

ipopema

POŁĄCZONE ROCZNE SPRAWOZDANIE FINANSOWE

**POCZTOWY SPECJALISTYCZNY
FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY**

**ZA OKRES OD DNIA 1 STYCZNIA 2019 ROKU
DO DNIA 31 GRUDNIA 2019 ROKU**

WPROWADZENIE DO POŁĄCZONEGO ROCZNEGO SPRAWOZDANIA FINANSOWEGO FUNDUSZU

Nazwa Funduszu

Fundusz POCZTOWY Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty (dalej jako „Fundusz”) został wpisany w dniu 23 czerwca 2016 roku do rejestru funduszy inwestycyjnych pod numerem RFi 1411.

Fundusz jest specjalistycznym funduszem inwestycyjnym otwartym z wydzielonymi subfunduszami, w rozumieniu Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnym z dnia 27 maja 2004 r. (Dz.U. z 2020 r. poz. 95 z późn. zm.) (dalej jako „Ustawa”).

Komisja Nadzoru Finansowego udzieliła zezwolenia na utworzenie Funduszu decyzją z dnia 30 maja 2016 roku. Fundusz POCZTOWY SFIO jest funduszem inwestycyjnym otwartym z wydzielonymi subfunduszami:

- Subfundusz Konserwatywny (do dnia 2 września 2019 roku jako subfundusz Oszczędnościowy),
- Subfundusz Dłużny,
- Subfundusz Stabilny,
- Subfundusz Obligacji,
- Subfundusz Dynamiczny.

Na dzień bilansowy w ramach Funduszu uruchomiono Subfundusz Oszczędnościowy, Subfundusz Stabilny, Subfundusz Obligacji.

Pierwsza wycena Subfunduszy miała miejsce w dniu 1 lipca 2016 r.

Fundusz oraz uruchomione Subfundusze zostały utworzone na czas nieograniczony.

Subfundusze zbywają jednostki uczestnictwa kategorii A, P, S oraz E. Jednostki uczestnictwa poszczególnych kategorii mogą różnić się między sobą:

- a) zasadami zbywania,
- b) wysokością minimalnych wpłat,
- c) wysokością i sposobem pobierania opłat manipulacyjnych.

Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych

Fundusz jest zarządzany przez IPOPEMA Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. z siedzibą w Warszawie przy ulicy Próżnej 9 (wpisane do Rejestru Przedsiębiorców prowadzonego przez Sąd Rejonowy dla m. st. Warszawy w Warszawie XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego pod numerem KRS 0000278264).

Podmiot, który przeprowadził badanie sprawozdania finansowego

Sprawozdanie finansowe zostało poddane badaniu przez BDO spółka z ograniczoną odpowiedzialnością sp. k. z siedzibą w Warszawie przy ul. Postępu 12.

Cel inwestycyjny Funduszu

1. Celem inwestycyjnym każdego z Subfunduszy jest wzrost wartości aktywów Subfunduszu w wyniku wzrostu wartości lokat.
2. Fundusz nie gwarantuje osiągnięcia celu inwestycyjnego Subfunduszy.

Kategorie Specjalizacja Funduszu

Specjalizacja każdego z Subfunduszy została opisana we wprowadzeniach do jednostkowych sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy.

Ograniczenia inwestycyjne

1. Ograniczenia inwestycyjne Subfunduszy zostały opisane we wprowadzeniach do jednostkowych sprawozdań finansowych każdego z Subfunduszy.

2. Fundusz i Subfundusze obowiązują ograniczenia inwestycyjne zawarte w Ustawie i Statucie Funduszu.

Okres sprawozdawczy oraz dzień bilansowy

1. Połączone roczne sprawozdanie finansowe zostało sporządzone na dzień 31 grudnia 2019 roku, za okres od dnia 1 stycznia 2019 roku do dnia 31 grudnia 2019 roku.
2. Ze względu na charakter i istotność pozycji informacje zawarte w połączonym półrocznym sprawozdaniu finansowym wykazane zostały, o ile nie zaznaczono inaczej, w tysiącach złotych.

