Goldman Sachs Parasol 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 Goldman Sachs Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. działające jako spółka zarządzająca UCITS 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.

W przypadku subfunduszu:
Goldman Sachs Indeks Obligacji
Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapów przychodu całkowitego.

W przypadku subfunduszy:

Goldman Sachs Indeks Odpowiedzialnego Inwestowania

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.
Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending.
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	08/11/2023	50 000	1 336	5 809
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	25/07/2023	235 752	6 299	27 388
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	14/11/2023	300 000	865	3 759
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	18/10/2023	60 132	173	754
			razem	8 673	37 710

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
DEUTSCHE BUNDESREPUB 0.1 15APR33 IL	DE0001030583	Aaa	AAA	0,1	0,4
FINLAND GOVERNME 1.375 15APR47 144A	FI4000242870	Aa1	AA+	1	3
FINLAND GOVERNMEN 2.75 04JUL28 144A	FI4000037635	Aa1	AA+	1	5
FINLAND GOVERNMEN 2.75 15APR38 144A	FI4000546528	Aa1	AA+	104	453
FINLAND GOVERNMENT 0.5 15SEP29 144A	FI4000369467	Aa1	AA+	4 455	19 371
FINLAND GOVERNMENT 3.0 15SEP33 144A	FI4000550249	Aa1	AA+	260	1 131
KINGDOM OF BELGIUM 2.6 22JUN24 144A	BE0000332412	Aa3	AA	0,2	1

REPUBLIC OF AUSTRI 0.9 20FEB32 144A	AT0000A2WSC8	Aa1	AA+	390	1 696
REPUBLIC OF AUSTRI 2.4 23MAY34 144A	AT0000A10683	Aa1	AA+	1	4
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	Aa1	AA+	3 923	17 055
			razem	9 135	39 719

W okresie sprawozdawczym nie zawarto transakcji typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back oraz nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Polski Odpowiedzialnego Inwestowania

W okresie sprawozdawczym zawarto 94 transakcje typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 6 dni.
Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.
Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	135	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy nie wystąpiły transakcje typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back.

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.
Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending.
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
COGNOR HOLDING SA	PLCNTSL00014	20/10/2023	10 000	19	84
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	02/10/2023	100 000	288	1 253
			razem	307	1 337

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	**ISIN**	**Issuer Rating Moody**	**Issuer Rating S&P**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
REPUBLIC OF AUSTR 0.25 20OCT36 144A	AT0000A2T198	Aa1	AA+	420	1 826

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Średnich i Małych Spółek

W okresie sprawozdawczym zawarto 88 transakcji typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 6 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	210	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy nie wystąpiły transakcje typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back.

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.
Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending.
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
AMREST HOLDINGS SE	ES0105375002	13/10/2023	100	1	3
COGNOR HOLDING SA	PLCNTSL00014	18/10/2023	22 748	44	192
GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	12/12/2023	15 000	86	374
GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	14/11/2023	17 914	103	447
LIVECHAT SOFTWARE	PLLVTSF00010	13/10/2023	3 076	84	364
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	04/10/2023	36 687	35	152
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	10/10/2023	50 000	48	208
			razem	401	1 740

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	**ISIN**	**Issuer Rating Moody**	**Issuer Rating S&P**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
REPUBLIC OF AUSTR 0.25 20OCT36 144A	AT0000A2T198	Aa1	AA+	525	2 284

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Akcji

W okresie sprawozdawczym zawarto 69 transakcji typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., Santander Bank Polska S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 5 dni.
Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	452	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy nie wystąpiły transakcje typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back.

