

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

UFK Krajowy Fundusz Instrumentów Dłużnych 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	9 364 219,65	9 158 261,93
1.	lokaty	9 364 219,65	9 158 261,93
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	16 688,43	16 391,30
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	16 688,43	16 391,30
III.	Aktywa netto (I-II)	9 347 531,22	9 141 870,63

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	9 612 467,49	9 347 531,22
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	-544 696,05	-393 378,13
I.	Zwiększenia funduszu	1 130 310,82	977 778,28
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	638 288,50	587 365,68
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	492 022,32	390 412,60
II.	Zmniejszenia funduszu	1 675 006,87	1 371 156,41
1.	tytułem wykupu	828 826,63	608 966,72
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	21 251,66	25 630,37
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	192 839,09	187 695,68
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	16 688,43	113 612,36
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	615 401,06	435 251,28
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	279 759,78	187 717,54
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	9 347 531,22	9 141 870,63

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	409 738,5972	395 077,3973
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	395 077,3973	386 221,8264
II.	Wartość jednostki jednostki uczestnictwa:		
1.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego	23,46	23,66
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	23,35	23,59
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	23,67	23,71
4.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	23,66	23,67

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	9 158 261,93	100,18%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	8 036 756,73	87,91%
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	0,00	0,00%
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	1 121 505,20	12,27%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
III.	Należności	0,00	0,00%
VI.	Zobowiązania	16 391,30	0,18%
V.	Aktywa netto (w tym)	9 141 870,63	100,00%
1	krajowe	9 141 870,63	100,00%
2	zagraniczne - państwa UE	0,00	0,00%
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)	9 158 261,93	100,18%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	8 036 756,73	87,91%
1.1	obligacje	8 036 756,73	87,91%
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	0,00	0,00%
6.1	jednostki uczestnictwa	0,00	0,00%
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	1 121 505,20	12,27%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
III.	Należności	0,00	0,00%
VI.	Zobowiązania	16 391,30	0,18%
V.	Aktywa netto (w tym)	9 141 870,63	100,00%
1	krajowe	9 141 870,63	100,00%
2	zagraniczne - państwa UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	0,00	0,00%