

Informacje ujawniane na podstawie 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 (Dz. Urz. UE L 337/1 z 23.12.2015 r.) („Rozporządzenie SFTR”).

Niniejszy dokument zawiera informacje ujawniane na podstawie Rozporządzenia SFTR dla poniższych subfunduszy wydzielonych w ramach **PZU Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasolowego** :

Subfundusz PZU Akcji Globalnych Trendów	2
Subfundusz PZU Akcji KRAKOWIAK	4
Subfundusz PZU Akcji Małych i Średnich Spółek	8
Subfundusz PZU Akcji Polskich.....	10
Subfundusz PZU Akcji Rynków Rozwiniętych	11
Subfundusz PZU Aktywny Globalny.....	15
Subfundusz PZU Dłużny Aktywny	19
Subfundusz PZU Dłużny Rynków Wschodzących.....	23
Subfundusz PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	27
Subfundusz PZU Medyczny	31
Subfundusz PZU Obligacji Krótkoterminowych.....	35
Subfundusz PZU Papierów Dłużnych POLONEZ	39
Subfundusz PZU SEJF+	43
Subfundusz PZU Stabilnego Wzrostu MAZUREK.....	47
Subfundusz PZU Zrównoważony	51

Subfundusz PZU Akcji Globalnych Trendów

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego.

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back ¹	2	-
sell-buy back ²	-	1
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ³	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

¹ przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

² koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

³ przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Akcji KRAKOWIAK

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	32 038	2,39%	nie dotyczy	-	x	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
	reverse repo	-
Repo	-	-
buy-sell-back	IPOPEMA Securities S.A.	32 038
sell-buy-back	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń /Wartość papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie na dzień bilansowy (w tys. zł)
Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej 32 079

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych	Rodzaj	Waluta	Kraj	Typ	Wartość godziwa	Depozytariusz	Okres zapadalności zabezpieczeń
---------------------------------	--------	--------	------	-----	-----------------	---------------	---------------------------------

z użyciem papierów wartościowych	zabezpieczenia	zabezpieczenia	siedziby kontrahenta	rozliczenia i rozrachunku	otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	(dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	32 079	Deutsche Bank Polska S.A.	-	X	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych ¹	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
---	-----------------------	--------------------

papierów wartościowych		
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	1 699	-
sell-buy back ^{**}	-	2
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Akcji Małych i Średnich Spółek

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego.

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	2	-
sell-buy back ^{**}	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Akcji Polskich

Nie dotyczy – w okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego.

Subfundusz PZU Akcji Rynków Rozwiniętych

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	2 807	8,19%	nie dotyczy	-	x	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	IPOPEMA Securities S.A.	2 807
sell-buy-back	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń /Wartość papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie na dzień bilansowy (w tys. zł)	
Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej	2 812

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	2 812	Deutsche Bank Polska S.A.	-	X	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [†]	60	-
sell-buy back ^{**}	-	1
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

[†] przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Aktywny Globalny

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	60 179	38,10%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	60 179
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Fundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	-	-
sell-buy back ^{**}	-	1 371
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Dłużny Aktywny

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	9 685	14,89%	nie dotyczy	-	x	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	9 685
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Fundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	-	-
sell-buy back ^{**}	-	30
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Dłużny Rynków Wschodzących

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	2 904	2,10%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	2 904
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Fundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	-	-
sell-buy back ^{**}	-	51
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	34 089	34,03%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	34 089
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [†]	-	-
sell-buy back ^{**}	-	1 082
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

[†] przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Medyczny

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	5 613	5,26%	nie dotyczy	-	x	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	IPOPEMA Securities S.A.	5 613
sell-buy-back	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń /Wartość papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie na dzień bilansowy (w tys. zł)	
Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej	5 624

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	5 624	Deutsche Bank Polska S.A.	-	X	-	-	-	-	-
sell-buy-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych ¹	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

¹dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back ¹	147	-
sell-buy back ²	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ³	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

¹ przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

² koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

³ przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Obligacji Krótkoterminowych

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	848 629	25,81%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)					
reverse repo	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	416 493	Alior Bank S.A.	300 015	Santander Bank Polska S.A.	69 143
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Fundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	30	-
sell-buy back ^{**}	-	22 402
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Papierów Dłużnych POLONEZ

