

skorygowany

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Raport kwartalny FIZ-Q-E

za 3 kwartał 2013 roku obejmujący okres od 2013-07-29 do 2013-09-30

podstawa prawna:

§ 82 ust. 1 pkt 1 Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 19 lutego 2009 r. w sprawie informacji bieżących i okresowych przekazywanych przez emitentów papierów wartościowych oraz warunków uznawania za równoważne informacji wymaganych przepisami prawa państwa niebędącego państwem członkowskim (Dz. U. nr 33, poz. 259 z późn. zm.)

Data przekazania: 2013-10-10

PKO GLOBALNEJ STRATEGII FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY		
<small>(pełna nazwa funduszu)</small>		
PKO GLOBALNEJ STRATEGII FIZ	PKO TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.	
<small>(skrótowa nazwa funduszu)</small>	<small>(nazwa towarzystwa)</small>	
02-515	WARSZAWA	
<small>(kod pocztowy)</small>	<small>(miejsowość)</small>	
PUŁAWSKA		15
<small>(ulica)</small>		<small>(numer)</small>
(22) 358-56-00	(22) 358-56-01	poczta@pkotfi.pl
<small>(telefon)</small>	<small>(fax)</small>	<small>(e-mail)</small>
1080015581	146799458	www.pkotfi.pl
<small>(NIP)</small>	<small>(REGON)</small>	<small>(WWW)</small>

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Informacje o funduszu

Konstrukcja funduszu:		Typ funduszu:	
Subfundusz:	<input type="checkbox"/>	Fundusz sekurytyzacyjny:	<input type="checkbox"/>
Fundusz podstawowy:	<input type="checkbox"/>	Fundusz portfelowy:	<input type="checkbox"/>
Fundusz powiązany:	<input type="checkbox"/>	Fundusz aktywów niepublicznych:	<input type="checkbox"/>
		Waluta sprawozdania finansowego:	zł

Fundusze powiązane:	<small>(nazwa funduszu podstawowego)</small>
Fundusz z wydzielonymi subfunduszami:	<small>(nazwy funduszy powiązanych)</small>
	<small>(nazwa funduszu)</small>

Plik	Opis
GS-Wstęp do spr fin-30 09 13.pdf	Wstęp

WYBRANE DANE FINANSOWE	w tys. zł	w tys. EUR
III kwartał 2013		
I. Przychody z lokat	1 886	445
II. Koszty funduszu netto	3 054	720
III. Przychody z lokat netto	-1 168	-275
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	3 335	786
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	1 235	291
VI. Wynik z operacji	3 402	802
VII. Zobowiązania	1 729	410
VIII. Aktywa	366 271	86 870

Komisja Nadzoru Finansowego

IX. Aktywa netto	364 542	86 460
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	3 611 402	
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	100,94	23,94
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	0,94	0,22
Pozycje bilansu w tys. EUR przeliczone są według średniego kursu NBP z dnia 30 września 2013 roku.		
Pozycje rachunku wyników w tys. EUR przeliczone są według średniej arytmetycznej średnich kursów NBP z dnia 31 lipca, 30 sierpnia oraz 30 września 2013 roku.		

ZESTAWIENIE LOKAT

SKŁADNIKI LOKAT	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. Kwity depozytowe	925	949	0,26						
2. Instrumenty pochodne	0	1	0,00						
3. Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w spółnego inwestowania mające siedzibę za granicą	2 626	2 546	0,70						

TABELA ZUPEŁNIAJĄCE

KWITY DEPOZYTOWE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Liczba	Kraj siedziby emitenta	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. GAZPROM ADR (US3682872078)	Aktywny rynek - rynek regulowany	London International (USD)	34 500	ROSJA	925	949	0,26

