

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

UFK Nordea Europejskich Papierów Dłużnych Wysokiej Rentowności typu E prc
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	1 063 399,33	1 658 667,12
1.	lokaty	1 063 399,33	1 658 667,12
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)	1 063 399,33	1 658 667,12

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	756 447,48	1 063 399,33
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	313 586,26	444 806,94
I.	Zwiększenia funduszu	619 964,84	611 561,42
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	547 556,19	571 606,99
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	72 408,65	39 954,43
II.	Zmniejszenia funduszu	306 378,58	166 754,48
1.	tytułem wykupu	0,00	0,00
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	207 631,47	71 535,68
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	0,00	0,00
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	17 872,98	13 396,93
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	-65,62
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	80 874,13	81 887,49
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-6 634,41	150 460,85
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	1 063 399,33	1 658 667,12

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	48 490,2231	68 650,6992
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	68 650,6992	100 769,5699
II.	Wartość jednostki jednostki uczestnictwa:		
1.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego	15,60	15,49
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	15,42	15,39
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	16,18	17,16
4.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	15,49	16,46

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 658 667,12	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	1 658 667,12	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)	1 658 667,12	100,00%
1	krajowe	0,00	0,00%
2	zagraniczne - państwa UE	1 658 667,12	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)	1 658 667,12	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	1 658 667,12	100,00%
6.1	jednostki uczestnictwa	1 658 667,12	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)	1 658 667,12	100,00%
1	krajowe	0,00	0,00%
2	zagraniczne - państwa UE	1 658 667,12	100,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	0,00	0,00%