

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO
SPORZĄDZONE NA DZIEŃ 31 GRUDNIA 2017 ROKU

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
Franklin K2 Alternative Strategies Fund

I.
WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	1 584 026	10 035 523
1.	lokaty	1 584 026	10 035 523
2.	środki pieniężne	0	0
3.	należności	0	0
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0	0
3.2.	pozostałe	0	0
II.	Zobowiązania	2 052	17 471
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	2 052	17 471
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0	0
3.	pozostałe	0	0
III.	Aktywa netto (I-II)	1 581 974	10 018 052

II.
ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	0	1 581 974
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	1 548 092	8 201 759
I.	Zwiększenia funduszu	1 579 533	10 818 265
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	1 280 557	9 477 137
2.	pozostałe przychody	0	0
3.	pozostałe zwiększenia	298 975	1 341 128
II.	Zmniejszenia funduszu	31 441	2 616 506
1.	tytułem wykupu	0	339 403
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0	0
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	419	3 738
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0	0
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	10 358	118 508
6.	pozostałe koszty	0	0
7.	pozostałe zmniejszenia	20 665	2 154 857
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	33 882	234 319
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	1 581 974	10 018 052

III.
LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK uczestnictwa funduszu

Pozycja		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I.	Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	0,0000	157 253,8767
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	157 253,8767	957 748,7753
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	nd	10,0600
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	9,3100	10,0600
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	10,0900	10,4800
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	10,0600	10,4600

IV.
ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	10 035 523	100,17%
	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0	0,00%
1.		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	10 035 523	100,17%
6.1	jednostki uczestnictwa	10 035 523	100,17%
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%
II.	Środki pieniężne	0	0,00%
III.	Należności	0	0,00%
IV.	Zobowiązania	17 471	0,17%
V.	Aktywa netto (w tym)	10 018 052	100,00%
1.	krajowe	0	0,00%
2.	zagraniczne - państwa UE	10 018 052	100,00%
3.	zagraniczne - państwa poza UE	0	0,00%

Warszawa, 12 lipca 2018 roku