

# ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2015 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy NN Selektywny

## I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

|      |                                                                                                                               | stan na dzień<br>31.12.2014 | stan na dzień<br>31.12.2015 |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| I.   | <b>Aktywa</b>                                                                                                                 | <b>5 906 187,27</b>         | <b>6 242 138,49</b>         |
| 1.   | lokaty                                                                                                                        | 5 887 781,77                | 6 208 138,13                |
| 2.   | środki pieniężne                                                                                                              | 0,00                        | 0,00                        |
| 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                                                                                                                    | 18 405,50                   | 34 000,36                   |
| 4.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym                                                                             | 0,00                        | 0,00                        |
| 4.2. | pozostałe                                                                                                                     | 18 405,50                   | 34 000,36                   |
| II.  | <b>Zobowiązania</b>                                                                                                           | <b>0,00</b>                 | <b>0,00</b>                 |
| 1.   | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym                                                                             | 0,00                        | 0,00                        |
| 2.   | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia                                     | 0,00                        | 0,00                        |
| 3.   | pozostałe                                                                                                                     | 0,00                        | 0,00                        |
| III. | <b>Aktywa netto (I-II)</b>                                                                                                    | <b>5 906 187,27</b>         | <b>6 242 138,49</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 |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| A.  | <b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            | <b>4 244 616,62</b>                   | <b>5 906 187,27</b>                   |
| B.  | <b>Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>                                        | <b>1 460 703,89</b>                   | <b>764 951,46</b>                     |
| I.  | <b>Zwiększenia funduszu</b>                                                                | <b>3 120 398,01</b>                   | <b>2 231 250,96</b>                   |
| 1.  | tytułem składek zwiększających wartość funduszu                                            | 3 098 972,08                          | 2 027 793,39                          |
| 2.  | pozostałe przychody                                                                        | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 3.  | pozostałe zwiększenia                                                                      | 21 425,93                             | 203 457,57                            |
| II. | <b>Zmniejszenia funduszu</b>                                                               | <b>1 659 694,12</b>                   | <b>1 466 299,50</b>                   |
| 1.  | tytułem wykupu                                                                             | 801 343,63                            | 834 091,95                            |
| 2.  | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     | 14 065,82                             | 15 591,00                             |
| 3.  | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu           | 59 654,01                             | 67 928,54                             |
| 4.  | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych                                                   | 163 504,30                            | 44 701,37                             |
| 5.  | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 6.  | pozostałe koszty                                                                           | 0,00                                  | 0,00                                  |
| 7.  | pozostałe zmniejszenia                                                                     | 621 126,36                            | 503 986,64                            |
| C.  | <b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>                                            | <b>200 866,76</b>                     | <b>-429 000,24</b>                    |
| D.  | <b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>5 906 187,27</b>                   | <b>6 242 138,49</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 |
|-----|----------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| I.  | <b>Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |                                       |                                       |
| 1.  | na początek okresu sprawozdawczego                                   | 59 707,64693                          | 79 942,97875                          |
| 2.  | na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 79 942,97875                          | 89 505,85733                          |
| II. | <b>Wartość jednostki rozrachunkowej</b>                              |                                       |                                       |
| 1.  | na początek okresu sprawozdawczego                                   | 71,09                                 | 73,88                                 |
| 2.  | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 68,78                                 | 66,29                                 |
| 3.  | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 78,09                                 | 82,39                                 |
| 4.  | na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 73,88                                 | 69,74                                 |

## V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

|             |                                                                                                                                                            | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|----------------------------------------|
| 1           |                                                                                                                                                            | 2                        | 3                                      |
| <b>I.</b>   | <b>Lokaty (suma 1-12)</b>                                                                                                                                  | <b>6 208 138,13</b>      | <b>99,46%</b>                          |
| 1.          | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 1.1.        | <i>obligacje</i>                                                                                                                                           | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 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                                                                                                    | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 3.1.        | <i>notowane na rynku regulowanym</i>                                                                                                                       | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 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                                                                              | 6 208 138,13             | 99,46%                                 |
| 6.1.        | <i>jednostki uczestnictwa</i>                                                                                                                              | 6 208 138,13             | 99,46%                                 |
| 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                                                                                                                                            | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 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>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>IV.</b>  | <b>Należności</b>                                                                                                                                          | <b>34 000,36</b>         | <b>0,54%</b>                           |
| <b>V.</b>   | <b>Zobowiązania</b>                                                                                                                                        | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>VI.</b>  | <b>Aktywa netto (w tym)</b>                                                                                                                                | <b>6 242 138,49</b>      | <b>100,00%</b>                         |
| 1           | <i>krajowe</i>                                                                                                                                             | 6 242 138,49             | 100,00%                                |
| 2           | <i>zagraniczne - kraje UE</i>                                                                                                                              | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 3           | <i>zagraniczne - kraje poza UE</i>                                                                                                                         | 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.