

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2019 roku**

UFK Fidelity Zrównoważony Obligacji Strategicznych (PLN H) 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 | 1 846 458,01 | 3 181 836,60 |
| 1. | lokaty | 1 846 458,01 | 3 181 836,60 |
| 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) | 1 846 458,01 | 3 181 836,60 |

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 | 2 115 323,67 | 1 846 458,01 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | -211 509,86 | 1 141 610,24 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 664 768,12 | 1 898 203,00 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 29 423,77 | 48 354,64 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 635 344,35 | 1 849 848,36 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 876 277,98 | 756 592,76 |
| 1. | tytułem wykupu | 731 169,45 | 401 011,69 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych 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 | 36 401,36 | 46 070,70 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 108 707,17 | 309 510,37 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | -57 355,80 | 193 768,35 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 1 846 458,01 | 3 181 836,60 |

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 | 177 609,0403 | 159 452,3325 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 159 452,3325 | 257 847,3744 |
| II. | Wartość jednostki jednostki uczestnictwa: | | |
| 1. | wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 11,91 | 11,58 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 11,48 | 11,57 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 11,94 | 12,61 |
| 4. | wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 11,58 | 12,34 |

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|--------------------------|--|
| 1 | | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 3 181 836,60 | 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 | 3 181 836,60 | 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) | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 1 | krajowe | 0,00 | 0,00% |
| 2 | zagraniczne - państwa UE | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 3 | zagraniczne - państwa poza UE | 0,00 | 0,00% |

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

| | | Wartość bilansowa zł) (w | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|-----------------------------|---|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 3 181 836,60 | 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 | 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 | notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00% |
| 4.2 | pozostałe | 0,00 | 0,00% |
| 5. | udziały | 0,00 | 0,00% |
| 6. | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 6.1 | jednostki uczestnictwa | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 6.2 | certyfikaty inwestycyjne | 0,00 | 0,00% |
| 6.2.1 | funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | 0,00 | 0,00% |
| 6.2.2 | innych funduszy inwestycyjnych | 0,00 | 0,00% |
| 7. | instrumenty pochodne | 0,00 | 0,00% |
| 7.1 | opcje | 0,00 | 0,00% |
| 7.2 | kontrakty terminowe | 0,00 | 0,00% |
| 7.3 | swapy walutowe | 0,00 | 0,00% |
| 7.4 | swapy 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 | 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. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 1 | krajowe | 0,00 | 0,00% |
| 2 | zagraniczne - państwa UE | 3 181 836,60 | 100,00% |
| 3 | zagraniczne - państwa poza UE | 0,00 | 0,00% |