**Ujawnienie informacji na podstawie art. 222 d ust. 4 pkt 7 Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2020 r. poz. 95) („Ustawa")**

1. Liczba pracowników podmiotu, który zarządza alternatywnym funduszem inwestycyjnym oraz całkowita kwota wynagrodzeń wypłaconych przez podmiot, który zarządza alternatywnym funduszem inwestycyjnym, pracownikom, w tym odrębnie, całkowitą kwotę wynagrodzeń wypłaconych osobom, o których mowa w art. 47a ust. 1 i art. 70j ust. 1

| | | W tym, osoby, o których mowa w art. 47 a ust. 1 Ustawy |
|---|---|---|
| Liczba pracowników na dzień 31.12.2020 | ***68,375*** | ***14*** |
| Całkowita kwota wynagrodzeń, w tym: | ***19 455 749*** | ***6 407 114*** |
| Wynagrodzenie stałe*) | ***15 291 788*** | ***5 348 762*** |
| Wynagrodzenie zmienne**) | ***4 163 961*** | ***1 058 352*** |

*) Kwota wynagrodzenia stałego obejmuje: wynagrodzenie zasadnicze, wynagrodzenie urlopowe, wynagrodzenie chorobowe i zasiłki, świadczenia związane z rozwiązaniem umowy, inne świadczenia na rzecz pracownika pokrywane przez pracodawcę.

**) Kwota wynagrodzenia zmiennego obejmuje: premię roczną wypłaconą za rok 2019 oraz premie kwartalne za okres od 4Q 2019 do 3Q 2020, nagrody specjalne, elementy odroczonego wynagrodzenia zmiennego przyznane w poprzednich latach i wypłacone w roku 2020, etc.

2. Kwota wynagrodzenia dodatkowego (wynagrodzenia uzależnionego od wyników funduszu inwestycyjnego) wypłaconego ze środków alternatywnego funduszu inwestycyjnego;

   Towarzystwo nie pobiera wynagrodzenia zmiennego.

Warszawa, 4 marca 2021 r.

Małgorzata Barska Digitally signed by Małgorzata Barska Date: 2021.03.04 18:31:39 +01'00'

Małgorzata Barska
Prezes Zarządu

Robert Bohynik
Wiceprezes Zarządu

Łukasz Adaś Digitally signed by Łukasz Adaś Date: 2021.03.04 16:59:37 +01'00'

Łukasz Adaś
Członek Zarządu

Tomasz Sułek Digitally signed by Tomasz Sułek Date: 2021.03.04 17:05:31 +01'00'

Tomasz Sułek
Członek Zarządu

# Fundusz Własności Pracowniczej PKP Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

## Ujawnienie informacji na podstawie art. 222 b Ustawy o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2020 r. poz. 95) („Ustawa")

Zgodnie z wymogami art. 222 b Ustawy z dnia 27.05.2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi Zarząd NN Investment Partners Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. (Towarzystwo) przedstawia poniższe informacje.

**1. Informacja o udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.**

W funduszu nie występują aktywa, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.

**2. Informacja o zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością.**

W okresie od 1 stycznia 2020 r. do 31 grudnia 2020 r. nie dokonywano zmian regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością.

**3. Informacja o aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający.**

Na dzień 31 grudnia 2020 r. fundusz posiadał umiarkowany poziom ryzyka rynkowego.

System zarządzania ryzykiem w NN Investment Partners TFI S.A. obejmuje wszystkie rodzaje ryzyka istotne w zarządzaniu funduszami inwestycyjnymi. Składa się on z polityk i procedur dotyczących ryzyka rynkowego, kredytowego, kontrahenta, płynności i ryzyka operacyjnego.

Najważniejszym narzędziem do pomiaru ryzyka rynkowego jest miara wartości zagrożonej (*VaR*), która używana jest do pomiaru ryzyka całego portfela jak również ryzyka poszczególnych składników lokat. Jej dopełnieniem są testy warunków skrajnych. Obliczenia przeprowadzane są codziennie i regularnie raportowane do Komitetu Inwestycyjnego oraz Zarządu Towarzystwa.

Ryzyko kredytowe i kontrahenta zarządzane jest poprzez system wewnętrznych limitów inwestycyjnych dotyczących lokowania aktywów w instrumenty finansowe emitowane przez podmioty posiadające odpowiednią ocenę wiarygodności kredytowej oraz dokonywania transakcji z brokerami/bankami dającymi rękojmię należytego wykonania umowy brokerskiej bądź umowy kupna/sprzedaży instrumentu finansowego.

