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 Stabilny Globalnej Alokacji (L) (dawniej NN Subfundusz Stabilny Globalnej Alokacji EUR (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 (L) Obligacji Plus

W okresie sprawozdawczym zawarto 205 transakcji typu buy-sell-back, 2 transakcje typu sell-buy-back oraz 04.01.2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., NWAI Dom Maklerski S.A, Bank Polska Kasa Opieki 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 1 do 23 dni.

Zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN.

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	5 638	1	0,39%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	5 358	5 635
Buy-sell-back	1 040	1	0,07%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	1 003	1 039
Buy-sell-back	831	1	0,06%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	794	830
Buy-sell-back	10 011	1	0,69%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	PS0424	PLN	ING Bank Śląski	9 950	10 007
Buy-sell-back	1 986	1	0,14%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	1 988	1 986
Buy-sell-back	7 668	1	0,53%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	7 649	7 664
Buy-sell-back	11 903	1	0,82%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	11 849	11 893
Buy-sell-back	4 955	1	0,34%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	4 937	4 951
Buy-sell-back	13 679	1	0,94%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	13 649	13 678
	57 711	9	3,97%								57 177	57 685

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	154	-
Sell-buy-back	-	-

NN Subfundusz Konserwatywny Plus (L)

W okresie sprawozdawczym zawarto 97 transakcji typu buy-sell-back, oraz 04.01.2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., NWAI Dom Maklerski S.A, Bank Polska Kasa Opieki 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 1 do 22 dni.

Zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN.

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	705	1	0,91%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	670	705
Buy-sell-back	130	1	0,17%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	125	130
Buy-sell-back	104	1	0,13%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	99	104
Buy-sell-back	1 986	1	2,57%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	1 988	1 986
Buy-sell-back	959	1	1,24%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	956	958
Buy-sell-back	1 984	1	2,56%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	1 975	1 982
Buy-sell-back	977	1	1,26%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	975	977
	6 844	7	8,84%								6 788	6 841

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	10	-
Sell-buy-back	-	-

Warszawa, 13 kwietnia 2022 r.

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