

**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 Obligacji Krótkoterminowych.....         | 2  |
| Subfundusz PZU Papierów Dłużnych POLONEZ .....          | 6  |
| Subfundusz PZU SEJF+ .....                              | 10 |
| Subfundusz PZU Stabilnego Wzrostu MAZUREK.....          | 14 |
| Subfundusz PZU Zrównoważony .....                       | 18 |
| Subfundusz PZU Globalny Akcji Medycznych .....          | 22 |
| Subfundusz PZU Akcji KRAKOWIAK .....                    | 24 |
| Subfundusz PZU Akcji Małych i Średnich Spółek .....     | 28 |
| Subfundusz PZU Aktywny Globalny .....                   | 32 |
| Subfundusz PZU Globalny Obligacji Korporacyjnych .....  | 36 |
| Subfundusz PZU Obligacji Odpowiedzialnego Rozwoju ..... | 40 |
| Subfundusz PZU Akcji Polskich.....                      | 44 |
| Subfundusz PZU Akcji Odpowiedzialnego Rozwoju .....     | 48 |
| Subfundusz PZU Dłużny Korporacyjny .....                | 50 |
| Subfundusz PZU Dłużny Rynków Wschodzących.....          | 54 |

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                                              | 2 390 522                              | 32,47%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |           |                        |         |                             |         |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|------------------------|---------|-----------------------------|---------|
|                                                                  |                                                                                          |           |                        |         |                             |         |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -         | -                      | -       | -                           | -       |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 1 263 714 | Erste Bank Polska S.A. | 346 085 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 309 551 |
| 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                       | 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*                                     | 39                    | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 37 902             |
| 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                                      | -                                      | -                                   | -                                                                                      | -                             | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                  |
| sell-buy-back, repo                                              | 3 823 667                              | 44,80%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |           |                             |           |            |         |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------------|-----------|------------|---------|
|                                                                  |                                                                                          |           |                             |           |            |         |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -         | -                           | -         | -          | -       |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 1 793 472 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 1 270 771 | mBank S.A. | 362 550 |
| 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                       | 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*                                     | 108                   | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 64 125             |
| 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                                              | 2 686 350                              | 34,14%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |           |                             |         |                              |         |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------------|---------|------------------------------|---------|
|                                                                  |                                                                                          |           |                             |         |                              |         |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -         | -                           | -       | -                            | -       |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 1 705 696 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 431 098 | Bank Polska Kasa Opieki S.A. | 263 077 |
| 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                       | 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*                                     | 25 139                | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 43 453             |
| 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                                              | 2 374 432                              | 39,43%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |           |                             |         |            |         |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------------|---------|------------|---------|
|                                                                  |                                                                                          |           |                             |         |            |         |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -         | -                           | -       | -          | -       |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 1 031 462 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 674 216 | mBank S.A. | 220 786 |
| 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                       | 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*                                     | 19                    | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 38 389             |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych***                    | 104                   | 85                 |
| 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                                              | 143 915                                | 28,68%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |         |            |        |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|---------|------------|--------|
|                                                                  |                                                                                          |         |            |        |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -       | -          | -      |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 129 602 | mBank S.A. | 14 313 |
| 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*                    | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 6                     | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 2 861              |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych***                    | 3                     | 5                  |
| 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 Akcji Medycznych**

### **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*                                     | 17                    | -                  |
| 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                                      | 89 801                                 | 3,88%                               | 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/<br>Wartość transakcji<br>aktywnych na dzień<br>bilansowy (w tys. zł) |        |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
|                                                                  |                                                                                                |        |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | IPOPEMA<br>Securities S.A.                                                                     | 89 801 |
| sell-buy-back, repo                                              | -                                                                                              | -      |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych                       | -                                                                                              | -      |
| zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych                     | -                                                                                              | -      |
| z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia<br>kredytowego         | -                                                                                              | -      |

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

| Najwięksi wystawcy zabezpieczeń<br>/ Wartość papierów wartościowych i towarów otrzymanych<br>jako zabezpieczenie na dzień bilansowy (w tys. zł) |        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|
| Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej                                                                                                         | 12 687 |
| Bank Gospodarstwa Krajowego                                                                                                                     | 77 095 |

**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                    | 89 782                                                                    | Bank Polska Kasa Opieki S.A.                       | x                               | x                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| sell-buy-back, repo                                              | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 1 640                 | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 4                  |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych***                    | 212                   | 173                |
| 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:

| 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                                      | 5 054                                  | 2,54%                               | 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 /<br>Wartość transakcji<br>aktywnych na dzień<br>bilansowy (w tys. zł) |       |
|------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
| buy-sell-back, reverse repo                                      | IPOPEMA<br>Securities S.A.                                                                      | 5 054 |
| sell-buy-back, repo                                              | -                                                                                               | -     |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych                       | -                                                                                               | -     |
| zaciągnięcie pożyczki papierów wartościowych                     | -                                                                                               | -     |
| z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia<br>kredytowego         | -                                                                                               | -     |