INSTRUMENTY POCHODNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent (wystawca)	Kraj siedziby emitenta (wystawcy)	Instrument bazowy	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.
I. Wystandaryzowane instrumenty pochodne:							794	0
1. DAX FUTURE 20/12/13 (GXZ3)	Aktywny rynek - rynek regulowany	EUREX	Eurex	NIEMCY	index DAX	77		0
2. S&P EMINI FUTURES Dec 13 (ESZ3)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Chicago Mercantile Exchange	Chicago Mercantile Exchange	STANY ZJEDNOCZONE	index S&P 500	217		0
3. TURK DEX - ISE 30 FUTURES 31/10/13 (A5V3)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Turkish Derivatives Exchange	Turkish Derivatives Exchange (TKD)	TURCJA	index ISE 30	500		0
II. Niewystandaryzowane instrumenty pochodne							2	1
1. FX Swap EUR PLN 25/09/2013 02/10/2013	Nienotowane na rynku aktywnym	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	POLSKA	EUR (65.000,00)	1		0
2. FX Swap EUR PLN 26/09/2013 02/10/2013	Nienotowane na rynku aktywnym	Nie dotyczy	Bank Handlowy w Warszawie S.A.	POLSKA	EUR (200.000,00)	1		1

Liczba I, I.1, I.2, I.3 wyraża wartości ujemne (pozycje krótkie).

TYTUŁY UCZESTNICTWA EMITOWANE PRZEZ INSTYTUCJE WSPÓLNEGO INWESTOWANIA MAJĄCE SIEDZIBĘ ZA GRANICĄ	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Nazwa emitenta	Kraj siedziby emitenta	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. iShares MSCI Emerging Mk Index ETF - USD (US4642872349)	Aktywny rynek - rynek regulowany	NYSE Arca	Shares MSCI Emerging MKT Index (USA)	STANY ZJEDNOCZONE	20 000	2 626	2 546	0,70

NIERUCHOMOŚCI	Rok oddania do użytku	Data nabycia	Numer księgi wieczystej	Kraj położenia	Adres	Powierzchnia	Obciążenia	Służebności	Wartość według ceny nabycia w tys.

TABELA DODATKOWE

SKŁADNIKI LOKAT NABYTE OD PODMIOTÓW, O KTÓRYCH MOWA W ART. 107 USTAWY	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. FX Swap EUR PLN 25/09/2013 02/10/2013	0	0,00
2. FX Swap EUR PLN 26/09/2013 02/10/2013	1	0,00

Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem

Procentowy udział w aktywach ogółem
0,00
0,00
0,00
0,00
0,00
0,00
0,00
0,00

Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem

I. Aktywa	366 271			
1. Środek pieniężny i ich ekwiwalenty	60 968			
2. Należności	1 789			
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	300 003			
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	3 495			
- dłużne papiery wartościowe	0			
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	1			
- dłużne papiery wartościowe	0			
6. Nieruchomości	0			
7. Pozostałe aktywa	15			
II. Zobowiązania	1 729			
III. Aktywa netto (I-II)	364 542			
IV. Kapitał funduszu	361 140			
1. Kapitał wpłacony	361 140			
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	0			
V. Dochody zatrzymane	2 167			
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	-1 168			
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	3 335			
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	1 235			
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+-VI)	364 542			

Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	3 611 402			
Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	100,94			

Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	3 600 042
Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	100,94

Liczba certyfikatów inwestycyjnych w podziale na serie certyfikatów:
Seria A - 3 611 402 szt.

Wartość aktywów netto na poszczególne serie certyfikatów inwestycyjnych:
Seria A - 364 542 tys. zł
Wszystkie pozycje bilansu wyrażone są w tysiącach złotych poza liczbą i wartością certyfikatów inwestycyjnych wyrażoną w złotych.

