

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

**SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31 GRUDNIA 2016 ROKU**

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA  
Millennium Absolut Return

**I.**

**WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I. Aktywa</b>		<b>99 647 658</b>	<b>53 975 466</b>
1. lokaty		99 474 400	53 774 920
2. środki pieniężne		0	0
3. należności		173 258	200 546
3.1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		173 258	200 546
3.2. pozostałe		0	0
<b>II. Zobowiązania</b>		<b>621 915</b>	<b>243 255</b>
1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		621 915	243 255
2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		0	0
3. pozostałe		0	0
<b>III. Aktywa netto (I-II)</b>		<b>99 025 744</b>	<b>53 732 211</b>

**II.**

**ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>		<b>12 167 440</b>	<b>99 025 744</b>
<b>B. Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>		<b>85 101 001</b>	<b>-44 593 444</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>		<b>99 560 968</b>	<b>32 422 501</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu		31 342 138	8 586 380
2. pozostałe przychody		0	0
3. pozostałe zwiększenia		68 218 830	23 836 120
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>		<b>14 459 967</b>	<b>77 015 944</b>
1. tytułem wykupu		3 755 181	15 953 558
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		144 477	289 328
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu		28 447	164 256
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		0	0
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem		748 699	1 412 764
6. pozostałe koszty		0	0
7. pozostałe zmniejszenia		9 783 163	59 196 039
<b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>		<b>1 757 303</b>	<b>-700 090</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>		<b>99 025 744</b>	<b>53 732 211</b>

**III.**

**LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK uczestnictwa funduszu**

	Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I. Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:</b>			
1. na początek okresu sprawozdawczego		110 603,0393	835 801,3495
2. na koniec okresu sprawozdawczego		835 801,3495	457 217,5863
<b>II. Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>			
1. na początek okresu sprawozdawczego		110,0100	118,4800
2. minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym		109,9900	111,2600
3. maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym		119,9700	118,4800
4. na koniec okresu sprawozdawczego		118,4800	117,5200

**IV.**

**ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	<b>1</b>	<b>2</b>	<b>3</b>
<b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>		<b>53 774 920</b>	<b>100,08%</b>
1. papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska		0	0,00%
1.1 obligacje		0	0,00%
1.2 bony skarbowe		0	0,00%
1.3 inne		0	0,00%
2. obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0	0,00%
3. inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		0	0,00%
3.1 notowane na rynku regulowanym		0	0,00%
3.2 pozostałe		0	0,00%
4. akcje		0	0,00%
4.1 notowane na rynku regulowanym		0	0,00%
4.2 pozostałe		0	0,00%
5. udziały		0	0,00%
6. jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		53 774 920	100,08%
6.1 jednostki uczestnictwa		53 774 920	100,08%
6.2 certyfikaty inwestycyjne		0	0,00%
6.2.1 funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0	0,00%
6.2.2 innych funduszy inwestycyjnych		0	0,00%
7. instrumenty pochodne		0	0,00%
7.1 opcje		0	0,00%
7.2 kontrakty terminowe		0	0,00%
7.3 swapy walutowe		0	0,00%
7.4 swapy procentowe		0	0,00%
7.5 inne instrumenty pochodne		0	0,00%
8. inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		0	0,00%
9. pożyczki		0	0,00%
9.1 zabezpieczone hipotecznie		0	0,00%
9.2 zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		0	0,00%
9.3 pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0	0,00%
9.4 inne pożyczki		0	0,00%
10. nieruchomości		0	0,00%
11. depozyty bankowe		0	0,00%
12. pozostałe lokaty		0	0,00%
<b>II. Środki pieniężne</b>		<b>0</b>	<b>0,00%</b>
<b>III. Należności</b>		<b>200 546</b>	<b>0,37%</b>
<b>IV. Zobowiązania</b>		<b>243 255</b>	<b>0,45%</b>
<b>V. Aktywa netto (w tym)</b>		<b>53 732 211</b>	<b>100,00%</b>
1. krajowe		53 732 211	100,00%
2. zagraniczne - państwa UE		0	0,00%
3. zagraniczne - państwa poza UE		0	0,00%

Warszawa, 13 lipca 2017 roku