

# PÓŁROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2015 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Portfel Dłużny

## I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

|                                                                                                                                  | (w zł) | stan na dzień<br>31.12.2014 | stan na dzień<br>31.12.2015 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>I. Aktywa</b>                                                                                                                 |        | <b>30 258 141,97</b>        | <b>31 454 044,25</b>        |
| 1. lokaty                                                                                                                        |        | 30 258 141,97               | 29 157 681,23               |
| 2. środki pieniężne                                                                                                              |        | 0,00                        | 2 057 904,53                |
| 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                        | 238 458,49                  |
| 4.1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym                                                                           |        | 0,00                        | 238 458,49                  |
| 4.2. pozostałe                                                                                                                   |        | 0,00                        | 0,00                        |
| <b>II. Zobowiązania</b>                                                                                                          |        | <b>430 448,75</b>           | <b>904 813,88</b>           |
| 1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym                                                                             |        | 0,00                        | 0,00                        |
| 2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia                                     |        | 1 221,01                    | 349 577,38                  |
| 3. pozostałe                                                                                                                     |        | 429 227,74                  | 555 236,50                  |
| <b>III. Aktywa netto (I-II)</b>                                                                                                  |        | <b>29 827 693,22</b>        | <b>30 549 230,37</b>        |

## II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

|                                                                                               | (w zł) | za okres<br>01.01.2014-<br>31.12.2014 | za okres<br>01.01.2015-<br>31.12.2015 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| <b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            |        | <b>0,00</b>                           | <b>29 827 693,22</b>                  |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>                                        |        | <b>29 699 798,95</b>                  | <b>471 496,08</b>                     |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>                                                                |        | <b>30 220 968,24</b>                  | <b>6 395 256,01</b>                   |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu                                            |        | 30 219 094,00                         | 3 112 000,00                          |
| 2. pozostałe przychody                                                                        |        | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 3. pozostałe zwiększenia                                                                      |        | 1 874,24                              | 3 283 256,01                          |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>                                                              |        | <b>521 169,29</b>                     | <b>5 923 759,93</b>                   |
| 1. tytułem wykupu                                                                             |        | 0,00                                  | 3 750 499,33                          |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     |        | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu           |        | 5 731,44                              | 34 548,94                             |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych                                                   |        | 373 040,97                            | 0,00                                  |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem |        | 62 333,24                             | 395 930,06                            |
| 6. pozostałe koszty                                                                           |        | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 7. pozostałe zmniejszenia                                                                     |        | 80 063,64                             | 1 742 781,60                          |
| <b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>                                            |        | <b>127 894,27</b>                     | <b>250 041,07</b>                     |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              |        | <b>29 827 693,22</b>                  | <b>30 549 230,37</b>                  |

## III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

|                                                                         | Pozycja | za okres<br>01.01.2014-<br>31.12.2014 | za okres<br>01.01.2015-<br>31.12.2015 |
|-------------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| <b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |         |                                       |                                       |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   |         | 0,00000                               | 297 264,21248                         |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     |         | 297 264,21248                         | 306 013,75113                         |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej</b>                             |         |                                       |                                       |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   |         | 0,00000                               | 100,34068                             |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  |         | 99,99658                              | 98,87072                              |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym |         | 100,38431                             | 101,08825                             |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     |         | 100,34068                             | 99,82960                              |

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — półroczne

|             |                                                                                                                                                            | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w zł) |
|-------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------|
|             | 1                                                                                                                                                          | 2                        | 3                                       |
| <b>I.</b>   | <b>Lokaty (suma 1-12)</b>                                                                                                                                  | <b>29 157 681,23</b>     | <b>95,44%</b>                           |
| 1.          | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 20 361 255,95            | 66,65%                                  |
| 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                                                                                                    | 3 787 677,09             | 12,40%                                  |
| 4.          | akcje                                                                                                                                                      | 0,00                     | 0,00%                                   |
| 5.          | udziały                                                                                                                                                    | 0,00                     | 0,00%                                   |
| 6.          | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych                                                                              | 4 291 802,81             | 14,05%                                  |
| 7.          | instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie 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                                                                                                                                           | 716 945,38               | 2,35%                                   |
| 12.         | pozostałe lokaty                                                                                                                                           | 0,00                     | 0,00%                                   |
| <b>II.</b>  | <b>Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r, o działalności ubezpieczeniowej</b>                        | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                            |
| <b>III.</b> | <b>Środki pieniężne</b>                                                                                                                                    | <b>2 057 904,53</b>      | <b>6,74%</b>                            |
| <b>IV.</b>  | <b>Należności</b>                                                                                                                                          | <b>238 458,49</b>        | <b>0,78%</b>                            |
| <b>V.</b>   | <b>Zobowiązania</b>                                                                                                                                        | <b>904 813,88</b>        | <b>2,96%</b>                            |
| <b>VI.</b>  | <b>Aktywa netto (w tym)</b>                                                                                                                                | <b>30 549 230,37</b>     | <b>100,00%</b>                          |
| 1.          | krajowe                                                                                                                                                    | 26 257 427,56            | 85,95%                                  |
| 2.          | zagraniczne - kraje UE                                                                                                                                     | 0,00                     | 0,00%                                   |
| 3.          | zagraniczne - kraje poza UE                                                                                                                                | 4 291 802,81             | 14,05%                                  |

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 09.02.2016 roku.