	Narastająco kwartały roku bieżącego kwartał:	Okres roku poprzedniego od: do:	Narastająco kwartały roku poprzedniego kwartał: od: do:
RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 2013-07-29	3 2013	
	do 2013-09-30	2013-07-29 2013-09-30	
I. Przychody z lokat	1 886	1 886	
1. Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0	
2. Przychody odsetkowe	1 664	1 664	
3. Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	
4. Dodatnie saldo różnic kursowych	218	218	
5. Pozostałe	4	4	

II. Koszty funduszu	3 054	3 054		
1. Wynagrodzenie dla towarzystwa	2 709	2 709		
2. Wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0		
3. Opłaty dla depozytariusza	13	13		
4. Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	3	3		
5. Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	152	152		
6. Usługi w zakresie rachunkowości	0	0		
7. Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0		
8. Usługi prawne	0	0		
9. Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0		
10. Koszty odsetkowe	0	0		
11. Koszty związane z posiadaniem nieruchomości	0	0		
12. Ujemne saldo różnic kursowych	141	141		
13. Pozostałe	36	36		
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0		
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	3 054	3 054		
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	-1 168	-1 168		
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	4 570	4 570		
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym:	3 335	3 335		
- z tytułu różnic kursowych	-2 597	-2 597		
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	1 235	1 235		
- z tytułu różnic kursowych	-54	-54		
VII. Wynik z operacji	3 402	3 402		

Wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	0,94	0,94		
Rozwodniony wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	0,94	0,94		

Wszystkie pozycje rachunku wyników wyrażone są w tysiącach złotych poza wynikiem z operacji przypadającym na certyfikat inwestycyjny i rozwodnionym wynikiem z operacji przypadającym na certyfikat inwestycyjny wyrażonymi w złotych.

Narastająco
kwartaly roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartaly roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	od 2013-07-29	3 2013		
	do 2013-09-30	2013-07-29 2013-09-30		
I. Zmiana wartości aktywów netto	364 542	364 542		
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	0	0		
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy (razem), w tym:	3 402	3 402		
a) przychody z lokat netto	-1 168	-1 168		
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	3 335	3 335		
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	1 235	1 235		
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	3 402	3 402		
4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu (razem)	0	0		
a) z przychodów z lokat netto	0	0		
b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat	0	0		
c) z przychodów ze zbycia lokat	0	0		
5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem), w tym:	361 140	361 140		
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych)	361 140	361 140		
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych)	0	0		
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym	364 542	364 542		
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	364 542	364 542		
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	235 671	235 671		
II. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych	3 611 402	3 611 402		
1. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych w okresie sprawozdawczym:	3 611 402	3 611 402		
a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	3 611 402	3 611 402		
b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0	0		
c) saldo zmian	3 611 402	3 611 402		
2. Liczba certyfikatów inwestycyjnych narastająco od początku działalności funduszu, w tym:	3 611 402	3 611 402		
a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	3 611 402	3 611 402		
b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0	0		
c) saldo zmian	3 611 402	3 611 402		
3. Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	3 600 042	3 600 042		
III. Zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	100,94	100,94		
1. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	100,00	100,00		

2. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego	100,94	100,94		
3. procentowa zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	5,36	5,36		
4. minimalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	100,05	100,05		
- data wyceny	2013-08-02	2013-08-02		
5. maksymalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	100,94	100,94		
- data wyceny	2013-09-30	2013-09-30		
6. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny według ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym	100,94	100,94		
- data wyceny	2013-09-30	2013-09-30		
7. Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	100,94	100,94		
IV. Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:	7,39	7,39		
1. procentowy udział wynagrodzenia dla towarzystwa	6,56	6,56		
2. procentowy udział wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0,00	0,00		
3. procentowy udział opłat dla depozytariusza	0,00	0,00		
4. procentowy udział opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	0,01	0,01		
5. procentowy udział opłat za usługi w zakresie rachunkowości	0,00	0,00		
6. procentowy udział opłat za usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0,00	0,00		

Wszystkie pozycje zestawienia wyrażone są w tysiącach złotych z wyjątkiem wielkości procentowych i wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny.

W poz. III. 1 wykazano wartość emisji certyfikatów inwestycyjnych.

