

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

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
BGF Fixed Income Global Opportunities Hedged

I.
WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	62 595 950	85 334 497
1.	lokaty	62 533 427	85 160 234
2.	środki pieniężne	0	0
3.	należności	62 523	174 263
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	62 523	174 263
3.2.	pozostałe	0	0
II.	Zobowiązania	373 880	393 974
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	373 880	393 974
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0	0
3.	pozostałe	0	0
III.	Aktywa netto (I-II)	62 222 069	84 940 523

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	91 467 252	62 222 069
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	-32 334 447	19 811 248
I.	Zwiększenia funduszu	15 554 367	58 056 677
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	5 745 584	37 281 513
2.	pozostałe przychody	0	0
3.	pozostałe zwiększenia	9 808 783	20 775 164
II.	Zmniejszenia funduszu	47 888 814	38 245 429
1.	tytułem wykupu	17 561 774	20 806 300
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	513 318	300 896
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	104 252	64 473
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0	0
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	1 293 440	1 443 965
6.	pozostałe koszty	0	0
7.	pozostałe zmniejszenia	28 416 030	15 629 795
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	3 089 264	2 907 206
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	62 222 069	84 940 523

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	6 356 306,6081	4 192 861,8046
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	4 192 861,8046	5 504 894,5671
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	14,3900	14,8400
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	14,1700	14,8500
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	14,8500	15,4400
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	14,8400	15,4300

IV.
ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	85 160 234	100,26%
	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	85 160 234	100,26%
6.1	jednostki uczestnictwa	85 160 234	100,26%
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	174 263	0,21%
IV.	Zobowiązania	393 974	0,46%
V.	Aktywa netto (w tym)	84 940 523	100,00%
1.	krajowe	0	0,00%
2.	zagraniczne - państwa UE	84 940 523	100,00%
3.	zagraniczne - państwa poza UE	0	0,00%

Warszawa, 12 lipca 2018 roku