Kontynuacja działalności

Połączone roczne sprawozdanie finansowe za okres od 1 stycznia 2019 roku do dnia 31 grudnia 2019 roku zostało sporządzone przy założeniu kontynuowania działalności Funduszu oraz Subfunduszy w dającej się przewidzieć przyszłości, tj. przez okres nie krótszy niż 12 miesięcy od dnia bilansowego, czyli od dnia 31 grudnia 2019 roku. Na dzień sporządzenia połączonego rocznego sprawozdania finansowego Funduszu nie istnieją okoliczności wskazujące na zagrożenie kontynuowania działalności przez

Fundusz i Subfundusze oraz nie są spełnione przesłanki rozwiązania Funduszu, określone przepisami o funduszach inwestycyjnych lub w Statucie Funduszu.

Zgodnie z art. 40 ust. 2 Statutu Funduszu w przypadku zaistnienia jednej z dwóch przesłanek:

- a) spadku Wartości Aktywów Netto Subfunduszu poniżej kwoty 10 000 000 zł i utrzymywania się tego stanu przez okres co najmniej trzech kolejnych miesięcy, z zastrzeżeniem jednak, że Fundusz może dokonać likwidacji Subfunduszu nie wcześniej niż po upływie 6 miesięcy od utworzenia danego Subfunduszu,;
 - b) w przypadku, gdy w trzech kolejnych miesiącach kalendarzowych wynagrodzenie otrzymywane przez Towarzystwo za zarządzanie Subfunduszem nie pozwoli na pokrywanie kosztów w wysokości przewyższającej limity określone:
 - dla Subfunduszu Konserwatywny – w art. 51 ust. 3 i 4 Statutu Funduszu,
 - dla Subfunduszu Dłużny – w art. 60 ust. 3 i 4 Statutu Funduszu,
 - dla Subfunduszu Stabilny – w art. 69 ust. 3 i 4 Statutu Funduszu,
 - dla Subfunduszu Obligacji – w art. 78 ust. 3 i 4 Statutu Funduszu,
 - dla Subfunduszu Dynamiczny – w art. 87 ust. 3 i 4 Statutu Funduszu,
- po przekroczeniu których Towarzystwo obowiązane jest do ich poniesienia z własnych środków.

W szczególności na dzień sporządzenia sprawozdania finansowego Towarzystwo nie identyfikuje zagrożenia kontynuowania działalności wskutek panującej pandemii wirusa SARS-COV-2 wywołującego chorobę COVID-19.

I. POŁĄCZONE ZESTAWNIENIE LOKAT

TABELA GŁÓWNA

SKŁADNIKI LOKAT	31-12-2019			31-12-2018		
	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
Akcje	4 090	4 403	1,16%	2 187	2 127	0,68%
Warranty subskrypcyjne	-	-	-	-	-	-
Prawa do akcji	-	-	-	-	-	-
Prawa poboru	-	-	-	-	-	-
Kwity depozytowe	-	-	-	-	-	-
Listy zastawne	18 009	18 033	4,77%	6 000	6 019	1,92%
Dłużne papiery wartościowe	346 832	350 870	92,78%	260 998	265 637	84,86%
Instrumenty pochodne	-	106	0,03%	-	16	0,01%
Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	-	-	-	-	-	-
Jednostki uczestnictwa	-	-	-	-	-	-
Certyfikaty inwestycyjne	-	-	-	-	-	-
Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	-	-	-	-	-	-
Wierzytelności	-	-	-	-	-	-
Weksle	-	-	-	-	-	-
Depozyty	-	-	-	-	-	-
Waluty	-	-	-	-	-	-
Nieruchomości	-	-	-	-	-	-
Statki morskie	-	-	-	-	-	-
Inne	-	-	-	-	-	-
Suma:	368 931	373 412	98,74%	269 185	273 799	87,47%

Niniejsze połączone zestawienie lokat należy analizować łącznie z wprowadzeniem oraz załączonymi jednostkowymi sprawozdaniami finansowymi Subfunduszy, które stanowią integralną część połączonego rocznego sprawozdania finansowego.