Narastająco
kwartaly roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartaly roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

RACHUNEK PRZEPŁYWÓW PIENIĘŻNYCH	od 2013-07-29	3 2013		
	do 2013-09-30	2013-07-29 2013-09-30		
A. Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	-297 283	-297 283		
I. Wpływy	2 941 991	2 941 991		
1. Z tytułu posiadanych lokat	12 365	12 365		
2. Z tytułu zbycia składników lokat	2 929 626	2 929 626		
3. Pozostałe	0	0		
II. Wydatki	3 239 274	3 239 274		
1. Z tytułu posiadanych lokat	8 554	8 554		
2. Z tytułu nabycia składników lokat	3 229 520	3 229 520		
3. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla towarzystwa	1 010	1 010		
4. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0		
5. Z tytułu opłat dla depozytariusza	7	7		
6. Z tytułu opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	1	1		
7. Z tytułu opłat za zezwolenia oraz opłat rejestracyjnych	166	166		
8. Z tytułu usług w zakresie rachunkowości	0	0		
9. Z tytułu usług w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0		
10. Z tytułu usług prawnych	0	0		
11. Z tytułu posiadania nieruchomości	0	0		
12. Pozostałe	16	16		
B. Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	361 622	361 622		
I. Wpływy	361 622	361 622		
1. Z tytułu wydania certyfikatów inwestycyjnych	361 140	361 140		
2. Z tytułu zaciągniętych kredytów	0	0		
3. Z tytułu zaciągniętych pożyczek	0	0		
4. Z tytułu spłaty udzielonych pożyczek	0	0		
5. Odsetki	482	482		
6. Pozostałe	0	0		
II. Wydatki	0	0		
1. Z tytułu wykupienia certyfikatów inwestycyjnych	0	0		
2. Z tytułu spłat zaciągniętych kredytów	0	0		

3. Z tytułu spłat zaciągniętych pożyczek	0	0	
4. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0	0	
5. Z tytułu wypłaty przychodów	0	0	
6. Z tytułu udzielonych pożyczek	0	0	
7. Odsetki	0	0	
8. Pozostałe	0	0	
C. Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	-3 371	-3 371	
D. Zmiana stanu środków pieniężnych netto (A+/-B)	64 339	64 339	
E. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	0	0	
F. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego (E+/-D)	60 968	60 968	

Wszystkie dane wyrażone są w tysiącach złotych.

NOTY

NOTA-1 POLITYKA RACHUNKOWOŚCI

Plik w załączeniu.

Plik	Opis
GS-Nota objaśniająca-30.09.13.pdf	Polityka rachunkowości.

NOTA-2 NALEŻNOŚCI FUNDUSZU	3 kwartał	
	2013	roku
1. Z tytułu zbytych lokat	1 785	
2. Z tytułu instrumentów pochodnych	0	
3. Z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0	
4. Z tytułu dywidendy	0	
5. Z tytułu odsetek	4	
6. Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0	
7. Z tytułu udzielonych pożyczek	0	
8. Pozostałe	0	

Dane wyrażone są w tysiącach złotych.

NOTA-3 ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	3 kwartał 2013 roku
1. Z tytułu nabytych aktywów	0
2. Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	0
3. Z tytułu instrumentów pochodnych	0
4. Z tytułu wpłat na certyfikaty inwestycyjne	0
5. Z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0
6. Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0
7. Z tytułu wypłaty przychodów funduszu	0
8. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0
9. Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów	0
10. Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów	0
11. Z tytułu gwarancji lub poręczeń	0
12. Z tytułu rezerw	15
13. Pozostałe zobowiązania	1 714
a) Zobowiązania wobec TFI	1 699

Dane wyrażone są w tysiącach złotych.

INFORMACJA DODATKOWA

Plik w załączeniu.

Plik	Opis
GS-Informacja dodatkowa-30.09.13.pdf	Informacja dodatkowa.

PODPISY

PODPISY OSÓB REPREZENTUJĄCYCH FUNDUSZ			
Data	Imię i Nazwisko	Stanowisko/Funkcja	Podpis
2013-10-10	Małgorzata Serafin	Główny Księgowy Funduszy	