.A.	4 599	5	0
PZU Polonez	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	1 299	14	0
PZU Polonez	IRS	BANK OF AMERICA	21 680	-167	0
PZU Polonez	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	9 430	0	0
PZU Sejf+	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	72 245	-52	0
PZU Sejf+	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	94 633	-938	0
PZU Sejf+	FX Swap umowa	J.P. Morgan AG	44 254	-959	0
PZU Sejf+	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	13 195	32	0
PZU Sejf+	IRS	BNP PARIBAS	650	-112	0
PZU Sejf+	IRS	J.P. Morgan AG	6 504	-118	0
PZU Zrównoważony	FX Swap umowa	Societe Generale S.A.	13 915	76	0
PZU Zrównoważony	FX Swap umowa	BNP PARIBAS	2 070	8	0
PZU Zrównoważony	FX Swap umowa	Santander Bank Polska S.A.	12 329	129	140
PZU Zrównoważony	Kontrakt terminowy	Eurex Exchange	262	0	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 Subfundusze nie posiadały 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 Akcji KRAKOWIAK	-1 789
PZU Akcji Małych i Średnich Spółek	-65
PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	-1 652
PZU Akcji Rynków Wschodzących	-807
PZU Akcji Polskich	-219
PZU Aktywny Akcji Globalnych	-287
PZU Dłużny Aktywny	-7 221
PZU Dłużny Rynków Wschodzących	-29 730
PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	-1 107
PZU Stabilnego Wzrostu MAZUREK	-73 289
PZU Medyczny	-7 156
PZU Obligacji Krótkoterminowych	-33 100
PZU Papierów Dłużnych POLONEZ	-105 531
PZU SEJF+	-8 517
PZU Zrównoważony	-2 721