

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 Odpowiedzialnego Rozwoju	12
Subfundusz PZU Aktywny Globalny	16
Subfundusz PZU Obligacji Odpowiedzialnego Rozwoju	20
Subfundusz PZU Dłużny Rynków Wschodzących	24
Subfundusz PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych	28
Subfundusz PZU Medyczny	32
Subfundusz PZU Obligacji Krótkoterminowych	34
Subfundusz PZU Papierów Dłużnych POLONEZ	38
Subfundusz PZU SEJF+	42
Subfundusz PZU Stabilnego Wzrostu MAZUREK	46
Subfundusz PZU Zrównoważony	50

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)
buy-sell-back, reverse repo*	1	-
sell-buy-back, repo**	-	-
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 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
buy-sell-back, reverse repo	32 556	1,89%	nie dotyczy	X	X	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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)	
buy-sell-back, reverse repo	IPOPEMA Securities S.A.	32 556
sell-buy-back, repo	-	-
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	32 559

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
buy-sell-back, reverse repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	32 559	Deutsche Bank Polska S.A.	x	x	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	1 015	-
sell-buy-back, repo**	-	6
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)
buy-sell-back, reverse repo*	16	-
sell-buy-back, repo**	-	-
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

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)
buy-sell-back, reverse repo*	222	-
sell-buy-back, repo**	-	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 Akcji Odpowiedzialnego Rozwoju

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
buy-sell-back, reverse repo	2 010	3,52%	nie dotyczy	X	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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)	
buy-sell-back, reverse repo	IPOPEMA Securities S.A.	2 010
sell-buy-back, repo	-	-
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	2 009

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
buy-sell-back, reverse repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	2 009	Deutsche Bank Polska S.A.	x	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	23	-
sell-buy-back, repo**	-	-
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	99 384	39,53%	nie dotyczy	x	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)	
buy-sell-back, reverse repo	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	99 384
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	X	X	-	-	-	-	-
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)
buy-sell-back, reverse repo*	-	-
sell-buy-back, repo**	-	1 821
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 Obligacji Odpowiedzialnego Rozwoju

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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	5 940	14,22%	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 Fundusz 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)	
buy-sell-back, reverse repo	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	5 940
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	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)
buy-sell-back, reverse repo*	-	-
sell-buy-back, repo**	-	86
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	6 867	3,88%	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)	
buy-sell-back, reverse repo	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	6867
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	119	-
sell-buy-back, repo**	-	16
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	99 182	31,97%	nie dotyczy	x	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)			
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	81 367	mBank S.A.	17 815
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	-	-
sell-buy-back, repo**	-	1 474
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:

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)
buy-sell-back, reverse repo*	12	-
sell-buy-back, repo**	-	-
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 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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	887 319	22,94%	nie dotyczy	x	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)					
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	J.P. Morgan AG	199 272	Societe Generale SA Od. W Polsce	198 035	IPOPEMA Securities S.A.	197 746
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska, Niemcy	dwustronne	-	-	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	77	-
sell-buy-back, repo**	-	20 321
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
buy-sell-back, reverse repo	29 752	0,64%	nie dotyczy	-	x	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	1 636 040	34,99%	nie dotyczy	x	x	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)					
buy-sell-back, reverse repo	IPOPEMA Securities S.A.	29 752	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	J.P. Morgan AG	537 261	Societe Generale SA Od. W Polsce	436 311	IPOPEMA Securities S.A.	345 433
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	29 735

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
buy-sell-back, reverse repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	29 735	Deutsche Bank Polska S.A.	-	X	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska, Niemcy	dwustronne	-	-	X	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	68	-
sell-buy-back, repo**	-	26 888
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	430 144	16,23%	nie dotyczy	x	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)					
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	311 762	Bank Millennium S.A.	88 100	Santander Bank Polska S.A.	30 282
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	51	-
sell-buy-back, repo**	-	7 619
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	1 229 264	31,72%	nie dotyczy	x	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)					
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	488 435	mBank S.A.	310 698	Societe Generale SA Od. W Polsce	231 085
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska, Niemcy	dwustronne	-	-	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	7	-
sell-buy-back, repo**	-	22 775
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	97 865	29,48%	nie dotyczy	x	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)			
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	IPOPEMA Securities S.A.	86 746	Santander Bank Polska S.A.	11 119
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
buy-sell-back, reverse repo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
sell-buy-back, repo	dłużne papiery wartościowe	PLN	Polska	dwustronne	-	-	X	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 papierów wartościowych	Przychody (w tys. zł)	Koszty (w tys. zł)
buy-sell-back, reverse repo*	-	-
sell-buy-back, repo**	-	1 954
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.