Ryzyko płynności zarządzane jest za pomocą miary *Exit Time*, która mierzy czas (w dniach) potrzebny do likwidacji całości pozycji w portfelu funduszu. *Exit Time* portfela to średnia miar *Exit Time* dla poszczególnych instrumentów ważona wagami tych instrumentów w portfelu. Ryzyko płynności kontrolowane jest na bazie tygodniowej poprzez monitoring aktualnych wartości *Exit Time* dla poszczególnych składników funduszu i określenie czasu potrzebnego do likwidacji określonej części portfela. Analizowane jest także jaką część portfela funduszu można spieniężyć w ciągu ustalonego czasu. Wyniki kontroli raportowane są do zarządzających funduszami i uwzględniane w procesie inwestycyjnym.

Ryzyko operacyjne zarządzane jest poprzez zebranie i analizę wszystkich zdarzeń operacyjnych mających lub mogących mieć wpływ na wynik funduszu lub poziom obsługi jego uczestników. Zdarzenia te są dyskutowane na comiesięcznych Komitetach Ryzyka Operacyjnego, gdzie formułowane są odpowiednie wnioski i propozycje działań naprawczych.

Warszawa, 4 marca 2021 r.

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | Łukasz Adaś Digitally signed by Łukasz Adaś Date: 2021.03.04 17:08:13 +01'00' | Tomasz Sułek Digitally signed by Tomasz Sułek Date: 2021.03.04 17:11:55 +01'00' |
| Małgorzata Barska<br>Prezes Zarządu | Robert Bohynik<br>Wiceprezes Zarządu | Łukasz Adaś<br>Członek Zarządu | Tomasz Sułek<br>Członek Zarządu |

# Informacja o zamianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej oraz wysokości zastosowanej dźwigni finansowej

Zgodnie z wymogami art. 222 b ust. 2) Ustawy z dnia 27.05.2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2020 r., poz. 95) Zarząd NN Investment Partners Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. (Towarzystwo) przedstawia poniższe informacje.

## 1. Informacja o zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej AFI.

Towarzystwo oświadcza, iż w okresie od 1 stycznia 2020 r. do 31 grudnia 2020 r. nie nastąpiły zmiany maksymalnego poziomu dźwigni finansowej Funduszy/Subfunduszy zarządzanych przez Towarzystwo, która może być stosowana w imieniu Funduszu oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością.

## 2. Informacja o wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI.

| **Fundusz/Subfundusz** | **Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI** | **31.12.2020 r.** | |
|---|---|---|---|
| | | **Wysokość dźwigni finansowej AFI metoda brutto** | **Wysokość dźwigni finansowej metoda zaangażowania** |
| Fundusz Własności Pracowniczej PKP SFIO | 2 | 0,990 | 1,000 |

Warszawa, 4 marca 2021 r.

Łukasz Adaś Digitally signed by Łukasz Adaś Date: 2021.03.04 17:09:12 +01'00'

Tomasz Sułek Digitally signed by Tomasz Sułek Date: 2021.03.04 17:12:39 +01'00'

Małgorzata Barska
Prezes Zarządu

Robert Bohynik
Wiceprezes Zarządu

Łukasz Adaś
Członek Zarządu

Tomasz Sułek
Członek Zarządu

# Fundusz Własności Pracowniczej PKP Specjalistyczny Fundusz Inwestycyjny Otwarty

## Ujawnienie informacji na podstawie 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 ("Rozporządzenie")

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, na dzień bilansowy NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. działające jako ZAFI (podmiot zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym) prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Funduszu:

Fundusz dokonując lokat aktywów:
– stosuje transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych, w rozumieniu art. 3 pkt 11 Rozporządzenia;
– nie stosuje swapów przychodu całkowitego, w rozumieniu art. 3 pkt 18) Rozporządzenia.
Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapy przychodu całkowitego.

Warszawa, 4 marca 2021 r.

Małgorzata Barska
Prezes Zarządu

Tomas z Sułek Digitally signed by Tomasz Sułek Date: 2021.03.04 17:13:55 +01'00'

Łukasz Adaś Digitally signed by Łukasz Adaś Date: 2021.03.04 17:10:02 +01'00'

Robert Bohynik
Wiceprezes Zarządu

Tomasz Sułek
Członek Zarządu

Łukasz Adaś
Członek Zarządu