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 subfunduszy:

Goldman Sachs Emerytura 2025

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2025 zawarto 100 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 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	3 573	1	4,96%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	3 576	3 572
Sell-buy-back	3 678	1	5,10%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	3 678	3 678

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

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

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 6 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 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	2 145	1	1,42%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 146	2 145
Sell-buy-back	2 042	1	1,36%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 044	2 041

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

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

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	07/06/2024	UBS AG	1 800	12	53
MIRBUD SA	PLMRBUD00015	17/06/2024	UBS AG	5 000	16	70
					28	123

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 2.9 20FEB34 144A	AT0000A39UW5	104 900	Aa1	AA+	105	453

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 19 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 6 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	5 207	1	1,87%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	5 211	5 205
Sell-buy-back	5 210	1	1,87%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	5 211	5 210

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

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

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	07/06/2024	UBS AG	5 000	34	147
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	22/01/2024	UBS AG	35 452	29	124
					63	271

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
NETHERLANDS GOVERN 5.5 15JAN28 144A	NL0000102317	184	Aaa	AAA	0	1
REPUBLIC OF AUSTRIA 0.75 20MAR51	AT0000A2EJ08	1 000	Aa1	AA+	1	2
REPUBLIC OF AUSTRIA GO 6.25 15JUL27	AT0000383864	90 628	Aa1	AA+	104	450
					105	453

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 13 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 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	3 575	1	0,89%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	3 576	3 575
Sell-buy-back	2 961	1	0,73%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 963	2 960

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	6

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
COGNOR HOLDING SA	PLCNTSL00014	24/04/2024	Morgan Stanley & Co. International PLC	15 583	31	132
GRUPA AZOTY SA	PLZATRM00012	18/01/2024	UBS AG	10 000	47	201
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	06/06/2024	UBS AG	8 500	58	249
					136	582

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
1 7/8 BOND 41	US912810SW99	160 600	Aaa	AA+	105	453
REPUBLIC OF AUSTRI 2.9 20FEB34 144A	AT0000A39UW5	209 800	Aa1	AA+	210	906
					315	1 359

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 16 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 6 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	2 859	1	0,67%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 861	2 858
Sell-buy-back	2 043	1	0,48%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 044	2 043

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

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

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	03/06/2024	Merrill Lynch International	10 000	68	293
CD PROJEKT SA	PLOPTTC00011	14/06/2024	UBS AG	8 000	257	1 107
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	24/01/2024	UBS AG	15 873	45	193

Przedmiot pożyczki	ISIN	data transakcji	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	25/09/2023	UBS AG	22 696	18	79
					388	1 672

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
0 5/8 TRIN A 26	US912828N712	88 000	Aaa	AA+	105	453
REPUBLIC OF AUSTR 4.15 15MAR37 144A	AT0000A04967	377 000	Aa1	AA+	421	1 815
					526	2 268

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 44 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 1 do 6 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	2 860	1	0,92%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 861	2 860
Sell-buy-back	2 348	1	0,75%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 350	2 347

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	19

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	06/06/2024	UBS AG	8 100	55	238
POLIMEX MOSTOSTAL	PLMSTSD00019	18/01/2024	UBS AG	30 979	25	108
					80	346

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 2.9 20FEB34 144A	AT0000A39UW5	104 900	Aa1	AA+	105	453

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 84 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 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	2 450	1	1,26%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 452	2 449
Sell-buy-back	2 758	1	1,41%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	2 759	2 758

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	24

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	nazwa pożyczkobiorcy	liczba	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
BANK MILLENNIUM SA	PLBIG0000016	11/06/2024	UBS AG	40 000	85	365
CYFROWY POLSAT SA	PLCFRPT00013	12/02/2024	UBS AG	6 460	18	78
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	PLJSW0000015	07/06/2024	UBS AG	5 000	34	147
					137	590

Zabezpieczeniem powyższej pożyczki są obligacje:

Otrzymane zabezpieczenie	ISIN	liczba	Issuer Rating Moody	Issuer Rating S&P	wartość rynkowa (w tys. euro)	wartość rynkowa (w tys. zł)
REPUBLIC OF AUSTRI 2.9 20FEB34 144A	AT0000A39UW5	209 800	Aa1	AA+	210	906

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 2 transakcje typu sell-buy-back. Transakcje były zawierane z Ipopema Securities S.A. oraz Bankiem Polska Kasa Opieki S.A., w których zabezpieczeniem były obligacje Skarbu Państwa, walutą zabezpieczeń był PLN, okres zapadalności wynosił od 3 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	-	0,2

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

Goldman Sachs Emerytura 2065

W okresie sprawozdawczym na Goldman Sachs Subfunduszu Emerytura 2060 zawarto 11 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 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	106	1	1,95%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	DS1033	PLN	ING Bank Śląski	107	106
Sell-buy-back	102	1	1,87%	Ipopema Securities S.A.	Polska	2024-07-01	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	102	102
Sell-buy-back	102	1	1,87%	Bank Polska Kasa Opieki S.A.	Polska	2024-07-02	dwustronne	WS0429	PLN	ING Bank Śląski	102	102

Dane dotyczące rentowności i kosztów (w tys. zł)

Rodzaj transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych	Przychody	Koszty
Buy-sell-back	-	-
Sell-buy-back	-	0,3

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

Warszawa, 28 sierpnia 2024 r.

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