

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2015**

Nazwa zakładu ubezpieczeń BZ WBK-Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego UFK Aviva Investors Obligacji

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU UFK Aviva Investors Obligacji

| (w zł) | | Koniec okresu poprzedniego | Koniec okresu bieżącego |
|---|--|-------------------------------|----------------------------|
| I. Aktywa | | 45 173 688,05 | 33 244 828,14 |
| 1. Lokaty | | 45 173 688,05 | 33 244 828,14 |
| 2. Środki pieniężne | | 0,00 | 0,00 |
| 3. Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | | 0,00 | 0,00 |
| 4. Należności | | 0,00 | 0,00 |
| 4.1. Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | | 0,00 | 0,00 |
| 4.2. Pozostałe należności | | 0,00 | 0,00 |
| II. Zobowiązania | | 0,00 | 0,00 |
| 1. Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | | 0,00 | 0,00 |
| 2. Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | | 0,00 | 0,00 |
| 3. Pozostałe zobowiązania | | 0,00 | 0,00 |
| III. Aktywa netto (I-II) | | 45 173 688,05 | 33 244 828,14 |

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU UFK Aviva Investors Obligacji

| (w zł) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|---|--|-----------------------|-----------------------|
| A. Aktywa netto funduszu na początek okresu | | 57 616 680,87 | 45 173 688,05 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | | -13 377 214,03 | -10 686 990,98 |
| I. Zwiększenia funduszu | | 5 307 890,07 | 2 749 226,67 |
| 1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | | 5 307 890,07 | 2 749 226,67 |
| 2. Pozostałe przychody | | 0,00 | 0,00 |
| 3. Pozostałe zwiększenia | | 0,00 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | | 18 685 104,10 | 13 435 317,65 |
| 1. Tytułem wykupu | | 17 886 216,00 | 12 795 841,16 |
| 2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | | 0,00 | 0,00 |
| 3. Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | | 0,00 | 0,00 |
| 4. Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | | 0,00 | 0,00 |
| 5. Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | | 798 687,37 | 639 135,44 |
| 6. Pozostałe koszty | | 0,00 | 0,00 |
| 7. Pozostałe zmniejszenia | | 200,73 | 341,05 |
| C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej | | 934 221,21 | -1 242 768,93 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | | 45 173 688,05 | 33 244 828,14 |

0,00
0,00

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH UFK Aviva Investors Obligacji

| Pozycja | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--|-----------------|---------------|
| 1. Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1.1 liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 272 316,29 | 201 416,48 |
| 1.2 liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 201 416,48 | |
| 2. Wartość jednostki rozrachunkowej: | | |
| 2.1 wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 211,58 | 224,28 |
| 2.2 minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 209,06 | 220,84 |
| 2.3 maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 225,65 | 227,51 |
| 2.4 wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 224,28 | 224,24 |

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

| | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|---|-----------------------------|--|
| I. Lokaty (suma 1-12) | 33 244 828,14 | 3,00 |
| 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 Akcje notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00% |
| 4.2 Pozostałe akcje | 0,00 | 0,00% |
| 5. Udziały | 0,00 | 0,00% |
| 6. Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 33 244 828,14 | 100,00% |
| 6.1 Jednostki uczestnictwa | | 0,00% |
| 6.2 Certyfikaty inwestycyjne | 33 244 828,14 | 0,00% |
| 6.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | | 0,00% |
| 6.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych | 33 244 828,14 | 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 Śwapy walutowe | 0,00 | 0,00% |
| 7.4 Śwapy 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 Pożyczki 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 bankowe | 0,00 | 0,00% |
| 12. Pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | 0,00 | 0,00% |
| III. Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| IV. Należności | 0,00 | 0,00% |
| V. Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| VI. Aktywa netto (w tym) | 33 244 828,14 | 100,00% |
| 1 krajowe | 33 244 828,14 | 100,00% |
| 2 zagraniczne - kraje UE | 0,00 | 0,00% |
| 3 zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |