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 Akcji
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 Konserwatywny

W okresie sprawozdawczym zawarto 157 transakcji typu buy-sell-back, oraz w dniach 4 i 5 stycznia 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, 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 23 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	4 581	1	0,49%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	4 353	4 579
Buy-sell-back	845	1	0,09%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	815	845
Buy-sell-back	675	1	0,07%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	645	675
Buy-sell-back	10 011	1	1,07%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	PS0424	PLN	ING Bank Śląski	9 950	10 007
Buy-sell-back	6 230	1	0,66%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	6 215	6 227
Buy-sell-back	24 797	1	2,64%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	24 685	24 778
Buy-sell-back	14 368	1	1,53%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	14 317	14 358
Buy-sell-back	5 398	1	0,57%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	5 362	5 394
	66 906	8	7,12%								66 343	66 863

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	150	-
Sell-buy-back	-	-

NN Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 174 transakcje typu buy-sell-back, 9 transakcji typu sell-buy-back oraz w dniach 4 i 5 stycznia 2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back.
Transakcje były zawierane z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie, Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., ING Bankiem Śląskim, Santander Bank Polska S.A., Ipopema Securities S.A. oraz NWAI Dom Maklerski S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 23 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	15 017	1	0,57%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	PS0424	PLN	ING Bank Śląski	14 925	15 011
Buy-sell-back	24 824	1	0,94%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	24 847	24 819
Buy-sell-back	12 042	1	0,46%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	WZ1122	PLN	ING Bank Śląski	12 037	12 041
Buy-sell-back	49 404	1	1,88%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	49 371	49 400
	101 286	4	3,85%								101 180	101 271

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	78	-
Sell-buy-back	-	11

NN Krótkoterminowych Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 218 transakcji typu buy-sell-back oraz w dniach 4 i 5 stycznia 2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back.

Transakcje były zawierane z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie, Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A., Ipopema Securities S.A. oraz NWAI Dom Maklerski S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 23 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	4 934	1	0,11%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	4 689	4 932
Buy-sell-back	909	1	0,02%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	877	909
Buy-sell-back	727	1	0,02%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	695	727
Buy-sell-back	10 426	1	0,23%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	10 436	10 424
Buy-sell-back	6 710	1	0,15%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	6 693	6 706
Buy-sell-back	11 038	1	0,25%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	WZ1122	PLN	ING Bank Śląski	11 034	11 038
Buy-sell-back	19 838	1	0,45%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	19 748	19 822
Buy-sell-back	10 900	1	0,25%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	10 862	10 893
Buy-sell-back	33 221	1	0,75%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	33 147	33 218
	98 702	9	2,22%								98 180	98 668

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	244	-
Sell-buy-back	-	-

NN Stabilnego Wzrostu

W okresie sprawozdawczym zawarto 188 transakcji typu buy-sell-back, 4 typu sell-buy-back oraz w dniach 4 i 5 stycznia 2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back.
Transakcje były zawierane z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie, Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A., Ipopema Securities S.A. oraz NWAI Dom Maklerski S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 23 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	8 810	1	0,46%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	8 372	8 806
Buy-sell-back	1 625	1	0,08%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	1 567	1 624
Buy-sell-back	1 298	1	0,07%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	1 240	1 297
Buy-sell-back	15 017	1	0,78%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	PS0424	PLN	ING Bank Śląski	14 925	15 011
Buy-sell-back	14 894	1	0,77%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	14 908	14 891
Buy-sell-back	11 981	1	0,62%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	11 952	11 975
Buy-sell-back	8 028	1	0,41%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	WZ1122	PLN	ING Bank Śląski	8 025	8 028
Buy-sell-back	15 870	1	0,82%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	15 799	15 858
Buy-sell-back	14 864	1	0,77%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	14 811	14 853
Buy-sell-back	5 928	1	0,31%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	5 924	5 928
Buy-sell-back	9 771	1	0,50%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	9 749	9 770
	108 086	11	5,58%								107 273	108 042

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	162	-
Sell-buy-back	-	-

NN Zrównoważony

W okresie sprawozdawczym zawarto 165 transakcji typu buy-sell-back, 4 typu sell-buy-back oraz w dniach 4 i 5 stycznia 2022 r. rozliczyły się zawarte w 2021 r. transakcje typu buy-sell-back.
Transakcje były zawierane z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie, Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A., Ipopema Securities S.A. oraz NWAI Dom Maklerski S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 23 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	1 762	1	0,18%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0432	PLN	ING Bank Śląski	1 675	1 761
Buy-sell-back	325	1	0,03%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS0727	PLN	ING Bank Śląski	313	324
Buy-sell-back	260	1	0,03%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	DS1030	PLN	ING Bank Śląski	248	259
Buy-sell-back	15 887	1	1,63%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0126	PLN	ING Bank Śląski	15 902	15 884
Buy-sell-back	2 396	1	0,25%	NWAI Dom Maklerski S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ0525	PLN	ING Bank Śląski	2 390	2 395
Buy-sell-back	4 014	1	0,41%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-05	dwustronne	WZ1122	PLN	ING Bank Śląski	4 012	4 014
Buy-sell-back	15 809	1	1,62%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	15 799	15 808
	40 453	7	4,15%								40 339	40 446

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	34	-
Sell-buy-back	-	-

NN Indeks Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 2 transakcje typu sell-buy-back. Transakcje zawarto z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie oraz Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., okres zapadalności 2 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.

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

NN Obligacji 2

W okresie sprawozdawczym zawarto 173 transakcje typu buy-sell-back, 9 typu sell-buy-back oraz w dniu 4 stycznia 2022 r. rozliczyła się zawarta w 2021 r. transakcja typu buy-sell-back.
Transakcje były zawierane z Bankiem Societe Generale S.A. w Warszawie, Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A., Ipopema Securities S.A., ING Bankiem Śląskim oraz NWAI Dom Maklerski S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności od 1 do 23 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	23 714	1	1,18%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2022-01-04	dwustronne	WZ1126	PLN	ING Bank Śląski	23 698	23 712

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

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

Warszawa, 13 kwietnia 2022 r.

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