

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

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
Franklin K2 Alternative Strategies Fund (EUR)

I.
WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	80 249	1 760 950
1.	lokaty	80 249	1 760 950
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	141	2 882
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	141	2 882
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0	0
3.	pozostałe	0	0
III.	Aktywa netto (I-II)	80 108	1 758 069

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	80 108
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	76 909	1 692 630
I.	Zwiększenia funduszu	79 028	1 898 913
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	78 283	1 773 790
2.	pozostałe przychody	0	0
3.	pozostałe zwiększenia	744	125 122
II.	Zmniejszenia funduszu	2 118	206 283
1.	tytułem wykupu	0	0
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0	0
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	42	414
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0	0
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	654	16 288
6.	pozostałe koszty	0	0
7.	pozostałe zmniejszenia	1 423	189 581
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	3 198	-14 669
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	80 108	1 758 069

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	1 763,1480
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 763,1480	40 147,7175
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	nd	45,4345
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	42,3203	43,6600
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	46,0708	45,4200
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	45,4345	43,7900

IV.
ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 760 950	100,16%
	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	1 760 950	100,16%
6.1	jednostki uczestnictwa	1 760 950	100,16%
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	2 882	0,16%
V.	Aktywa netto (w tym)	1 758 069	100,00%
1.	krajowe	0	0,00%
2.	zagraniczne - państwa UE	1 758 069	100,00%
3.	zagraniczne - państwa poza UE	0	0,00%

Warszawa, 12 lipca 2018 roku