NN Specjalistyczny 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 ZAFI (podmiot zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym) 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 Subfundusz Globalny Spółek Dywidendowych (L)
NN Subfundusz Spółek Dywidendowych USA (L)
NN Subfundusz Europejski Spółek Dywidendowych (L)
NN Subfundusz Japonia (L)
NN Subfundusz Indeks Surowców (L)
NN Subfundusz Spółek Dywidendowych Rynków Wschodzących (L)
NN Subfundusz Globalny Odpowiedzialnego Inwestowania (L)
NN Subfundusz Globalny Długu Korporacyjnego (L)
NN Subfundusz Multi Factor (L)
NN Subfundusz Obligacji Rynków Wschodzących (Waluta Lokalna) (L)
NN Subfundusz Stabilny Globalnej Dywersyfikacji (L) (dawniej NN Subfundusz Stabilny Globalnej Alokacji (L))
NN Subfundusz Total Return (L)

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

W przypadku subfunduszu:

NN Subfundusz Obligacji Plus (L)

W okresie sprawozdawczym zawarto 175 transakcji typu buy-sell-back, 24 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 16 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.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	820	-
Sell-buy-back	-	260

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

NN Subfundusz Obligacji Korporacyjnych (L) (dawniej NN Subfundusz Stabilny Globalnej Alokacji (L))

W okresie sprawozdawczym zawarto 1 transakcję typu sell-buy-back. Transakcja była zawarta z Bankiem Polska Kasa Opieki S.A, w której zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił 2 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 oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły swapy przychodu całkowitego.

NN Subfundusz Konserwatywny Plus (L)

W okresie sprawozdawczym zawarto 222 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., Bank Polska Kasa Opieki S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Bank Societe Generale S.A. Warszawa 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	15 458	1	7,69%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2023-01-03	dwustronne	PS0527	PLN	ING Bank Śląski	15 429	15 458
Buy-sell-back	16 004	1	7,96%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	15 885	15 999
Buy-sell-back	999	1	0,50%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2023-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	995	999

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	483

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

Warszawa, 6 kwietnia 2023 r.

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