

**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.**

W okresie od dnia 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 roku Fundusz Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty dokonywał w imieniu i na rachunek subfunduszu Credit Agricole Dłużny Krótkoterminowy (do dnia 6.09.2018 r. Credit Agricole Lokacyjny) 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 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 roku Fundusz Credit Agricole Fundusz Inwestycyjny Otwarty nie dokonywał w imieniu i na rachunek subfunduszu Credit Agricole Dłużny Krótkoterminowy (do dnia 6.09.2018 r. Credit Agricole Lokacyjny) 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.

**31.12.2018 r.**

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

**31.12.2018 r.**

Nie dotyczy.

## **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)

**31.12.2018 r.**

Nie dotyczy.

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

**31.12.2018 r.**

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 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 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)

obligacja WZ0120 (PL0000108601)

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

obligacja PS0420 (PL0000108510)

obligacja WZ0124 (PL0000107454)

obligacja WZ0126 (PL0000108817)

obligacja WZ0524 (PL0000110615)

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 stopy 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

**31.12.2018 r.**

Nie dotyczy.



Tel. 61 855 73 22  
Fax 61 855 73 21



Infolinia 801 123 801  
61 885 19 19



SantanderTFI.pl  
tfi@santander.pl

c) waluta zabezpieczeń

Przedmiotem zabezpieczeń otrzymywanych i udzielanych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 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

**31.12.2018 r.**

Nie dotyczy.

e) kraj, w którym kontrahenci mają siedziby

Stroną zawieranych przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 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 finansowego Rzeczpospolita Polska.

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

Zawierane przez Subfundusz w okresie od dnia 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 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.

Brak. Otrzymywane w okresie od dnia 1 stycznia 2018 roku do dnia 31 grudnia 2018 roku przez Subfundusz zabezpieczenia nie były przedmiotem ponownego wykorzystania.

b) zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych

Brak

**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.

**31.12.2018 r.**

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

**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**

<b>1.01.2018 r. - 31.12.2018 r.</b>	<b>Koszty zawarcia transakcji (w tys. zł)</b>	<b>Zysk/strata z tytułu zawarcia transakcji (w tys. zł)</b>	<b>Procentowy udział zysku/straty z tytułu zawarcia transakcji w sumie zysków/strat z tytułu zawarcia wszystkich transakcji zwrotnych (buy-sell back oraz sell-buy back)</b>
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż (buy-sell back)	-	0	(0,54)
Transakcja zwrotna sprzedaż-kupno (sell-buy back)	-	(23)	(100,54)
<b>Suma</b>	-	<b>(23)</b>	<b>(100,00)</b>

W imieniu Santander Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A.

Jacek Marcinowski

Grzegorz Borowski

Marlena Janota

Prezes Zarządu

Członek Zarządu

Członek Zarządu

Data: 28 marca 2019 roku



Tel. 61 855 73 22  
Fax 61 855 73 21



Infolinia 801 123 801  
61 885 19 19



SantanderTFI.pl  
tfi@santander.pl