II. POŁĄCZONY BILANS

POŁĄCZONY BILANS	31-12-2019	31-12-2018
I. Aktywa	378 183	312 797
1) Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	4 768	14 346
2) Należności	3	13 732
3) Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	-	10 920
4) Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	234 267	142 712
- dłużne papiery wartościowe	229 864	140 585
5) Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	139 145	131 087
- dłużne papiery wartościowe	121 006	125 052
6) Nieruchomości	-	-
7) Pozostałe aktywa	-	-
II. Zobowiązania	30 853	6 466
1) Zobowiązania własne subfunduszy	30 853	6 466
2) Zobowiązania proporcjonalne funduszu/subfunduszu	-	-
III. Aktywa netto (I - II)	347 330	306 331
IV. Kapitał funduszu/subfunduszu	333 616	298 109
1) Kapitał wpłacony	526 448	400 535
2) Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-192 832	-102 426
V. Dochody zatrzymane	11 188	5 569
1) Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	8 426	4 640
2) Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	2 762	929
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	2 526	2 653
VII. Kapitał funduszu/subfunduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	347 330	306 331

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych za wyjątkiem liczby jednostek uczestnictwa i wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa.

Niniejszy bilans należy analizować łącznie z wprowadzeniem, notami objaśniającymi oraz informacją dodatkową, które stanowią integralną część połączonego rocznego sprawozdania finansowego.

III. POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI

POŁĄCZONY RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	01-01-2019 - 31-12-2019	01-01-2018 - 31-12-2018
I. Przychody z lokat	9 659	7 672
Dywidendy i inne udziały w zyskach	124	36
Przychody odsetkowe	9 532	7 611
Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Dodatnie saldo różnic kursowych	-	22
Pozostałe	3	3
II. Koszty funduszu/subfunduszu	5 873	4 395
Wynagrodzenie dla Towarzystwa	4 007	3 057
Wynagrodzenie dla podmiotów prowadzących dystrybucję	-	-
Oplaty dla depozytariusza	143	129
Oplaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów	110	90
Oplaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	1	-
Usługi w zakresie rachunkowości	1 028	761
Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu/subfunduszu	-	-
Usługi prawne	1	-
Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	5	-
Koszty odsetkowe	525	324
Koszty związane z posiadaniem nieruchomości	-	-
Ujemne saldo różnic kursowych	44	21
Pozostałe	9	13
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	-	-
IV. Koszty funduszu/subfunduszu netto (II-III)	5 873	4 395
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	3 786	3 277
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	1 706	1 831
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym:	1 833	271
- z tytułu różnic kursowych	192	-124
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	-127	1 560
- z tytułu różnic kursowych	-72	-22
VII. Wynik z operacji (V+-VI)	5 492	5 108

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych za wyjątkiem wyniku z operacji przypadającego na jednostkę uczestnictwa.

Niniejszy rachunek wyniku z operacji należy analizować łącznie z wprowadzeniem, notami objaśniającymi oraz informacją dodatkową, które stanowią integralną część połączonego rocznego sprawozdania finansowego.

IV. POŁĄCZONE ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO

POŁĄCZONE ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	01-01-2019 - 31-12-2019	01-01-2018 - 31-12-2018
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	306 331	182 792
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy	5 492	5 108
a) przychody z lokat netto	3 786	3 277
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	1 833	271
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	-127	1 560
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	5 492	5 108
4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu/subfunduszu (razem):		
a) z przychodów z lokat netto	-	-
b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat	-	-
c) z przychodów ze zbycia lokat	-	-
5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem)	35 507	118 431
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału)	125 913	186 867
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału)	-90 406	-68 436
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym (3-4+-5)	40 999	123 539
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	347 330	306 331
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	329 611	256 101

Wszystkie dane prezentowane są w tysiącach złotych za wyjątkiem liczby jednostek uczestnictwa i wartości aktywów netto na jednostkę uczestnictwa.

Niniejsze zestawienie zmian należy analizować łącznie z wprowadzeniem, notami objaśniającymi oraz informacją dodatkową, które stanowią integralną część połączonego rocznego sprawozdania finansowego.



POCZTOWY SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

Podpis osoby sporządzającej sprawozdanie:

Katarzyna Kosior
*Dyrektor Departamentu Sprawozdawczości i Kontroli Wewnętrznej
ProService Finteco Sp. z o.o.*

Podpisy osób reprezentujących Fundusz:

Jarosław Wikaliński
Prezes Zarządu Ipopema TFI S.A.

Katarzyna Westfeld
Członek Zarządu Ipopema TFI S.A.

Marcin Winnicki
Członek Zarządu Ipopema TFI S.A.

