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 Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania

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. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
AMREST HOLDINGS SE	ES0105375002	22/11/2022	80 988	331	1 554
CCC SA	PLCCC0000016	12/12/2022	91 000	847	3 971
CCC SA	PLCCC0000016	23/11/2022	10 000	93	436
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	28/11/2022	10 000	276	1 293
PEPCO GROUP NV	NL0015000AU7	12/12/2022	570 500	4 882	22 895
TEN SQUARE GAMES	PLTSQGM00016	23/11/2022	9 216	248	1 161
WARSAW STOCK EXCHANGE	PLGPW0000017	12/12/2022	50 000	375	1 761
			razem	**7 052**	**33 071**

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
FINLAND GOVERNME 1.375 15APR47 144A	FI4000242870	Aa1	AA+	1 452	6 812

REPUBLIC OF AUSTR 1.75 20OCT23 144A	AT0000A105W3	Aa1	AA+	5 443	25 526
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	Aa1	AA+	351	1 645
REPUBLIC OF AUSTRIA GO 6.25 15JUL27	AT0000383864	Aa1	AA+	209	980
			razem	**7 455**	**34 963**

W okresie sprawozdawczym nie zawarto transakcji typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back oraz nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Polski Odpowiedzialnego Inwestowania

W okresie sprawozdawczym zawarto 13 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniu 2 stycznia 2023 r. rozliczyła się zawarta w okresie sprawozdawczym transakcja typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 5 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	7 002	1	3,54%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	6 988	7 001

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	20	-
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. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
NEL ASA	NO0010081235	05/12/2022	127 000	168	788
PEPCO GROUP NV	NL0015000AU7	28/12/2022	19 000	163	762
			razem	**331**	**1 550**

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRIA GO 6.25 15JUL27	AT0000383864	Aa1	AA+	420	1 970

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Średnich i Małych Spółek

W okresie sprawozdawczym zawarto 13 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniach 2 i 3 stycznia 2023 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. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 5 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	10 300	1	4,27%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	10 303	10 300
Buy-sell-back	9 999	1	4,15%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	9 979	9 997

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	25	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Akcji

W okresie sprawozdawczym zawarto 40 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniach 2 i 3 stycznia 2023 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., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 5 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	52 900	1	4,69%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	52 917	52 900
Buy-sell-back	52 010	1	4,61%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	51 909	52 001

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	240	-
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. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
ALLEGRO.EU SA	LU2237380790	25/11/2022	73 527	401	1 882
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	21/11/2022	39 620	1 092	5 122
NEL ASA	NO0010081235	05/12/2022	724 000	958	4 491
PEPCO GROUP NV	NL0015000AU7	12/12/2022	71 500	612	2 869
			razem	**3 063**	**14 364**

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20APR25 144A	AT0000A2QRW0	Aa1	AA+	3 255	15 266

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Indeks Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 3 transakcje typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A. oraz Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności to 2 oraz 5 dni.

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

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

NN Globalnej Dywersyfikacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 219 transakcji typu buy-sell-back oraz 1 transakcję sell-buy-back oraz w dniu 2 stycznia 2023 r. rozliczyła się zawarta w okresie sprawozdawczym transakcja typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 5 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	1 796	1	1,32%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	1 793	1 796

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	28	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Konserwatywny

W okresie sprawozdawczym zawarto 17 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniach 2 i 3 stycznia 2023 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., NWAI Domem Maklerskim S.A. 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	64 561	1	5,61%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	64 440	64 561
Buy-sell-back	68 026	1	5,91%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	67 519	68 001
Buy-sell-back	1 999	1	0,17%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	1 991	1 999

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	1 072	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 99 transakcji typu buy-sell-back, 133 transakcji typu sell-buy-back oraz w dniach 2 i 3 stycznia 2023 r. rozliczyły się zawarte w okresie sprawozdawczym transakcje typu buy-sell-back. a w dniu 4 stycznia 2023 r. rozliczyła się zawarta w okresie sprawozdawczym transakcja typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Gospodarstwa Krajowego, w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 22 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	10 912	1	0,42%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	10 891	10 912
Buy-sell-back	22 007	1	0,85%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	21 917	22 003

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 udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	47 327	1	1,83%	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	2023-01-04	dwustronne	WZ0528	PLN	ING Bank Śląski	47 681	47 149

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	996	-
Sell-buy-back	-	4 918

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Obligacji 2

W okresie sprawozdawczym zawarto 93 transakcji typu buy-sell-back, 137 transakcji typu sell-buy-back oraz w dniu 4 stycznia 2023 r. rozliczyła się zawarta w okresie sprawozdawczym transakcja typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Gospodarstwa Krajowego, w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 22 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 udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	47 327	1	2,67%	Bank Gospodarstwa Krajowego	Polska	2023-01-04	dwustronne	WZ0528	PLN	ING Bank Śląski	47 681	47 149

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	641	-
Sell-buy-back	-	4 021

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Krótkoterminowych Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 205 transakcji typu buy-sell-back i 24 transakcji typu sell-buy-back oraz w dniu 2 stycznia 2023 r. rozliczyła się zawarta w okresie sprawozdawczym transakcja typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Gospodarstwa Krajowego, w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 14 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	7 003	1	0,23%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	6 974	7 001

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	2 760	-
Sell-buy-back	-	371

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Stabilnego Wzrostu

W okresie sprawozdawczym zawarto 205 transakcji typu buy-sell-back, 32 transakcje typu sell-buy-back oraz w dniach 2 i 3 stycznia 2023 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., NWAI Domem Maklerskim S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Gospodarstwa Krajowego, w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 14 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	16 368	1	0,94%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	16 337	16 368
Buy-sell-back	18 001	1	1,03%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	17 928	17 998

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	1 593	-
Sell-buy-back	-	299

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. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
ALLEGRO.EU SA	LU2237380790	05/12/2022	500 000	2 729	12 800

MERCATOR MEDICAL	PLMRCTR00015	07/12/2022	897	9	44
PEPCO GROUP NV	NL0015000AU7	12/12/2022	38 300	328	1 537
			razem	**3 066**	**14 381**

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20FEB31 144A	AT0000A2NW83	Aa1	AA+	3 255	15 266

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

NN Zrównoważony

W okresie sprawozdawczym zawarto 138 transakcji typu buy-sell-back, 45 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Bankiem Societe Generale S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Gospodarstwa Krajowego, w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 2 do 14 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 dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	432	-
Sell-buy-back	-	362

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. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
PEPCO GROUP NV	NL0015000AU7	22/12/2022	37 000	317	1 485

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
FINLAND GOVERNMENT 4.0 04JUL25 144A	FI4000006176	Aa1	AA+	420	1 971

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Warszawa, 6 kwietnia 2023 r.

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