

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31 grudnia 2017

UFK East Capital Akcji Rosyjskich typu E pro
PKO Życie Towarzystwo Ubezpieczeń SA

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|--|---|
| I. | Aktywa | 172 532,36 | 89 178,80 |
| 1. | lokaty | 172 532,36 | 89 178,80 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 0,00 | 0,00 |
| 3.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 172 532,36 | 89 178,80 |

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 | 123 108,55 | 172 532,36 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | -12 296,38 | -70 355,44 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 74 653,02 | 65 809,36 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 12 535,94 | 15 433,62 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 62 117,08 | 50 375,74 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 86 949,40 | 136 164,80 |
| 1. | tytułem wykupu | 0,00 | 0,00 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 15 444,29 | 3 412,25 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 4. | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 19 868,50 | 11 490,66 |
| 5. | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00 | 0,00 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 51 636,61 | 121 261,89 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 61 720,19 | -12 998,12 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 172 532,36 | 89 178,80 |

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 | 21 905,4359 | 17 786,8412 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 17 786,8412 | 10 133,9545 |
| II. | Wartość jednostki uczestnictwa: | | |
| 1. | wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 5,62 | 9,70 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 4,92 | 7,97 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 9,71 | 10,03 |
| 4. | wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 9,70 | 8,80 |

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

| 1 | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|--------------------------|--|
| | | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 89 178,80 | 100,00% |
| 1. | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 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% |
| 4. | akcje | 0,00 | 0,00% |
| 5. | udziały | 0,00 | 0,00% |
| 6. | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 89 178,80 | 100,00% |
| 7. | instrumenty pochodne | 0,00 | 0,00% |
| 8. | inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu | 0,00 | 0,00% |
| 9. | 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. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 89 178,80 | 100,00% |
| 1 | <i>krajowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 2 | <i>zagraniczne - państwa UE</i> | 89 178,80 | 100,00% |
| 3 | <i>zagraniczne - państwa poza UE</i> | 0,00 | 0,00% |

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|-----------------------------|---|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 89 178,80 | 100,00% |
| 1. | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 0,00 | 0,00% |
| 1.1 | <i>obligacje</i> | 0,00 | 0,00% |
| 1.2 | <i>bony skarbowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 1.3 | <i>inne</i> | 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 | <i>notowane na rynku regulowanym</i> | 0,00 | 0,00% |
| 3.2 | <i>pozostałe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 4. | akcje | 0,00 | 0,00% |
| 4.1 | <i>notowane na rynku regulowanym</i> | 0,00 | 0,00% |
| 4.2 | <i>pozostałe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 5. | udziały | 0,00 | 0,00% |
| 6. | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 89 178,80 | 100,00% |
| 6.1 | <i>jednostki uczestnictwa</i> | 89 178,80 | 100,00% |
| 6.2 | <i>certyfikaty inwestycyjne</i> | 0,00 | 0,00% |
| 6.2.1 | <i>funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i> | 0,00 | 0,00% |
| 6.2.2 | <i>innych funduszy inwestycyjnych</i> | 0,00 | 0,00% |
| 7. | instrumenty pochodne | 0,00 | 0,00% |
| 7.1 | <i>opcje</i> | 0,00 | 0,00% |
| 7.2 | <i>kontrakty terminowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 7.3 | <i>swapy walutowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 7.4 | <i>swapy procentowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 7.5 | <i>inne instrumenty pochodne</i> | 0,00 | 0,00% |
| 8. | inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu | 0,00 | 0,00% |
| 9. | pożyczki | 0,00 | 0,00% |
| 9.1 | <i>zabezpieczone hipotecznie</i> | 0,00 | 0,00% |
| 9.2 | <i>zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej</i> | 0,00 | 0,00% |
| 9.3 | <i>pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i> | 0,00 | 0,00% |
| 9.4 | <i>inne pożyczki</i> | 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. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 89 178,80 | 100,00% |
| 1 | <i>krajowe</i> | 0,00 | 0,00% |
| 2 | <i>zagraniczne - państwa UE</i> | 89 178,80 | 100,00% |
| 3 | <i>zagraniczne - państwa poza UE</i> | 0,00 | 0,00% |