

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2015 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy NN (L) European High Dividend

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	stan na dzień 31.12.2014	stan na dzień 31.12.2015
I. Aktywa		1 205 040,40	1 104 532,21
1.	lokaty	1 146 502,18	1 085 447,26
2.	środki pieniężne	58 538,22	18 852,02
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	0,00	232,93
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
4.2.	pozostałe	0,00	232,93
II. Zobowiązania		8 185,20	25 174,12
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	916,78	23 964,71
3.	pozostałe	7 268,42	1 209,41
III. Aktywa netto (I-II)		1 196 855,20	1 079 358,09

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	za okres 01.01.2014- 31.12.2014	za okres 01.01.2015- 31.12.2015
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego		1 588 891,99	1 196 855,20
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-483 908,46	-178 191,09
I. Zwiększenia funduszu		0,00	23 770,75
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	0,00	0,00
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	23 770,75
II. Zmniejszenia funduszu		483 908,46	201 961,84
1.	tytułem wykupu	15 542,01	50 659,56
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	414 601,06	36 829,06
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	20 358,83	20 890,81
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	17 190,81	18 822,30
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	16 215,75	74 760,11
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		91 871,67	60 693,98
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		1 196 855,20	1 079 358,09

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

	Pozycja	za okres 01.01.2014- 31.12.2014	za okres 01.01.2015- 31.12.2015
I. Liczba jednostek rozrachunkowych:			
1.	na początek okresu sprawozdawczego	3 515,69446	2 490,71985
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	2 490,71985	2 181,08381
II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):			
1.	na początek okresu sprawozdawczego	451,94257	480,52582
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	443,67083	457,06854
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	499,05580	562,46092
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	480,52582	494,87236

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 085 447,26	100,56%
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	1 085 447,26	100,56%
6.1.	jednostki uczestnictwa	1 085 447,26	100,56%
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	18 852,02	1,75%
IV.	Należności	232,93	0,02%
V.	Zobowiązania	25 174,12	2,33%
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 079 358,09	100,00%
1	krajowe	-6 089,17	-0,56%
2	zagraniczne - kraje UE	1 085 447,26	100,56%
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 29.06.2016 roku.