INFORMACJA O TECHNIKACH EFEKTYWNEGO ZARZĄDZANIA PORTFELEM

Podstawa prawna: Wytyczne nr 35 i 40 Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA) dotyczące funduszy typu ETF i innych kwestii związanych z UCITS.

Fundusz może stosować techniki efektywnego zarządzania portfelami Subfunduszy, tj.:

a) zawierać transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu (buy-sell-back, sell-buy-back, repo, reverse repo);
b) zawierać umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne;
c) zawierać umowy pożyczek papierów wartościowych, gdzie Fundusz jest stroną udzielającą pożyczki.

Dane dotyczące ekspozycji uzyskanej poprzez techniki efektywnego zarządzania portfelem
Dane te zawarte są Sprawozdaniu Finansowym Subfunduszy
Nota 6 – instrumenty pochodne
Nota 7 - transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu oraz pożyczki papierów wartościowych

Dane dotyczące tożsamości kontrahenta (kontrahentów) w ramach technik efektywnego zarządzania portfelem
Dane te zawarte są Sprawozdaniu Finansowym Subfunduszy – Zestawienie Lokat: tabela uzupełniająca

Rodzaj i wartość zabezpieczenia otrzymanego przez Subfundusz na dzień bilansowy w celu zmniejszenia ekspozycji kontrahenta

Subfundusz	Kontrahent	Rodzaj	Wartość

Brak

Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem w odniesieniu do całego okresu objętego rocznym sprawozdaniem finansowym Funduszu wraz z poniesionymi bezpośrednimi i pośrednimi operacyjnymi kosztami i opłatami

Subfundusz	Wartość dochodów
mBank Subfundusz Obligacji Korporacyjnych	247,77
mBank Subfundusz Obligacji	434,64
mBank Subfundusz Multiasset	28152,54
mBank Subfundusz Akcji Polskich	-325853,00

Warszawa, 15 maja 2020 roku

Krzysztof Mazurek
Prezes Zarządu

Witold Chuść
Wiceprezes Zarządu