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.
Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending.
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	10/10/2023	50 000	1 336	5 809
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	13/10/2023	22 091	590	2 566
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	20/10/2023	50 000	1 336	5 809
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	25/10/2023	50 000	1 336	5 809
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	04/10/2023	100 000	288	1 253
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	06/10/2023	80 241	231	1 006
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	11/10/2023	250 000	721	3 133
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	12/10/2023	200 000	576	2 506
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	13/10/2023	150 000	432	1 880
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	16/10/2023	100 000	288	1 253
			razem	7 134	31 024

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	**ISIN**	**Issuer Rating Moody**	**Issuer Rating S&P**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
FINLAND GOVERNME 1.375 15APR47 144A	FI4000242870	Aa1	AA+	1	3
FINLAND GOVERNMEN 2.75 04JUL28 144A	FI4000037635	Aa1	AA+	1 407	6 120

FINLAND GOVERNMENT 0.0 15SEP24 144A	FI4000391529	Aa1	AA+	278	1 208
FINLAND GOVERNMENT 0.5 15SEP29 144A	FI4000369467	Aa1	AA+	31	134
FINLAND GOVERNMENT 3.0 15SEP33 144A	FI4000550249	Aa1	AA+	118	515
REPUBLIC OF AUSTR 0.75 20OCT26 144A	AT0000A1K9C8	Aa1	AA+	3 564	15 497
REPUBLIC OF AUSTR 4.85 15MAR26 144A	AT0000A0DXC2	Aa1	AA+	1	5
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20FEB30 144A	AT0000A2CQD2	Aa1	AA+	350	1 524
REPUBLIC OF AUSTRI 0.9 20FEB32 144A	AT0000A2WSC8	Aa1	AA+	1 056	4 591
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	Aa1	AA+	753	3 274
			razem	7 559	32 871

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Globalnej Dywersyfikacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 70 transakcji typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A. oraz Bankiem Societe Generale S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 6 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	61	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy nie wystąpiły transakcje typu buy-sell-back i transakcji typu sell-buy-back.
Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Konserwatywny

W okresie sprawozdawczym zawarto 282 transakcji typu buy-sell-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 8 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	19 727	1	0,97%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	19 728	19 718
Buy-sell-back	24 370	1	1,20%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	24 348	24 363
Buy-sell-back	8 997	1	0,44%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	PS0728	PLN	ING Bank Śląski	8 990	8 995
Buy-sell-back	69 027	1	3,39%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	68 978	69 027
Buy-sell-back	1 944	1	0,10%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WZ1128	PLN	ING Bank Śląski	1 945	1 943
Buy-sell-back	15 010	1	0,74%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-05	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	15 010	15 005

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	4 692	-
Sell-buy-back	-	-

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 17 transakcji typu buy-sell-back, 331 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Bankiem Gospodarstwa Krajowego S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 1 do 26 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj otrzymanego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość otrzymanego zabezpieczenia	Wartość przekazanego zabezpieczenia
Buy-sell-back	44 192	1	0,69%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	44 195	44 171

Buy-sell-back	68 103	2	1,06%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	68 049	68 081
Buy-sell-back	55 383	1	0,86%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	55 319	55 383
Buy-sell-back	23 392	1	0,36%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	PS0728	PLN	ING Bank Śląski	23 373	23 385
Buy-sell-back	106 661	1	1,66%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	106 584	106 661
Buy-sell-back	5 054	1	0,08%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WZ1128	PLN	ING Bank Śląski	5 057	5 053
Buy-sell-back	40 027	1	0,62%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-05	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	40 027	40 014

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	61 616	1	0,96%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	PS1026	PLN	ING Bank Śląski	61 562	61 412
Sell-buy-back	200 604	1	3,13%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	200 610	200 017

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	184	-
Sell-buy-back	-	38 837

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Krótkoterminowych Obligacji

W okresie sprawozdawczym zawarto 124 transakcje typu buy-sell-back i 138 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Bankiem Gospodarstwa Krajowego S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 1 do 21 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	12 864	1	0,39%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	12 865	12 858
Sell-buy-back	39 692	1	1,20%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	39 693	39 576
Sell-buy-back	21 759	1	0,66%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WZ1127	PLN	ING Bank Śląski	21 743	21 759
Sell-buy-back	27 470	1	0,83%	Santander Bank Polska S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	WZ1129	PLN	ING Bank Śląski	27 449	27 431