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

| Najwięksi wystawcy zabezpieczeń<br>/ Wartość papierów wartościowych i towarów otrzymanych<br>jako zabezpieczenie na dzień bilansowy (w tys. zł) |       |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|
| Skarb Państwa Rzeczypospolitej Polskiej                                                                                                         | 5 053 |

**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                    | 5 053                                                                     | Bank Polska Kasa Opieki S.A..                      | x                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| sell-buy-back, repo                                              | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 105                   | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 0                  |
| 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                                              | 70 949                                 | 20,07%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |        |                        |        |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------|--------|
|                                                                  |                                                                                          |        |                        |        |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -      | -                      | -      |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 55 697 | Erste Bank Polska S.A. | 15 252 |
| 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*                    | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 5                     | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 2 091              |
| 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                                              | 501 788                                | 44,72%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |         |                             |         |            |       |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|---------|-----------------------------|---------|------------|-------|
|                                                                  |                                                                                          |         |                             |         |            |       |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -       | -                           | -       | -          | -     |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 298 492 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 197 240 | mBank S.A. | 6 056 |
| 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*                    | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 2                     | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 9 053              |
| 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                                              | 23 517                                 | 45,93%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |        |                              |     |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|--------|------------------------------|-----|
|                                                                  |                                                                                          |        |                              |     |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -      | -                            | -   |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 22 618 | Bank Polska Kasa Opieki S.A. | 899 |
| 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                       | 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**                                            | -                     | 437                |
| 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:

| 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                                      | 68 190                                 | 16,48%                              | nie dotyczy                                                                            | x                             | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                  |
| sell-buy-back, repo                                              | -                                      | -                                   | -                                                                                      | -                             | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                  |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych                       | 2 494                                  | 0,60%                               | 3,47%                                                                                  | -                             | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | x                  |
| 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.                                                                | 68 190 |
| sell-buy-back, repo                                              | -                                                                                      | -      |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych                       | ERSTE Securities Polska S.A. (DM)                                                      | 2 494  |
| 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                                                                                                  | 68 203 |

**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                    | 68 203                                                                    | Bank Polska Kasa Opieki S.A..                      | x                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| sell-buy-back, repo                                              | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych                       | środki pieniężne           | PLN                   | Polska                    | dwustronne                    | 2 722                                                                     | Bank Polska Kasa Opieki S.A..                      | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | x                   |
| 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.
- Środki pieniężne otrzymane przez Subfundusz w ramach zabezpieczenia transakcji finansowych z użyciem papierów wartościowych są lokowane w taki sam sposób, jak pozostałe aktywa Subfunduszu, zgodnie z polityką inwestycyjną opisaną w Prospekcie Informacyjnym. Uzyskane z tytułu reinwestycji środków pieniężnych przychody i poniesione koszty są wykazane w sprawozdaniu jednostkowym Subfunduszu w tabeli „Rachunek Wyniku z Operacji Subfunduszu”.

**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*                                     | 861                   | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 1                  |
| udzielenie pożyczki papierów wartościowych***                    | 50                    | 51                 |
| 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:**

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*                                     | 147                   | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 0                  |
| 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 Korporacyjny

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                                              | 285 134                                | 35,42%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |         |                             |        |            |        |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|---------|-----------------------------|--------|------------|--------|
|                                                                  |                                                                                          |         |                             |        |            |        |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -       | -                           | -      | -          | -      |
| sell-buy-back, repo                                              | IPOPEMA Securities S.A.                                                                  | 136 741 | Bank Gospodarstwa Krajowego | 98 620 | mBank S.A. | 49 773 |
| 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*                    | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 6                     | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 8 143              |
| 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                                              | 330 747                                | 43,41%                              | 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/<br>Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy (w tys. zł) |         |                         |        |                        |        |
|------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|---------|-------------------------|--------|------------------------|--------|
|                                                                  |                                                                                          |         |                         |        |                        |        |
| buy-sell-back, reverse repo                                      | -                                                                                        | -       | -                       | -      | -                      | -      |
| sell-buy-back, repo                                              | mBank S.A.                                                                               | 207 674 | IPOPEMA Securities S.A. | 98 414 | Erste Bank Polska S.A. | 24 659 |
| 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*                    | -                          | -                     | -                         | -                             | -                                                                         | -                                                  | -                               | -                       | -                           | -                  | -                       | -              | -                   |
| 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*                                     | 2                     | -                  |
| sell-buy-back, repo**                                            | -                     | 3 850              |
| 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.