

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2016 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy Portfel Dłużny

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	stan na dzień 31.12.2015	stan na dzień 31.12.2016
I.	Aktywa	31 454 044,25	28 556 724,34
1.	lokaty	29 157 681,23	22 388 678,94
2	środki pieniężne	2 057 904,53	5 832 309,27
3.	należności	238 458,49	335 736,13
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	238 458,49	0,00
3.2.	pozostałe	0,00	335 736,13
II.	Zobowiązania	904 813,88	377 030,99
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	349 577,38	346 164,16
3	pozostałe	555 236,50	30 866,83
III.	Aktywa netto (I-II)	30 549 230,37	28 179 693,35

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	za okres 01.01.2015- 31.12.2015	za okres 01.01.2016- 31.12.2016
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	29 827 693,22	30 549 230,37
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	471 496,08	-3 110 933,30
I.	Zwiększenia funduszu	6 395 256,01	4 823 063,58
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	3 112 000,00	2 270 903,54
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	3 283 256,01	2 552 160,04
II.	Zmniejszenia funduszu	5 923 759,93	7 933 996,88
1.	tytułem wykupu	3 750 499,33	6 392 196,70
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	634 091,54
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	34 548,94	46 200,01
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	350 000,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	395 930,06	352 856,12
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	1 742 781,60	158 652,51
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	250 041,07	741 396,28
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	30 549 230,37	28 179 693,35

III. LICZBA i WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

	Pozycja	za okres 01.01.2015- 31.12.2015	za okres 01.01.2016- 31.12.2016
I.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	297 264,21248	306 013,75113
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	306 013,75113	279 057,92416
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	100,34068	99,82960
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	98,87072	99,46298
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	101,08825	101,91923
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	99,82960	100,98152

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	22 388 678,94	79,45%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	16 099 020,16	57,13%
1.1.	obligacje	16 099 020,16	57,13%
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	5 263 371,97	18,68%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	2 610 742,00	9,26%
3.2.	pozostałe	2 652 629,97	9,41%
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	0,00	0,00%
6.1.	jednostki uczestnictwa	0,00	0,00%
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	60 395,47	0,21%
7.1.	opcje	0,00	0,00%
7.2.	kontrakty terminowe	60 395,47	0,21%
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	965 891,34	3,43%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	5 832 309,27	20,70%
III.	Należności	335 736,13	1,19%
IV.	Zobowiązania	377 030,99	1,34%
V.	Aktywa netto (w tym)	28 179 693,35	100,00%
1.	krajowe	27 621 353,23	98,02%
2.	zagraniczne - kraje UE	558 340,12	1,98%
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.

Fundusz został utworzony dnia 26.08.2014 roku.

Sprawozdanie zostało sporządzone dnia 05.07.2017 roku.