Goldman Sachs Emerytura 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 Goldman Sachs 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.

W przypadku subfunduszu Goldman Sachs Emerytura 2065 na dzień bilansowy oraz w okresie sprawozdawczym nie wystąpiły transakcje finansowane z użyciem papierów wartościowych i swapów przychodu całkowitego.

W przypadku subfunduszy:

Goldman Sachs Emerytura 2025

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2025 zawarto 175 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	2 466	1	4,14%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	2 466	2 464
Sell-buy-back	2 254	1	3,79%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	2 251	2 254

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	78

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

Goldman Sachs Emerytura 2030

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2030 zawarto 241 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	1 286	1	1,06%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	1 286	1 286
Sell-buy-back	966	1	0,80%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	965	966

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	156

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 (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
AUTO PARTNER SA	PLATPRT00018	12/12/2023	1 478	9	39
MIRBUD SA	PLMRBUD00015	12/12/2023	4 872	9	40
			razem	18	79

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 GOVERNMENT 0.0 15SEP24 144A	FI4000391529	Aa1	AA+	3	13
FINLAND GOVERNMENT 0.5 15SEP29 144A	FI4000369467	Aa1	AA+	2	8
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20FEB30 144A	AT0000A2CQD2	Aa1	AA+	4	19
REPUBLIC OF AUSTRI 0.5 20FEB29 144A	AT0000A269M8	Aa1	AA+	96	417
			razem	105	457

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

Goldman Sachs Emerytura 2035

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2035 zawarto 300 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	3 323	1	1,51%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	3 323	3 322
Sell-buy-back	2 898	1	1,32%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	2 895	2 898

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	278

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 (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
ARCTIC PAPER SA	PLARTPR00012	14/09/2023	3 473	18	78
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	14/09/2023	16 437	16	68
			razem	34	146

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 GOVERNMENT 3.0 15SEP33 144A	FI4000550249	Aa1	AA+	103	447
REPUBLIC OF AUSTR 1.65 21OCT24 144A	AT0000A185T1	Aa1	AA+	1	4
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20OCT40 144A	AT0000A2KQ43	Aa1	AA+	1	3
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	Aa1	AA+	1	3
			razem	106	457

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

Goldman Sachs Emerytura 2040

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2040 zawarto 278 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	3 859	1	1,21%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	3 859	3 857
Sell-buy-back	3 327	1	1,05%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	3 323	3 327

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	281

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 (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
ALLEGRO.EU SA	LU2237380790	12/12/2023	89 468	692	3 008
ARCTIC PAPER SA	PLARTPR00012	22/08/2023	5 000	26	112
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	25/10/2023	10 000	10	42
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	26/10/2023	10 000	10	42
			razem	738	3 204

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 0.75 20OCT26 144A	AT0000A1K9C8	Aa1	AA+	840	3 653

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

Goldman Sachs Emerytura 2045

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2045 zawarto 292 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	3 109	1	0,94%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	3 109	3 107
Sell-buy-back	1 932	1	0,58%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-01-03	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	1 930	1 932

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	265

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 (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
ARCTIC PAPER SA	PLARTPR00012	20/07/2023	4 859	25	109
LIVECHAT SOFTWARE	PLLVTSF00010	29/09/2023	3 043	83	361
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	25/09/2023	23 850	23	99
			razem	131	569

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)
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHL 0.5 15FEB28	DE0001102440	Aaa	AAA	0,01	0,04
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHL 4.0 04JAN37	DE0001135275	Aaa	AAA	0,01	0,1
DEUTSCHE BUNDESREPUB 0.5 15APR30 IL	DE0001030559	Aaa	AAA	0,1	0,2
FINLAND GOVERNMENT 0.5 15SEP29 144A	FI4000369467	Aa1	AA+	210	913
			razem	210	913

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

Goldman Sachs Emerytura 2050

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2050 zawarto 286 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	-	-
Sell-buy-back	-	170

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 (GSAL).

Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
ARCTIC PAPER SA	PLARTPR00012	24/08/2023	2 108	11	47
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	19/10/2023	31 875	92	399
			razem	103	446

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 GOVERNMENT 0.5 15SEP29 144A	FI4000369467	Aa1	AA+	1	4
REPUBLIC OF AUSTRI 0.9 20FEB32 144A	AT0000A2WSC8	Aa1	AA+	208	904
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	Aa1	AA+	1	3
			razem	211	914

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

Goldman Sachs Emerytura 2055

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2055 zawarto 163 transakcji typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A., Bankiem Polska Kasa Opieki 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 10 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	-	-
Sell-buy-back	-	52

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 (GSAL).
Stan pożyczek na datę bilansową:

Przedmiot pożyczki	**ISIN**	**data transakcji**	**liczba**	**wartość rynkowa (w tys. euro)**	**wartość rynkowa (w tys. zł)**
ARCTIC PAPER SA	PLARTPR00012	24/08/2023	2 500	13	56
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	24/10/2023	20 000	19	83
			razem	32	139

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+	18	80
KINGDOM OF BELGIUM 2.6 22JUN24 144A	BE0000332412	Aa3	AA	0,2	1
REPUBLIC OF AUSTRI 0.0 20FEB30 144A	AT0000A2CQD2	Aa1	AA+	86	375
			razem	104	456

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

Goldman Sachs Emerytura 2060

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2060 zawarto 27 transakcji typu sell-buy-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 4 dni.

Zabezpieczenia otrzymane przez Fundusz w ramach transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywane były 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 były 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	-	-
Sell-buy-back	-	3

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