

Informacja o wysokości dźwigni finansowej AFI

Metoda kalkulacji Ekspozycji AFI	Fundusz	Stan na dzień 30.06.2020	Min w okresie?	Średnia	Max w okresie?	Limit (max)	Możliwe źródła dźwigni finansowej
Metoda Brutto	Fundusz: EGB - Skarbiec BIS Powiązany FIZ	96,72	74,48	93,21	99,71	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: EGB - Skarbiec BIS Powiązany FIZ	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: EGB - Skarbiec Powiązany FIZ	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: EGB - Skarbiec Powiązany FIZ	96,21	63,46	90,96	99,72	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: EGB Podstawowy Niestandaryzowany Sekurytyzacyjny FIZ	77,23	61,55	83,45	95,55	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: EGB Podstawowy Niestandaryzowany Sekurytyzacyjny FIZ	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec Dochodowych Nieruchomości FIZAN	75,40	7,24	67,26	94,12	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec Dochodowych Nieruchomości FIZAN	100,00	100,00	100,00	100,17	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: City Living Polska FIZAN	99,80	77,27	99,13	100,00	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: City Living Polska FIZAN	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Sezam Dochodowych Nieruchomości FIZAN	79,05	78,74	79,83	81,07	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Sezam Dochodowych Nieruchomości FIZAN	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: SEZAM XVI FIZAN	6,87	6,61	9,38	11,44	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: SEZAM XVI FIZAN	100,00	100,00	100,00	100,00	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Subfundusz Skarbiec – Emerging Markets Opportunities	94,05	82,38	93,49	99,07	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Subfundusz Skarbiec – Emerging Markets Opportunities	100,00	100,00	100,00	100,00	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Subfundusz Skarbiec - Global High Yield Bond	85,14	82,44	93,26	112,54	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Subfundusz Skarbiec - Global High Yield Bond	100,00	100,00	100,16	118,00	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec GLOBALNI LIDERZY WZROSTU FIZ	201,53	97,47	215,21	348,01	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec GLOBALNI LIDERZY WZROSTU FIZ	100,77	95,15	102,92	202,37	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec - Absolute Return Globalnych Obligacji FIZ	292,64	135,63	237,60	438,72	3 000,00	Fundusz inwestuje zarówno w wystandaryzowane, jak i niewystandaryzowane, instrumenty pochodne, w szczególności, opcje, kontrakty terminowe oraz swapy. Fundusz zawiera również umowy z otrzymanym lub udzielonym przyrzeczeniem odkupu instrumentów finansowych, w celu zwiększenia dźwigni finansowej. Fundusz może w ramach polityki inwestycyjnej poszczególnych Subfunduszy wykorzystywać zabezpieczenie wynikające z odpowiednich umów w celu dokonywania kolejnych transakcji, zwiększając w ten sposób poziom dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec - Absolute Return Globalnych Obligacji FIZ	221,89	98,53	132,77	368,86	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec - Multiasset FIZ	112,60	92,60	139,21	250,99	3 000,00	Fundusz inwestuje zarówno w wystandaryzowane, jak i niewystandaryzowane, instrumenty pochodne, w szczególności, opcje, kontrakty terminowe oraz swapy. Wykorzystywana też może być technika krótkiej sprzedaży. Fundusz zawiera także umowy z otrzymanym lub udzielonym przyrzeczeniem odkupu instrumentów finansowych, w celu zwiększenia dźwigni finansowej. Fundusz może w ramach polityki inwestycyjnej poszczególnych Subfunduszy wykorzystywać zabezpieczenie wynikające z odpowiednich umów w celu dokonywania kolejnych transakcji, zwiększając w ten sposób poziom dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec - Multiasset FIZ	101,09	99,45	119,23	207,40	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec - Obligacyjny FIZ	204,14	189,68	216,06	265,90	400,00	Fundusz inwestuje zarówno w wystandaryzowane, jak i niewystandaryzowane, instrumenty pochodne, w szczególności, opcje, kontrakty terminowe oraz swapy. Fundusz zawiera również umowy z otrzymanym lub udzielonym przyrzeczeniem odkupu instrumentów finansowych, w celu zwiększenia dźwigni finansowej. Fundusz może w ramach polityki inwestycyjnej poszczególnych Subfunduszy wykorzystywać zabezpieczenie wynikające z odpowiednich umów w celu dokonywania kolejnych transakcji, zwiększając w ten sposób poziom dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec - Obligacyjny FIZ	149,79	105,04	147,10	206,16	400,00	

Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec Absolute Return Akcji FIZ	118,72	98,92	163,66	317,42	400,00	Fundusz inwestuje zarówno w wystandaryzowane, jak i niewystandaryzowane, instrumenty pochodne, w szczególności, opcje, kontrakty terminowe. Wykorzystywana również umowy z otrzymanym lub udzielonym przyrzeczeniem odkupu instrumentów finansowych, w celu zwiększenia dźwigni finansowej. Fundusz może w ramach polityki inwestycyjnej poszczególnych Subfunduszy wykorzystywać zabezpieczenie wynikające z odpowiednich umów w celu dokonywania kolejnych transakcji, zwiększając w ten sposób poziom dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec Absolute Return Akcji FIZ	108,81	99,33	129,51	295,99	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec Magna FIZ	179,32	104,98	188,00	216,72	400,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec Magna FIZ	100,77	95,55	104,42	145,84	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec - Top Funduszy Akcji Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty	97,09	83,28	95,68	101,63	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec - Top Funduszy Akcji Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty	100,00	99,99	100,01	100,12	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec - Top Funduszy Stabilnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty	97,80	86,45	94,63	102,23	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec - Top Funduszy Stabilnych Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty	100,00	99,99	100,01	100,10	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla aktywnych	140,82	120,95	136,57	217,21	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela oraz ryzykiem rynkowym.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla aktywnych	100,52	99,47	101,45	134,53	400,00	
Metoda Brutto	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla każdego	99,86	88,43	96,99	101,72	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla każdego	100,03	99,87	100,00	100,03	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla odważnych	160,90	132,29	157,45	294,76	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela oraz ryzykiem rynkowym.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: mFundusze Dobrze Lokujące SFIO - Subfundusz mFundusz dla odważnych	100,77	99,14	101,09	151,98	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2025	93,91	0,00	49,08	94,12	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2025	100,00	100,00	100,09	105,96	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2030	92,24	0,00	57,59	100,40	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2030	100,00	100,00	100,14	108,27	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2035	91,54	0,00	63,82	100,92	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2035	100,00	100,00	100,20	113,05	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2040	91,34	0,00	64,85	100,37	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2040	100,00	100,00	100,20	112,87	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2045	92,54	0,00	67,45	100,26	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2045	100,00	100,00	100,21	114,90	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2050	93,08	0,00	67,34	99,75	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2050	100,00	100,00	100,22	114,36	200,00	
Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2055	92,56	0,00	66,38	101,15	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2055	100,00	100,00	100,24	114,02	200,00	

Metoda Brutto	Fundusz: Skarbiec PPK 2060	92,49	0,00	62,53	99,99	200,00	Fundusz nie stosuje dźwigni finansowej. Możliwość powstania chwilowej dźwigni w skutek przejściowego niedopasowania poziomu zaangażowania niewystandaryzowanych instrumentów pochodnych mających na celu zabezpieczenie funduszu przed ryzykiem walutowym w stosunku do struktury walutowej portfela.
Metoda Zaangażowania	Fundusz: Skarbiec PPK 2060	100,00	100,00	100,09	105,96	200,00	