Podpisy osoby odpowiedzialnej za prowadzenie ksiąg rachunkowych:

Marcin Ostrowski
*Dyrektor Departament Administracji i Wyceny Aktywów
ProService Finteco Sp. z o.o.*

Warszawa, dnia 21 kwietnia 2020 roku

SUBFUNDUSZ KONSERWATYWNY

Zgodnie z art. 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 (Dz. Urz. UE 23.12.2015 L 337/1), na dzień bilansowy spółka zarządzająca AFI prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Subfunduszu

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN)

Dane na dzień 2019-12-31

Dane ogólne:

Kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki (z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów)	-
Kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego (wyrażona jako kwota bezwzględna w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania):	
Kwota bezwzględna w PLN	27 615
Odsetek zarządzanych aktywów	8,96%

Dane dotyczące koncentracji:

10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)	
SKARB PAŃSTWA RZECZYPOSPOLITEJ POLSKIEJ	-
10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)	
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	-
Transakcje zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcje zwrotna sprzedaż-kupno	27 615
ALIOR BANK S.A.	27 615
MBANK S.A.	-
BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	-
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	-
SANTANDER BANK POLSKA S.A.	-

Zbiorcze dane dotyczące transakcji:

Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	-
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	-
Waluta zabezpieczeń	-
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	-
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	-
Rozliczenie i rozrachunek	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	27 615
Obligacje skarbowe	27 615
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	27 615
powyżej jednego roku	27 615
Waluta zabezpieczeń	27 615
PLN	27 615

Zbiornicze dane dotyczĄce transakcji:

Okres zapadalnoŹci w odniesieniu do transakcji finansowanych z uŹyciem papierów wartoŹciowych i do swapów przychodu caÅkowitego w podziale wedÅug następujĄcych klas zapadalnoŹci	27 615
powyŹej jednego roku	-
od jednego dnia do jednego tygodnia	27 615
Kraj, w ktrym kontrahenci majĄ siedziby	27 615
POLSKA	27 615
Rozliczenie i rozrachunek	27 615
dwustronne	27 615

Dane dotyczĄce ponownego wykorzystania zabezpieczeÅ:

Odsetek otrzymanych zabezpieczeÅ, ktre sĄ przedmiotem ponownego wykorzystania, w porwnaniu z maksymalnĄ kwotĄ okreŹlonĄ w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom	-
Zyski przedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania z tytuÅu reinwestowanych zabezpieczeÅ gotwkowych	-

Przechowywanie zabezpieczeÅ otrzymanych przez przedsiÄbiorstwo zbiorowego inwestowania:

Liczba i nazwiska/nazwy powiernikw i kwota aktyww stanowiĄcych zabezpieczenie przechowywanych przez kaŹdego z powiernikw.	
Liczba powiernikw	-
Powiernik	Kwota aktyww stanowiĄcych zabezpieczenie

Przechowywanie zabezpieczeÅ udzielonych przez przedsiÄbiorstwo zbiorowego inwestowania:

Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na odrÄbnych rachunkach	10000,00%
Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na wsplnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na wszelkich innych rachunkach	-

Dane dotyczĄce rentownoŹci i kosztw:

	od 2019-01-01 do 2019-12-31			
	RentownoŹ		Koszty	
	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
Udzielanie poŹyczek papierw wartoŹciowych lub towarw oraz zaciĄganie poŹyczek papierw wartoŹciowych lub towarw:				
- PrzedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- ZarzĄdzajĄcy przedsiÄbiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaŹ lub transakcja zwrotna sprzedaŹ-kupno:	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
- PrzedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania	59	100,00%	272	100,00%
- ZarzĄdzajĄcy przedsiÄbiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-

SUBFUNDUSZ STABILNY

Zgodnie z art. 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 (Dz. Urz. UE 23.12.2015 L 337/1), na dzień bilansowy spółka zarządzająca AFI prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Subfunduszu

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN)

Dane na dzień 2019-12-31

Dane ogólne:

Kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki (z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów)	-
Kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego (wyrażona jako kwota bezwzględna w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania):	
Kwota bezwzględna w PLN	-
Odsetek zarządzanych aktywów	-

Dane dotyczące koncentracji:

10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)	
SKARB PAŃSTWA RZECZYPOSPOLITEJ POLSKIEJ	-
10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)	
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	-
Transakcje zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcje zwrotna sprzedaż-kupno	-
ALIOR BANK S.A.	-
MBANK S.A.	-
BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	-
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	-

