

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2013 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 31.12.2012	stan na dzień 31.12.2013
I. Aktywa		1 672 181,32	1 178 032,45
1. lokaty		1 639 914,55	1 123 894,36
2. środki pieniężne		0,00	54 035,28
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		32 266,77	102,81
4.1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
4.2. pozostałe		32 266,77	102,81
II. Zobowiązania		4 030,23	9 059,93
1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		0,00	7 600,16
3. pozostałe		4 030,23	1 459,77
III. Aktywa netto (I-II)		1 668 151,09	1 168 972,52

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	za okres 01.01.2012- 31.12.2012	za okres 01.01.2013- 31.12.2013
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego		1 750 362,29	1 668 151,09
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-193 942,71	-897 067,71
I. Zwiększenia funduszu		114 202,72	11,88
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu		0,00	0,00
2. pozostałe przychody		0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia		114 202,72	11,88
II. Zmniejszenia funduszu		308 145,43	897 079,59
1. tytułem wykupu		238 666,49	834 734,26
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		0,00	0,00
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu		31 406,85	20 646,20
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		0,00	0,00
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem		25 672,63	21 578,83
6. pozostałe koszty			
7. pozostałe zmniejszenia		12 399,46	20 120,30
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		111 731,51	397 889,14
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		1 668 151,09	1 168 972,52

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

	Pozycja	za okres 01.01.2012- 31.12.2012	za okres 01.01.2013- 31.12.2013
I. Liczba jednostek rozrachunkowych:			
1. na początek okresu sprawozdawczego		3 813,93821	3 470,91076
2. na koniec okresu sprawozdawczego		3 470,91076	1 947,42924
II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):			
1. na początek okresu sprawozdawczego		458,93829	480,60904
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		453,58373	480,60904
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		511,42186	606,31020
4. na koniec okresu sprawozdawczego		480,60904	600,26444

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 123 894,36	96,14%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
1.1.	obligacje	0,00	0,00%
1.2.	bony skarbowe	0,00	0,00%
1.3.	Inne	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%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
3.2.	pozostałe	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
4.1.	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
4.2.	pozostałe	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	1 123 894,36	96,14%
6.1.	jednostki uczestnictwa	1 123 894,36	96,14%
6.2.	certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00%
6.2.1.	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0,00	0,00%
6.2.2.	innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00%
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
7.1.	opcje	0,00	0,00%
7.2.	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
7.3.	swapy walutowe	0,00	0,00%
7.4.	swapy procentowe	0,00	0,00%
7.5.	inne instrumenty pochodne	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
9.1.	zabezpieczone hipotecznie	0,00	0,00%
9.2.	zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej	0,00	0,00%
9.3.	pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0,00	0,00%
9.4.	inne pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty banków	0,00	0,00%
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	54 035,28	4,62%
IV.	Należności	102,81	0,01%
V.	Zobowiązania	9 059,93	0,78%
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 168 972,52	100,00%
1	krajowe	45 078,16	3,86%
2	zagraniczne - kraje UE	1 123 894,36	96,14%
3	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%

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

Sprawozdanie zostało sporządzone dnia 12.07.2014 roku.