Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

Informacje przekazywane na podstawie Artykułu 13 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.

Poniższe informacje nie wchodzą w zakres badania przez biegłego rewidenta.

Credit Agricole Akcyjny

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Akcyjny Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż (buy-sell back) i transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno (sell-buy back) stanowiących transakcje z użyciem papierów wartościowych (dalej: „Transakcje") w rozumieniu Artykułu 3 ust. 11 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 (dalej: „Rozporządzenie").

„Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż" (buy-sell back) lub „transakcja zwrotna sprzedaż-kupno" (sell-buy back) oznacza transakcję, w której kontrahent kupuje lub sprzedaje papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa do papierów wartościowych lub towarów, zgadzając się, odpowiednio, na sprzedaż lub odkup papierów wartościowych, towarów lub takich gwarantowanych praw tego samego rodzaju w określonej cenie i przyszłym terminie; dla kontrahenta kupującego papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa transakcja taka stanowi transakcję zwrotną kupno-sprzedaż, natomiast dla kontrahenta sprzedającego takie papiery, towary lub prawa stanowi ona transakcję zwrotną sprzedaż-kupno, przy czym taka transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub sprzedaż-kupno nie jest regulowana umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu ani umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o której mowa w przypadku transakcji odkupu, o której mowa w Artykule 3 pkt 9 Rozporządzenia.

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty nie dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Akcyjny Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym innych rodzajów Transakcji wskazanych w Artykule 3 ust. 11 Rozporządzenia tj. transakcji odkupu, transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego oraz nie udzielał i nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych lub towarów.

Fundusz nie stosuje transakcji typu swap przychodu całkowitego w rozumieniu Artykułu 3 ust. 18 Rozporządzenia.

1) Dane ogólne

a) kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania

31.12.2023

Nie dotyczy.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

2) Dane dotyczące koncentracji

a) 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)

31.12.2023

Nie dotyczy.

3) Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego – w podziale na poniższe kategorie

a) rodzaj i jakość zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były następujące dłużne papiery wartościowe emitowane lub gwarantowane przez Skarb Państwa:

- instrumenty finansowe otrzymane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back)

DS0432 (PL0000113783)
DS0727 (PL0000109427)
DS1033 (PL0000115291)
PS0527 (PL0000114393)
PS0728 (PL0000115192)
PS1024 (PL0000111720)
WZ0126 (PL0000108817)
WZ0525 (PL0000111738)
WZ1126 (PL0000113130)
WZ1127 (PL0000114559)
WZ1128 (PL0000115697)
WZ1129 (PL0000111928)
WZ1131 (PL0000113213)

- instrumenty finansowe przekazane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back)

WZ0528 (PL0000110383)

WZ1128 (PL0000115697)

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

W przypadku dłużnych papierów wartościowych emitowanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa praktycznie nie występuje ryzyko płynności polegające na braku możliwości zbycia większej ilości instrumentów finansowych po cenie nieodbiegającej od rynkowej a polegające na ryzyku niemożliwości wywiązania się przez emitenta ze zobowiązań ryzyko niewypłacalności emitenta jest znikome. W przypadku dłużnych papierów wartościowych występuje ryzyko stropy procentowej, które polega na zmianie cen instrumentów dłużnych o stałym oprocentowaniu w przypadku zmiany rynkowej stopy procentowej. W przypadku wzrostu stóp cena obligacji maleje, w przypadku spadku - rośnie. W przypadku dłużnych papierów wartościowych o zmiennym oprocentowaniu ryzyko to jest bardzo niskie.

b) okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności.

31.12.2023

Nie dotyczy.

c) waluta zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były dłużne papiery wartościowe emitowane w PLN.

d) okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte

31.12.2023

Nie dotyczy.

e) kraj, w którym kontrahenci mają siedziby

Stroną zawieranych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) byli kontrahenci, których krajem siedziby była na dzień podpisania sprawozdania jednostkowego Rzeczpospolita Polska.

f) rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne)

Zawierane przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcje zwrotne kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotne sprzedaż-kupno (sell-buy back) były rozliczane za pośrednictwem KDPW S.A., którego bezpośrednim uczestnikiem jest depozytariusz Funduszu.

4) Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń

a) odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom.

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych

31.12.2023

Nie dotyczy.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

5) Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

31.12.2023

Nie dotyczy.

6) Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach

31.12.2023

Nie dotyczy.

7) Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. „agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego

31-12-2023	Koszty zawarcia transakcji (w tys. zł)	Zysk/strata z tytułu zawarcia transakcji (w tys. zł)	Procentowy udział zysku/straty z tytułu zawarcia transakcji w sumie zysków/strat z tytułu zawarcia wszystkich transakcji zwrotnych (buy-sell back oraz sell-buy
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	19	95,00
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	1	5,00
Suma:	**-**	**20**	**100,00**

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

Informacje przekazywane na podstawie Artykułu 13 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.

Credit Agricole Dłużny Krótkoterminowy

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Dłużny Krótkoterminowy Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż (buy-sell back) i transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno (sell-buy back) stanowiących transakcje z użyciem papierów wartościowych (dalej: „Transakcje") w rozumieniu Artykułu 3 ust. 11 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 (dalej: „Rozporządzenie").

„Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż" (buy-sell back) lub „transakcja zwrotna sprzedaż-kupno" (sell-buy back) oznacza transakcję, w której kontrahent kupuje lub sprzedaje papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa do papierów wartościowych lub towarów, zgadzając się, odpowiednio, na sprzedaż lub odkup papierów wartościowych, towarów lub takich gwarantowanych praw tego samego rodzaju w określonej cenie i przyszłym terminie; dla kontrahenta kupującego papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa transakcja taka stanowi transakcję zwrotną kupno-sprzedaż, natomiast dla kontrahenta sprzedającego takie papiery, towary lub prawa stanowi ona transakcję zwrotną sprzedaż-kupno, przy czym taka transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub sprzedaż-kupno nie jest regulowana umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu ani umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o której mowa w przypadku transakcji odkupu, o której mowa w Artykule 3 pkt 9 Rozporządzenia.

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty nie dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Dłużny Krótkoterminowy Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym innych rodzajów Transakcji wskazanych w Artykule 3 ust. 11 Rozporządzenia tj. transakcji odkupu, transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego oraz nie udzielał i nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych lub towarów.

Fundusz nie stosuje transakcji typu swap przychodu całkowitego w rozumieniu Artykułu 3 ust. 18 Rozporządzenia.

1) Dane ogólne

a) kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania

31.12.2023

Nie dotyczy.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

2) Dane dotyczące koncentracji

a) 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)

31.12.2023

Nie dotyczy.

3) Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego – w podziale na poniższe kategorie

a) rodzaj i jakość zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były następujące dłużne papiery wartościowe emitowane lub gwarantowane przez Skarb Państwa:

- instrumenty finansowe otrzymane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back)

DS1033 (PL0000115291)
PS0527 (PL0000114393)
PS0728 (PL0000115192)
WS0428 (PL0000107611)
WZ1127 (PL0000114559)
WZ1128 (PL0000115697)
WZ1131 (PL0000113213)

- instrumenty finansowe przekazane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back)

PS0728 (PL0000115192)
WZ0528 (PL0000110383)
WZ1126 (PL0000113130)
WZ1127 (PL0000114559)
WZ1128 (PL0000115697)
WZ1129 (PL0000111928)

W przypadku dłużnych papierów wartościowych emitowanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa praktycznie nie występuje ryzyko płynności polegające na braku możliwości zbycia większej ilości instrumentów finansowych po cenie nieodbiegającej od rynkowej a polegające na ryzyku niemożliwości wywiązania się przez emitenta ze zobowiązań ryzyko niewypłacalności emitenta jest znikome.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

W przypadku dłużnych papierów wartościowych występuje ryzyko stropy procentowej, które polega na zmianie cen instrumentów dłużnych o stałym oprocentowaniu w przypadku zmiany rynkowej stopy procentowej. W przypadku wzrostu stóp cena obligacji maleje, w przypadku spadku - rośnie. W przypadku dłużnych papierów wartościowych o zmiennym oprocentowaniu ryzyko to jest bardzo niskie.

b) okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności.

31.12.2023

Nie dotyczy.

c) waluta zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były dłużne papiery wartościowe emitowane w PLN.

d) okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte

31.12.2023

Nie dotyczy.

e) kraj, w którym kontrahenci mają siedziby

Stroną zawieranych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) byli kontrahenci, których krajem siedziby była na dzień podpisania sprawozdania jednostkowego Rzeczpospolita Polska.

f) rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne)

Zawierane przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcje zwrotne kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotne sprzedaż-kupno (sell-buy back) były rozliczane za pośrednictwem KDPW S.A., którego bezpośrednim uczestnikiem jest depozytariusz Funduszu.

4) Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń

a) odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom.

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych

31.12.2023

Nie dotyczy.

5) Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

31.12.2023

Nie dotyczy.

6) Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach

31.12.2023

Nie dotyczy.

7) Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. „agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego

31-12-2023	Koszty zawarcia transakcji (w tys. zł)	Zysk/strata z tytułu zawarcia transakcji (w tys. zł)	Procentowy udział zysku/straty z tytułu zawarcia transakcji w sumie zysków/strat z tytułu zawarcia wszystkich transakcji zwrotnych (buy-sell back oraz sell-buy
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	6	9,09
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	60	90,91
Suma:	**-**	**66**	**100,00**

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

Informacje przekazywane na podstawie Artykułu 13 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.

Credit Agricole Dynamiczny Polski

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Dynamiczny Polski Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż (buy-sell back) i transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno (sell-buy back) stanowiących transakcje z użyciem papierów wartościowych (dalej: „Transakcje") w rozumieniu Artykułu 3 ust. 11 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 (dalej: „Rozporządzenie").

„Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż" (buy-sell back) lub „transakcja zwrotna sprzedaż-kupno" (sell-buy back) oznacza transakcję, w której kontrahent kupuje lub sprzedaje papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa do papierów wartościowych lub towarów, zgadzając się, odpowiednio, na sprzedaż lub odkup papierów wartościowych, towarów lub takich gwarantowanych praw tego samego rodzaju w określonej cenie i przyszłym terminie; dla kontrahenta kupującego papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa transakcja taka stanowi transakcję zwrotną kupno-sprzedaż, natomiast dla kontrahenta sprzedającego takie papiery, towary lub prawa stanowi ona transakcję zwrotną sprzedaż-kupno, przy czym taka transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub sprzedaż-kupno nie jest regulowana umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu ani umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o której mowa w przypadku transakcji odkupu, o której mowa w Artykule 3 pkt 9 Rozporządzenia.

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty nie dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Dynamiczny Polski Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym innych rodzajów Transakcji wskazanych w Artykule 3 ust. 11 Rozporządzenia tj. transakcji odkupu, transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego oraz nie udzielał i nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych lub towarów.

Fundusz nie stosuje transakcji typu swap przychodu całkowitego w rozumieniu Artykułu 3 ust. 18 Rozporządzenia.

1) Dane ogólne

a) kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania

31.12.2023

Nie dotyczy.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

2) Dane dotyczące koncentracji

a) 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)

31.12.2023

Nie dotyczy.

3) Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego – w podziale na poniższe kategorie

a) rodzaj i jakość zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były następujące dłużne papiery wartościowe emitowane lub gwarantowane przez Skarb Państwa:

- instrumenty finansowe otrzymane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back)

DS0432 (PL0000113783)
PS0527 (PL0000114393)
WZ1126 (PL0000113130)
WZ1127 (PL0000114559)
WZ1128 (PL0000115697)
WZ1129 (PL0000111928)

- instrumenty finansowe przekazane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back)

BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO S.A. OBLIGACJE SERII FPC0630 06/05/2030 (PL0000500278)
DS0432 (PL0000113783)
DS1029 (PL0000111498)
DS1033 (PL0000115291)
PS0728 (PL0000115192)

W przypadku dłużnych papierów wartościowych emitowanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa praktycznie nie występuje ryzyko płynności polegające na braku możliwości zbycia większej ilości instrumentów finansowych po cenie nieodbiegającej od rynkowej a polegające na ryzyku niemożliwości wywiązania się przez emitenta ze zobowiązań ryzyko niewypłacalności emitenta jest znikome. W przypadku dłużnych papierów wartościowych występuje ryzyko stropy procentowej, które polega na zmianie cen instrumentów dłużnych o stałym oprocentowaniu w przypadku zmiany rynkowej stopy

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

procentowej. W przypadku wzrostu stóp cena obligacji maleje, w przypadku spadku - rośnie. W przypadku dłużnych papierów wartościowych o zmiennym oprocentowaniu ryzyko to jest bardzo niskie.

b) okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności.

31.12.2023

Nie dotyczy.

c) waluta zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były dłużne papiery wartościowe emitowane w PLN.

d) okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte

31.12.2023

Nie dotyczy.

e) kraj, w którym kontrahenci mają siedziby

Stroną zawieranych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) byli kontrahenci, których krajem siedziby była na dzień podpisania sprawozdania jednostkowego Rzeczpospolita Polska.

f) rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne)

Zawierane przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcje zwrotne kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotne sprzedaż-kupno (sell-buy back) były rozliczane za pośrednictwem KDPW S.A., którego bezpośrednim uczestnikiem jest depozytariusz Funduszu.

4) Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń

a) odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom.

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych

31.12.2023

Nie dotyczy.

5) Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

31.12.2023

Nie dotyczy.

6) Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach

31.12.2023

Nie dotyczy.

7) Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. „agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego

31-12-2023	Koszty zawarcia transakcji (w tys. zł)	Zysk/strata z tytułu zawarcia transakcji (w tys. zł)	Procentowy udział zysku/straty z tytułu zawarcia transakcji w sumie zysków/strat z tytułu zawarcia wszystkich transakcji zwrotnych (buy-sell back oraz sell-buy
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	7	3,65
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	185	96,35
Suma:	**-**	**192**	**100,00**

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

Informacje przekazywane na podstawie Artykułu 13 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.

Credit Agricole Stabilnego Wzrostu

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Stabilnego Wzrostu Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż (buy-sell back) i transakcji zwrotnych sprzedaż-kupno (sell-buy back) stanowiących transakcje z użyciem papierów wartościowych (dalej: „Transakcje") w rozumieniu Artykułu 3 ust. 11 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 (dalej: „Rozporządzenie").

„Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż" (buy-sell back) lub „transakcja zwrotna sprzedaż-kupno" (sell-buy back) oznacza transakcję, w której kontrahent kupuje lub sprzedaje papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa do papierów wartościowych lub towarów, zgadzając się, odpowiednio, na sprzedaż lub odkup papierów wartościowych, towarów lub takich gwarantowanych praw tego samego rodzaju w określonej cenie i przyszłym terminie; dla kontrahenta kupującego papiery wartościowe, towary lub gwarantowane prawa transakcja taka stanowi transakcję zwrotną kupno-sprzedaż, natomiast dla kontrahenta sprzedającego takie papiery, towary lub prawa stanowi ona transakcję zwrotną sprzedaż-kupno, przy czym taka transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub sprzedaż-kupno nie jest regulowana umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu ani umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o której mowa w przypadku transakcji odkupu, o której mowa w Artykule 3 pkt 9 Rozporządzenia.

W okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty nie dokonywał w imieniu i na rachunek Credit Agricole Stabilnego Wzrostu Subfunduszu w Credit Agricole Funduszu Inwestycyjnym Otwartym innych rodzajów Transakcji wskazanych w Artykule 3 ust. 11 Rozporządzenia tj. transakcji odkupu, transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego oraz nie udzielał i nie zaciągał pożyczek papierów wartościowych lub towarów.

Fundusz nie stosuje transakcji typu swap przychodu całkowitego w rozumieniu Artykułu 3 ust. 18 Rozporządzenia.

1) Dane ogólne

a) kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki, definiowanych jako takie aktywa z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych wyrażona jako kwota bezwzględna (w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania) i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania

	Wartość na dzień 31-12-2023 (w tys. zł)	Procentowy udział w aktywach ogółem
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	1 600	0,55
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	-
Suma:	**1 600**	**0,55**

2) Dane dotyczące koncentracji

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

a) 10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)

Nazwa kontrahenta	Rodzaj transakcji	Nazwa instrumentu finansowego stanowiącego zabezpieczenie	Wartość nominalna instrumentu finansowego stanowiącego zabezpieczenie na dzień 31-12-2023 (w tys. zł)
IPOPEMA SECURITIES S.A.	Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	DS1033 (PL0000115291)	1 490
Suma:			**1 490**

b) 10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)

Nazwa kontrahenta	Rodzaj transakcji	Wartość brutto transakcji na dzień 31-12-2023 (w tys. zł)
IPOPEMA SECURITIES S.A.	Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	1 600
Suma:		**1 600**

3) Zbiorcze dane dotyczące transakcji odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego – w podziale na poniższe kategorie

a) rodzaj i jakość zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były następujące dłużne papiery wartościowe emitowane lub gwarantowane przez Skarb Państwa:

- instrumenty finansowe otrzymane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back)

DS0432 (PL0000113783)
DS0725 (PL0000108197)
DS0727 (PL0000109427)
DS1033 (PL0000115291)
PS0527 (PL0000114393)
PS0728 (PL0000115192)
WZ0126 (PL0000108817)
WZ0524 (PL0000110615)
WZ0525 (PL0000111738)
WZ1126 (PL0000113130)
WZ1127 (PL0000114559)
WZ1128 (PL0000115697)
WZ1131 (PL0000113213)

- instrumenty finansowe przekazane przez Subfundusz w wyniku transakcji zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back)

