

ROCZNE 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 31.12.2014	stan na dzień 31.12.2015
I.	Aktywa	30 258 141,97	31 454 044,25
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
II.	Zobowiązania	430 448,75	904 813,88
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
III.	Aktywa netto (I-II)	29 827 693,22	30 549 230,37

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	0,00	29 827 693,22
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	29 699 798,95	471 496,08
I.	Zwiększenia funduszu	30 220 968,24	6 395 256,01
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
II.	Zmniejszenia funduszu	521 169,29	5 923 759,93
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
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	127 894,27	250 041,07
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	29 827 693,22	30 549 230,37

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	0,00000	297 264,21248
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	297 264,21248	306 013,75113
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
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

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	29 157 681,23	95,44%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	20 361 255,95	66,65%
1.1.	<i>obligacje</i>	20 361 255,95	66,65%
1.2.	<i>bony skarbowe</i>	0,00	0,00%
1.3.	<i>Inne</i>	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	3 787 677,09	12,40%
3.1.	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	3 787 677,09	12,40%
3.2.	<i>pozostałe</i>	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
4.1.	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	0,00	0,00%
4.2.	<i>pozostałe</i>	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%
6.1.	<i>jednostki uczestnictwa</i>	4 291 802,81	14,05%
6.2.	<i>certyfikaty inwestycyjne</i>	0,00	0,00%
6.2.1.	<i>funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i>	0,00	0,00%
6.2.2.	<i>innych funduszy inwestycyjnych</i>	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.	<i>opcje</i>	0,00	0,00%
7.2.	<i>kontrakty terminowe</i>	0,00	0,00%
7.3.	<i>swapy walutowe</i>	0,00	0,00%
7.4.	<i>swapy procentowe</i>	0,00	0,00%
7.5.	<i>inne instrumenty pochodne</i>	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
9.1.	<i>zabezpieczone hipotecznie</i>	0,00	0,00%
9.2.	<i>zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej</i>	0,00	0,00%
9.3.	<i>pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i>	0,00	0,00%
9.4.	<i>inne pożyczki</i>	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty banków	716 945,38	2,35%
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	2 057 904,53	6,74%
IV.	Należności	238 458,49	0,78%
V.	Zobowiązania	904 813,88	2,96%
VI.	Aktywa netto (w tym)	30 549 230,37	100,00%
1	<i>krajowe</i>	26 257 427,56	85,95%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	0,00	0,00%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	4 291 802,81	14,05%

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.