Informacja o technikach efektywnego zarządzania portfelem, w tym o umowach mających za przedmiot instrumenty pochodne

Zgodnie z pkt. 35 i pkt. 40 Wytycznych dotyczących funduszy typu ETF i innych kwestii związanych z UCITS wydanych 1 sierpnia 2014 r. przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA/2014/937PL) Zarząd NN Investment Partners Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. (Towarzystwo) przedstawia poniższe informacje.

Fundusz może stosować techniki efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Funduszu/Subfunduszu pod warunkiem, że są one zgodne z celem inwestycyjnym Funduszu/Subfunduszu.

Stosowanie technik efektywnego zarzadzania portfelem inwestycyjnym Funduszu/ Subfunduszu realizowane jest poprzez zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne, w tym także niewystandaryzowane instrumenty pochodne. Instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne, zawierane przez Fundusz w celu zapewnienia sprawnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Funduszu/Subfunduszu, mogą być transakcjami terminowymi (futures lub forward) lub opcjami, w których instrumentami bazowymi są indeksy giełdowe lub papiery wartościowe lub Instrumenty Rynku Pieniężnego, które mogą być przedmiotem lokat Funduszu/Subfunduszu, lub kursy walut, lub umowami o przyszłe stopy procentowe, lub transakcjami wymiany stóp procentowych (swapami stóp procentowych), lub też swapami walutowymi. Zawieranie umów mających za przedmiot instrumenty pochodne bez względu na ich cel może odbywać się wyłącznie pod warunkami i na zasadach określonych w Ustawie oraz w rozporządzeniu Ministra Finansów w sprawie zawierania przez fundusz inwestycyjny otwarty umów, których przedmiotem są instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne, oraz przy uwzględnieniu celu inwestycyjnego Funduszu/ Subfunduszu. Ponadto Fundusz/ Subfundusz w celu zwiększenia ekspozycji może dokonywać transakcji udzielania pożyczek papierów wartościowych, tj.: transakcji, poprzez którą Fundusz/ Subfundusz przekazuje papiery wartościowe, a warunkiem transakcji jest zobowiązanie pożyczkobiorcy do zwrotu równoważnych papierów wartościowych w przyszłym terminie lub na żądanie strony przekazującej.

Na dzień bilansowy ekspozycja Funduszu uzyskana poprzez techniki efektywnego zarządzania portfelem, w tym poprzez finansowe instrumenty pochodne wyglądała następująco:

Nazwa Funduszu/Subfunduszu	Rodzaj transakcji	Tożsamość kontrahenta	Wartość ekspozycji bazowej na dzień bilansowy (w tys. zł)	Wartość ekspozycji na dzień bilansowy (w tys. zł)	Wartość otrzymanego/pobranego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)
NN Parasol FIO:					
NN Obligacji 2	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	990 131	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	41 488	-869	otrzymane zabezpieczenie: 1 829 pobrane zabezpieczenie: 938
NN Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania	brak	n/d	n/d	n/d	n/d
NN Obligacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	1 416 862	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	91 659	-3 813	otrzymane zabezpieczenie: 1 360 pobrane zabezpieczenie: 1 313
NN Konserwatywny	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	74 700	10 720	otrzymane zabezpieczenie: 11 255
	CIRS (Currency Interest Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	7 035	573	
NN Krótkoterminowych Obligacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	144 426	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	82 500	1 670	otrzymane zabezpieczenie: 10 083
	CIRS (Currency Interest Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	20 636	2 150	
NN Stabilnego Wzrostu	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	84 090	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	39 932	-835	otrzymane zabezpieczenie: 1 172 pobrane zabezpieczenie: 1 172
NN Zrównoważony	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	41 332	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	19 448	-407	otrzymane zabezpieczenie: 563 pobrane zabezpieczenie: 234
NN Akcji	brak	n/d	n/d	n/d	n/d
NN Globalnej Dywersyfikacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	31 907	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
NN Średnich i Małych Spółek	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	14 707	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających

NN Polski Odpowiedzialnego Inwestowania	brak	n/d	n/d	n/d	n/d
NN Indeks Obligacji	brak	n/d	n/d	n/d	n/d

Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem inwestycyjnym Funduszu/Subfunduszu z uwzględnieniem poniesionych kosztów i opłat wyniosły w okresie sprawozdawczym:

Nazwa Funduszu/Subfunduszu	Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem w odniesieniu do okresu objętego sprawozdaniem wraz z poniesionymi bezpośrednimi i pośrednimi operacyjnymi kosztami i opłatami (w tys. zł)
NN Parasol FIO:	
NN Obligacji 2	1 634
NN Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania	-
NN Obligacji	8 493
NN Konserwatywny	6 801
NN Krótkoterminowych Obligacji	67 133
NN Stabilnego Wzrostu	23 070
NN Zrównoważony	12 860
NN Akcji	-482
NN Globalnej Dywersyfikacji	-6 430
NN Średnich i Małych Spółek	338
NN Polski Odpowiedzialnego Inwestowania	363
NN Indeks Obligacji	-

Warszawa, 6 kwietnia 2023 r.

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