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") (poniższe informacje nie podlegały badaniu przez biegłego rewidenta).

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	480	5,44%	nie dotyczy	x	-	-	-	-	-	-
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

** dotyczy udzielonych przez Fundusz 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 Fundusz 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.	480
udzielenie pożyczki papierów wartościowych	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

Najwięksi wystawcy zabezpieczeń otrzymywanych przez Fundusz 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 zabezpie-czenia	Waluta zabezpie-czenia	Kraj siedziby kontra-henta	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	nieokre-ślony 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 Fundusz przechowywanych jest na rachunkach wskazanych umownie przez kontrahenta, zgodnie z tzw. Standard Settlement Instruction każdego z kontrahentów.

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

1. Fundusz nie ujawnia określonej maksymalnej kwoty zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w Prospekcie Informacyjnym ani w innych informacjach prezentowanych Inwestorom.

2. W okresie sprawozdawczym Fundusz 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**	-	13
udzielenie pożyczki papierów wartościowych***	-	-
zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych	-	-
z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego	-	-

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

*** koszty zostały wykazane zgodnie z metodą wyceny stosowaną przez Fundusz, 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.*