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	1 207	-
Sell-buy-back	-	2 487

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Stabilnego Wzrostu

W okresie sprawozdawczym zawarto 11 transakcji typu buy-sell-back, 442 transakcje typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A., Bankiem Gospodarstwa Krajowego S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 2 do 26 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	13 936	1	0,63%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	13 937	13 929
Sell-buy-back	9 660	1	0,44%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	9 649	9 660
Sell-buy-back	17 605	1	0,80%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	PS1026	PLN	ING Bank Śląski	17 589	17 546
Sell-buy-back	45 055	1	2,04%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	45 057	44 924

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	51	-
Sell-buy-back	-	12 938

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Goldman Sachs Zrównoważony

W okresie sprawozdawczym zawarto 2 transakcję typu buy-sell-back, 531 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., NWAI Domem Maklerskim S.A. Bankiem Gospodarstwa Krajowego S.A. oraz Santander Bank Polska S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 1 do 26 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych Funduszu w banku pełniącym funkcje depozytariusza Funduszu.

Zabezpieczenia udzielone przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane są na rachunkach bankowych i rachunkach papierów wartościowych wskazanych przez kontrahenta.

Dane na dzień bilansowy (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Wartość transakcji aktywnych na dzień bilansowy	Ilość transakcji aktywnych	% udział w aktywach ogółem	Kontrahent	Kraj siedziby kontrahenta	Okres zapadalności	Typ rozliczenia i rozrachunku	Rodzaj udzielonego zabezpieczenia obligacje skarbowe	Waluta	Powiernik	Wartość udzielonego zabezpieczenia	Wartość otrzymanego zabezpieczenia
Sell-buy-back	37 520	1	3,03%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	37 523	37 502
Sell-buy-back	34 346	1	2,78%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	34 307	34 346
Sell-buy-back	8 802	1	0,71%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	PS1026	PLN	ING Bank Śląski	8 795	8 773
Sell-buy-back	36 473	1	2,95%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	36 475	36 367

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	10	-
Sell-buy-back	-	8 338

W okresie sprawozdawczym Subfundusz udzielał pożyczek papierów wartościowych. Udzielenie pożyczki następuje na podstawie ramowej umowy z zagranicznym bankiem o wysokiej reputacji (Goldman Sachs Agency Lending (GSAL)). Zgodnie z umową, zwrot i wartość papierów wartościowych, będących przedmiotem pożyczki (ryzyko kontrahenta) jest zabezpieczona w postaci codziennie weryfikowanego i rozliczanego

otrzymanego przez subfundusz depozytu zabezpieczającego o wartości przekraczającej wartość rynkową danych papierów wartościowych. Warunki pożyczki zapewniają przeniesienie ewentualnych przychodów z papierów (dywidendy) w wartości, jaką Subfundusz otrzymałby, a Subfundusz ma prawo do żądania zwrotu pożyczki.
Przedmiotem pożyczek były poniższe akcje spółek notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie. Agentem jest Goldman Sachs Agency Lending.
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	16/03/2023	9 560	255	1 111
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	17/07/2023	50 000	1 336	5 809
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	23/10/2023	80 433	232	1 008
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	24/10/2023	110 000	317	1 378
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	31/10/2023	100 000	288	1 253
			razem	2 428	10 559

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20FEB30 144A	AT0000A2CQD2	Aa1	AA+	2 625	11 415

Na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje swapów przychodu całkowitego.

Warszawa, 25 kwietnia 2024 r.

Małgorzata Barska	Robert Bohynik	Tomasz Sułek	Łukasz Adaś
Prezes Zarządu	Wiceprezes Zarządu	Członek Zarządu	Członek Zarządu