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	667 314	19,49%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)					
reverse repo	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	222 274	Bank Handlowy S.A.	211 913	mBank S.A.	111 490
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Fundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	7	-
sell-buy back ^{**}	-	10 682
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU SEJF+

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	283 791	26,27%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)	
reverse repo	-	-
Repo	-	-
buy-sell-back	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	283 791
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych	Rodzaj	Waluta	Kraj	Typ	Wartość godziwa	Depozytariusz	Okres zapadalności zabezpieczeń
---------------------------------	--------	--------	------	-----	-----------------	---------------	---------------------------------

z użyciem papierów wartościowych	zabezpieczenia	zabezpieczenia	siedziby kontrahenta	rozliczenia i rozrachunku	otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	(dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych ¹	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
---	-----------------------	--------------------

papierów wartościowych		
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [*]	21	-
sell-buy back ^{**}	-	5 586
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

^{*} przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Stabilnego Wzrostu MAZUREK

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	597 101	18,12%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)					
reverse repo	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	383 691	Bank Handlowy S.A.	89 276	Societe Generale SA Od. W Polsce	73 459
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back [†]	-	-
sell-buy back ^{**}	-	10 682
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ^{***}	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

[†] przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{**} koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

^{***} przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.

Subfundusz PZU Zrównoważony

Dane dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego

Dane zbiorcze na dzień bilansowy:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość na dzień bilansowy (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem	Procentowy udział w aktywach mogących być przedmiotem pożyczek papierów wartościowych*	Okres zapadalności transakcji						
				poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	transakcje otwarte
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	39 115	19,66%	nie dotyczy	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

* dotyczy udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych. Wartość aktywów mogących być przedmiotem pożyczek została określona jako wartość bilansowa udzielonych przez Subfundusz pożyczek papierów wartościowych w relacji do kwoty określonej w Prospekcie Informacyjnym jako szacunkowy odsetek zarządzanych aktywów mogących być przedmiotem pożyczek pomniejszonej o wartość środków pieniężnych i ich ekwiwalentów.

Dane dotyczące koncentracji na dzień bilansowy:

Najważniejsi kontrahenci zawieranych przez Subfundusz transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Najważniejsi kontrahenci/ Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł)					
reverse repo	-	-	-	-	-	-
Repo	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	IPOPEMA Securities S.A.	19 926	mBank S.A.	16 041	Societe Generale SA Od. W Polsce	3 148
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Subfundusz we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Na dzień bilansowy Subfundusz nie był stroną transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, w wyniku których otrzymywał zabezpieczenie w postaci papierów wartościowych i towarów.

Dane dotyczące zabezpieczeń w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Rodzaj zabezpieczenia	Waluta zabezpieczenia	Kraj siedziby kontrahenta	Typ rozliczenia i rozrachunku	Wartość godziwa otrzymanego zabezpieczenia na dzień bilansowy (w tys. zł)	Depozytariusz (dotyczy otrzymanego zabezpieczenia)	Okres zapadalności zabezpieczeń						
							poniżej 1 dnia	od 1 dnia do 1 tygodnia	od 1 tygodnia do 1 miesiąca	od 1 do 3 miesięcy	od 3 miesięcy do 1 roku	powyżej 1 roku	nieokreślony termin
reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
buy-sell-back	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	-	X	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

*dotyczy otrzymanych zabezpieczeń

100% zabezpieczeń udzielonych przez Subfundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

- Subfundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.
- W okresie sprawozdawczym Subfundusz nie zawierał transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego, które wymagały od kontrahentów złożenia zabezpieczenia gotówkowego.

Dane dotyczące wyniku z transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz swapów przychodu całkowitego:

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
reverse repo	-	-
repo	-	-
buy-sell back ¹	-	-
sell-buy back ²	-	1 068
udzielenie pożyczki papierów wartościowych ³	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

¹ przychody zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą skorygowanej ceny nabycia, oszacowanej przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

² koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Subfundusz, tj. metodą korekty różnicy pomiędzy ceną odkupu a ceną sprzedaży, przy zastosowaniu efektywnej stopy procentowej.

³ przychody zostały wykazane jako wynagrodzenie płacone przez pożyczkobiorcę, natomiast kosztem jest oprocentowanie płacone pożyczkobiorcy od złożonego przez niego zabezpieczenia.