NN Parasol Fundusz Inwestycyjny Otwarty

Ujawnienie informacji na podstawie art. 13 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 ("Rozporządzenie")

Zgodnie z art. 13 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012, na dzień bilansowy NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. działające jako spółka zarządzająca UCITS prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Funduszu:

Fundusz dokonując lokat aktywów:
– stosuje transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, w rozumieniu art. 3 pkt 11 Rozporządzenia;
– nie stosuje swapów przychodu całkowitego, w rozumieniu art. 3 pkt 18) Rozporządzenia.

W przypadku subfunduszy:

NN Średnich i Małych Spółek
NN Polski Odpowiedzialnego Inwestowania Obligacji
NN Globalnej Dywersyfikacji
NN Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapy przychodu całkowitego

W przypadku subfunduszy:

NN Akcji

W okresie sprawozdawczym zawarto 25 transakcji typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 5 dni.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	100	-
Sell-buy-back	-	-

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.

Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	liczba	wartość rynkowa (w tys. zł)
ALLEGRO.EU SA	LU2237380790	2022-05-24	25 000	596
ALLEGRO.EU SA	LU2237380790	2022-05-24	50 000	1 192
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	2022-06-13	25 000	2 392
			razem	**4 180**

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys.)
FRENCH REPUBLIC GO 0.5 25JUN44	FR0014002JM6	Aa2	AA	4 915

NN Indeks Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 2 transakcje typu sell-buy-back. Transakcje zawarto z Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności to 4 oraz 5 dni.

Na dzień bilansowy nie wystąpiły transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapów przychodu całkowitego.

NN Konserwatywny

W okresie sprawozdawczym zawarto 125 transakcji typu buy-sell-back, oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 8 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	16 402	1	1,58%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	DS0725	PLN	ING Bank Śląski	16 455	16 402
Buy-sell-back	15 580	1	1,50%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ0528	PLN	ING Bank Śląski	15 571	15 580
Buy-sell-back	33 623	1	3,24%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	33 603	33 623

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	477	-
Sell-buy-back	-	-

NN Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 70 transakcje typu buy-sell-back, 19 transakcji typu sell-buy-back oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 11 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	60 992	1	2,62%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ0528	PLN	ING Bank Śląski	60 953	60 992
Buy-sell-back	62 302	1	2,68%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	62 265	62 302

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	398	-
Sell-buy-back	-	62

NN Krótkoterminowych Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 128 transakcji typu buy-sell-back, oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 11 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	78 657	1	2,28%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	79 236	78 657
Buy-sell-back	74 362	1	2,16%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	74 240	74 362
Buy-sell-back	148 338	1	4,30%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	148 250	148 338

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	1 258	-
Sell-buy-back	-	-

NN Stabilnego Wzrostu

W okresie sprawozdawczym zawarto 122 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 11 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	26 591	1	1,59%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	27 009	26 591
Buy-sell-back	10 369	1	0,62%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	DS0725	PLN	ING Bank Śląski	10 402	10 369
Buy-sell-back	35 601	1	2,13%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	35 580	35 601

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	686	-
Sell-buy-back	-	-

NN Zrównoważony

W okresie sprawozdawczym zawarto 85 transakcji typu buy-sell-back, 2 transakcje typu sell-buy-back oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 8 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	11 026	1	1,35%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ0524	PLN	ING Bank Śląski	11 021	11 026
Buy-sell-back	9 880	1	1,21%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ0528	PLN	ING Bank Śląski	9 874	9 880
Buy-sell-back	3 403	1	0,42%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	3 397	3 403
Buy-sell-back	22 745	1	2,78%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	22 732	22 745

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	229	-
Sell-buy-back	-	5

NN Obligacji 2

W okresie sprawozdawczym zawarto 67 transakcje typu buy-sell-back, 13transakcje typu sell-buy-back oraz w dniach 1 i 4 lipca 2022 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 11 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	46 377	1	2,57%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-07-01	dwustronne	WZ1131	PLN	ING Bank Śląski	46 297	46 377
Buy-sell-back	46 479	1	2,58%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2022-07-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	46 452	46 479

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	277	-
Sell-buy-back	-	15

Warszawa, 30 sierpnia 2022 r.

Małgorzata Barska	Robert Bohynik	Tomasz Sułek	Łukasz Adaś
Prezes Zarządu	Wiceprezes Zarządu	Członek Zarządu	Członek Zarządu