

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31.12.2015 ROKU

Nationale-Nederlanden Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Ubezpieczeniowy fundusz kapitałowy NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

	(w zł)	stan na dzień 31.12.2014	stan na dzień 31.12.2015
I. Aktywa		1 219 582,73	1 201 101,73
1. lokaty		1 213 247,88	1 187 290,89
2. środki pieniężne		6 213,54	11 788,08
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		121,31	2 022,76
4.1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
4.2. pozostałe		121,31	2 022,76
II. Zobowiązania		2 084,74	1 995,15
1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00	0,00
2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		530,32	530,22
3. pozostałe		1 554,42	1 464,93
III. Aktywa netto (I-II)		1 217 497,99	1 199 106,58

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		1 168 972,52	1 217 497,99
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-246 343,60	-142 327,35
I. Zwiększenia funduszu		0,00	15 216,94
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu		0,00	0,00
2. pozostałe przychody		0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia		0,00	15 216,94
II. Zmniejszenia funduszu		246 343,60	157 544,29
1. tytułem wykupu		49 423,40	56 078,88
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		166 709,10	64 008,28
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu		14 158,82	16 844,51
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		0,00	0,00
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem		15 795,80	19 940,53
6. pozostałe koszty		0,00	0,00
7. pozostałe zmniejszenia		256,48	672,09
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		294 869,07	123 935,94
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		1 217 497,99	1 199 106,58

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		1 947,42924	1 574,80617
2. na koniec okresu sprawozdawczego		1 574,80617	1 422,75088
II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):			
1. na początek okresu sprawozdawczego		600,26444	773,10974
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		583,75583	730,34028
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		787,58605	888,25983
4. na koniec okresu sprawozdawczego		773,10974	842,80853

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU — roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 187 290,89	99,01%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
1.1.	obligacje	0,00	0,00%
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	0,00	0,00%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
3.2.	pozostałe	0,00	0,00%
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	1 187 290,89	99,01%
6.1.	jednostki uczestnictwa	1 187 290,89	99,01%
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, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
7.1.	opcje	0,00	0,00%
7.2.	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
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	0,00	0,00%
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	11 788,08	0,98%
IV.	Należności	2 022,76	0,17%
V.	Zobowiązania	1 995,15	0,17%
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 199 106,58	100,00%
1	krajowe	11 815,69	0,99%
2	zagraniczne - kraje UE	1 187 290,89	99,01%
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.

Sprawozdanie zostało sporządzone dnia 29.06.2016 roku.