

PÓŁROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2011 ROKU

ING Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

ING Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy ING (L) Invest US (Enhanced Core Concentrated)

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	stan na dzień 31.12.2010	stan na dzień 31.12.2011
I. Aktywa		1 751 157,10	1 973 289,50
1. lokaty		1 749 736,98	1 973 289,50
2. środki pieniężne		0,00	0,00
3. aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej		0,00	0,00
4. należności		1 420,12	0,00
4.1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
4.2. pozostałe		1 420,12	0,00
II. Zobowiązania		2 153,61	222 927,21
1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		0,00	0,00
3. pozostałe		2 153,61	222 927,21
III. Aktywa netto (I-II)		1 749 003,49	1 750 362,29

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	za okres 01.01.2010- 31.12.2010	za okres 01.01.2011- 31.12.2011
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego		1 606 141,75	1 749 003,49
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-100 787,89	33 076,51
I. Zwiększenia funduszu		72 619,92	100 747,15
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu		0,00	0,00
2. pozostałe przychody		0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia		72 619,92	100 747,15
II. Zmniejszenia funduszu		173 407,81	67 670,64
1. tytułem wykupu		109 649,58	23 878,23
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		10 281,48	0,00
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu		29 085,08	16 938,76
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		0,00	0,00
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem		24 106,03	0,00
6. pozostałe koszty		0,00	0,00
7. pozostałe zmniejszenia		285,64	26 853,65
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		243 649,63	-31 717,71
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		1 749 003,49	1 750 362,29

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		za okres 01.01.2010- 31.12.2010	za okres 01.01.2011- 31.12.2011
I.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	4 507,45026	4 310,51811
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	4 310,51811	3 813,93821
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	356,33044	405,75250
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	301,26807	339,04330
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	419,42304	462,81125
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	405,75250	458,93829

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — półroczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w zł)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 973 289,50	112,74%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
2.	obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00%
3.	inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	1 956 236,50	111,76%
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrywę rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty bankowe	17 053,00	0,97%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r, o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00%
III.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
IV.	Należności	0,00	0,00%
V.	Zobowiązania	222 927,21	12,74%
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 750 362,29	100,00%
1.	krajowe	17 053,00	0,97%
2.	zagraniczne - kraje UE	1 733 309,29	99,03%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%

Wartości prezentowane w półrocznym sprawozdaniu Ubezpieczeniowego Funduszu Kapitałowego za poprzedni okres sprawozdawczy zostały przygotowane w sposób zapewniający porównywalność danych z obecnym okresem sprawozdawczym.

Sprawozdanie zostało sporządzone dnia 09.02.2012 roku.