

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2017 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy Portfel Dłużny

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		stan na dzień 31.12.2016	stan na dzień 31.12.2017
I.	Aktywa	28 556 724,34	21 386 231,44
1.	lokaty	22 388 678,94	21 336 300,46
2.	środki pieniężne	5 832 309,27	49 529,28
3.	należności	335 736,13	401,70
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	401,70
3.2.	pozostałe	335 736,13	0,00
II.	Zobowiązania	377 030,99	229 976,62
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	346 164,16	204 655,49
3.	pozostałe	30 866,83	25 321,13
III.	Aktywa netto (I-II)	28 179 693,35	21 156 254,82

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		za okres 01.01.2016 - 31.12.2016	za okres 01.01.2017 - 31.12.2017
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	30 549 230,37	28 179 693,35
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-3 110 933,30	-7 785 668,27
I.	Zwiększenia funduszu	4 823 063,58	2 940 797,58
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 270 903,54	2 940 000,00
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	2 552 160,04	797,58
II.	Zmniejszenia funduszu	7 933 996,88	10 726 465,85
1.	tytułem wykupu	6 392 196,70	2 203 057,04
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	634 091,54	244 973,46
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	46 200,01	18 575,51
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	350 000,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	352 856,12	276 062,60
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	158 652,51	7 983 797,24
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	741 396,28	762 229,74
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	28 179 693,35	21 156 254,82

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU

Pozycja		za okres 01.01.2016 - 31.12.2016	za okres 01.01.2017 - 31.12.2017
I.	Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	306 013,75113	279 057,92416
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	279 057,92416	204 886,96218
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	99,82960	100,98152
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	99,46298	100,59698
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	101,91923	103,33676
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	100,98152	103,25818

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	21 336 300,46	100,85%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	10 595 010,00	50,08%
1.1.	obligacje	10 595 010,00	50,08%
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	2 504 393,97	11,84%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	2 389 804,10	11,30%
3.2.	pozostałe	114 589,87	0,54%
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	7 800 583,00	36,87%
6.1.	jednostki uczestnictwa	7 800 583,00	36,87%
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	222 296,80	1,05%
7.1.	opcje	0,00	0,00%
7.2.	kontrakty terminowe	222 296,80	1,05%
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 bankowe	214 016,69	1,01%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	49 529,28	0,23%
III.	Należności	401,70	0,00%
IV.	Zobowiązania	229 976,62	1,09%
V.	Aktywa netto (w tym)	21 156 254,82	100,00%
1.	krajowe	13 355 671,82	63,13%
2.	zagraniczne - państwa UE	1 601 587,56	7,57%
3.	zagraniczne - państwa poza UE	6 198 995,44	29,30%

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 12.07.2018 roku.