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO S.A. OBLIGACJE SERII FPC0630 06/05/2030 (PL0000500278)

DS0432 (PL0000113783)

DS1033 (PL0000115291)

PS0728 (PL0000115192)

WZ0528 (PL0000110383)

W przypadku dłużnych papierów wartościowych emitowanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa praktycznie nie występuje ryzyko płynności polegające na braku możliwości zbycia większej ilości instrumentów finansowych po cenie nieodbiegającej od rynkowej a polegające na ryzyku niemożliwości wywiązania się przez emitenta ze zobowiązań ryzyko niewypłacalności emitenta jest znikome. W przypadku dłużnych papierów wartościowych występuje ryzyko stropy procentowej, które polega na zmianie cen instrumentów dłużnych o stałym oprocentowaniu w przypadku zmiany rynkowej stopy procentowej. W przypadku wzrostu stóp cena obligacji maleje, w przypadku spadku - rośnie. W przypadku dłużnych papierów wartościowych o zmiennym oprocentowaniu ryzyko to jest bardzo niskie.

b) okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, nieokreślony termin zapadalności.

31.12.2023

Nie dotyczy.

c) waluta zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku w ramach dokonywanych transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) były dłużne papiery wartościowe emitowane w PLN.

d) okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych w podziale według następujących klas zapadalności: poniżej jednego dnia, od jednego dnia do jednego tygodnia, od jednego tygodnia do jednego miesiąca, od jednego do trzech miesięcy, od trzech miesięcy do jednego roku, powyżej jednego roku, transakcje otwarte

31-12-2023 (w tys. zł)	Do 1 dnia	Od 1 dnia do 1 tygodnia	Od 1 tygodnia do 1 miesiąca	Od 1 miesiąca do 3 miesięcy	Od 3 miesięcy do 1 roku	Powyżej 1 roku	Nieokreślony termin	Suma
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	1 600	-	-	-	-	-	1 600
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	-	-	-	-	-	-	-

e) kraj, w którym kontrahenci mają siedziby

Stroną zawieranych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotnej sprzedaż-kupno (sell-buy back) byli kontrahenci, których krajem siedziby była na dzień podpisania sprawozdania jednostkowego Rzeczpospolita Polska.

f) rozliczenie i rozrachunek (np. trójstronne, kontrahent centralny, dwustronne)

Zawierane przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2023 roku do dnia 31 grudnia 2023 roku transakcje zwrotne kupno-sprzedaż (buy-sell back) oraz zwrotne sprzedaż-kupno (sell-buy back) były rozliczane za pośrednictwem KDPW S.A., którego bezpośrednim uczestnikiem jest depozytariusz Funduszu.

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).

4) Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń

a) odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom.

31.12.2023

Nie dotyczy.

b) zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych

31.12.2023

Nie dotyczy.

5) Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.

31.12.2023

Nie dotyczy.

6) Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i w ramach swapów przychodu całkowitego

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych albo na wspólnych rachunkach lub na wszelkich innych rachunkach

31.12.2023

Nie dotyczy.

7) Dane dotyczące rentowności i kosztów dla każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego w podziale na przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania, zarządzającego przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania i strony trzecie (np. tzw. „agent lenders"), w wartościach bezwzględnych i jako odsetek łącznych zysków z danego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ze swapów przychodu całkowitego

31-12-2023	Koszty zawarcia transakcji (w tys. zł)	Zysk/strata z tytułu zawarcia transakcji (w tys. zł)	Procentowy udział zysku/straty z tytułu zawarcia transakcji w sumie zysków/strat z tytułu zawarcia wszystkich transakcji zwrotnych (buy-sell back oraz sell-buy
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	103	16,14
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	535	83,86
Suma:	**-**	**638**	**100,00**

W imieniu Santander Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A.

Marcin Groniewski	**Janusz Korpa**	**Szymon Borawski - Reks**
Prezes Zarządu	Członek Zarządu	Członek Zarządu
Grzegorz Borowski	**Marlena Janota**	
Członek Zarządu	Członek Zarządu	

Data: 8 kwietnia 2024 roku

Santander TFI S.A. z siedzibą w Poznaniu, Nowy Rynek Budynek E, ul. Wierzbięcice 1a, 61-569 Poznań, zarejestrowane w Sądzie Rejonowym Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, Wydział VIII Gospodarczy KRS pod nr. 0000001132, NIP 778 13 14 701, kapitał zakładowy 13.500.000,00 PLN (wpłacony w całości).