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 zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)
NN Parasol FIO:					
NN Obligacji 2	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	395 152	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	686 694	-17 330	15 592
NN Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania	brak	n/d	n/d	n/d	n/d
NN Obligacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	514 785	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	774 610	-24 118	22 537
NN Konserwatywny	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	102 000	9 077	-8 049
NN Krótkoterminowych Obligacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	873 684	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	904 091	19 721	-21 617
NN Stabilnego Wzrostu	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	387 098	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	180 367	-4 950	3 726
NN Zrównoważony	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	189 901	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
	IRS (Interst Rate Swap)	FC-Instytucja Finansowa	86 770	-2 260	1 518
NN Akcji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	18 232	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
NN Globalnej Dywersyfikacji	Kontrakt Terminowy	n/d (giełda)	128 707	n/d	Zyski i straty na kontraktach terminowych rozliczane są codziennie w ramach systemu uzupełniania depozytów zabezpieczających
NN Średnich i Małych Spółek	brak	n/d	n/d	n/d	n/d
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	44 113,76
NN Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania	-
NN Obligacji	75 969,04
NN Konserwatywny	2 846,27
NN Krótkoterminowych Obligacji	55 963,52
NN Stabilnego Wzrostu	15 248,19
NN Zrównoważony	7 762,52
NN Akcji	-1 397,88
NN Globalnej Dywersyfikacji	436,69
NN Średnich i Małych Spółek	-351,55
NN Polski Odpowiedzialnego Inwestowania	-480,01
NN Indeks Obligacji	-

Warszawa, 13 kwietnia 2022 r.

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