Zbiornicze dane dotyczące transakcji:

Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	-
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	-
Waluta zabezpieczeń	-
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	-
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	-
Rozliczenie i rozrachunek	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	-
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	-
powyżej jednego roku	-
Waluta zabezpieczeń	-
PLN	-
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	-
powyżej jednego roku	-
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	-
POLSKA	-
Rozliczenie i rozrachunek	-

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

Odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom	-
Zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych	-

Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

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

Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wspólnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wszelkich innych rachunkach	-

Dane dotyczące rentowności i kosztów:

	od 2019-01-01 do 2019-12-31			
	Rentowność		Koszty	
	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów:				
- Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno:	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
- Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania	-	-	22	100,00%
- Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-

SUBFUNDUSZ OBLIGACJI

Zgodnie z art. 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 (Dz. Urz. UE 23.12.2015 L 337/1), na dzień bilansowy spółka zarządzająca AFI prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Subfunduszu

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN)

Dane na dzień 2019-12-31

Dane ogólne:

Kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki (z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów)	-
Kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego (wyrażona jako kwota bezwzględna w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania):	
Kwota bezwzględna w PLN	1 547
Odsetek zarządzanych aktywów	2,51%

Dane dotyczące koncentracji:

10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)	
SKARB PAŃSTWA RZECZYPOSPOLITEJ POLSKIEJ	-
10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)	
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	-
Transakcje zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcje zwrotna sprzedaż-kupno	1 547
ALIOR BANK S.A.	1 547
MBANK S.A.	-
BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	-
POWSZECHNA KASA OSZCZĘDNOŚCI BANK POLSKI S.A.	-

Zbiornicze dane dotyczące transakcji:

Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	-
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	-
Waluta zabezpieczeń	-
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	-
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	-
Rozliczenie i rozrachunek	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	1 547
Obligacje skarbowe	1 547
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	1 547
od trzech miesięcy do jednego roku	-
powyżej jednego roku	1 547
Waluta zabezpieczeń	1 547
PLN	1 547

Zbiornicze dane dotyczĄce transakcji:

Okres zapadalnoŹci w odniesieniu do transakcji finansowanych z uŹyciem papierów wartoŹciowych i do swapów przychodu caÅkowego w podziale wedÅug następujĄcych klas zapadalnoŹci	1 547
powyŹej jednego roku	-
od jednego dnia do jednego tygodnia	1 547
Kraj, w ktrym kontrahenci majĄ siedziby	1 547
POLSKA	1 547
Rozliczenie i rozrachunek	1 547
dwustronne	1 547

Dane dotyczĄce ponownego wykorzystania zabezpieczeÅ:

Odsetek otrzymanych zabezpieczeÅ, ktre sĄ przedmiotem ponownego wykorzystania, w porwnaniu z maksymalnĄ kwotĄ okreŹlonĄ w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom	-
Zyski przedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania z tytuÅu reinwestowanych zabezpieczeÅ gotwkowych	-

Przechowywanie zabezpieczeÅ otrzymanych przez przedsiÄbiorstwo zbiorowego inwestowania:

Liczba i nazwiska/nazwy powiernikw i kwota aktyww stanowiĄcych zabezpieczenie przechowywanych przez kaŹdego z powiernikw.	
Liczba powiernikw	-
Powiernik	Kwota aktyww stanowiĄcych zabezpieczenie

Przechowywanie zabezpieczeÅ udzielonych przez przedsiÄbiorstwo zbiorowego inwestowania:

Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na odrbnych rachunkach	10000,00%
Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na wsplnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeÅ posiadanych na wszelkich innych rachunkach	-

Dane dotyczĄce rentownoŹci i kosztw:

	od 2019-01-01 do 2019-12-31			
	RentownoŹ		Koszty	
	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
Udzielanie poŹyczek papierw wartoŹciowych lub towarw oraz zaciĄganie poŹyczek papierw wartoŹciowych lub towarw:				
- PrzedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- ZarzĄdzajĄcy przedsiÄbiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaŹ lub transakcja zwrotna sprzedaŹ-kupno:	Kwota	Odsetek	Kwota	Odsetek
- PrzedsiÄbiorstwa zbiorowego inwestowania	6	100,00%	38	100,00%
- ZarzĄdzajĄcy przedsiÄbiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-