

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

UFK Strategia Zrównoważona 55 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	70 348 337,77	65 590 755,07
1.	lokaty	70 270 001,52	65 578 317,41
2.	środki pieniężne	78 336,25	12 405,01
3.	należności	0,00	32,65
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	0,00	32,65
II.	Zobowiązania	0,00	9 568,15
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	9 568,15
III.	Aktywa netto (I-II)	70 348 337,77	65 581 186,92

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	85 767 805,55	70 348 337,77
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	-12 871 585,81	-9 069 100,83
I.	Zwiększenia funduszu	1 626 095,90	1 471 986,57
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	1 569 389,61	1 377 680,00
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	56 706,29	94 306,57
II.	Zmniejszenia funduszu	14 497 681,71	10 541 087,40
1.	tytułem wykupu	10 962 592,22	7 558 448,22
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	3 030 326,20	2 671 311,89
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	504 763,29	311 327,29
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-2 547 881,97	4 301 949,98
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	70 348 337,77	65 581 186,92

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	7 059 078,6461	5 987 092,5762
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	5 987 092,5762	5 310 217,5644
II.	Wartość jednostki jednostki uczestnictwa:		
1.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na początek okresu sprawozdawczego	12,15	11,75
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	11,60	11,71
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	12,59	12,56
4.	wartość jednostki uczestnictwa funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	11,75	12,35

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	65 578 317,41	100,00%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	5 373 896,43	8,19%
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	1 347 152,11	2,05%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	50 591 728,68	77,14%
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	8 265 540,19	12,60%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	12 405,01	0,02%
III.	Należności	32,65	0,00%
VI.	Zobowiązania	9 568,15	0,01%
V.	Aktywa netto (w tym)	65 581 186,92	100,00%
1	krajowe	65 568 244,66	99,98%
2	zagraniczne - państwa UE	2 429,36	0,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	10 512,90	0,02%

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

		Wartość bilansowa zł) (w	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	65 578 317,41	100,00%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	5 373 896,43	8,19%
1.1	obligacje	5 373 896,43	8,19%
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	1 347 152,11	2,05%
4.1	notowane na rynku regulowanym	1 347 152,11	2,05%
4.2	pozostałe	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	50 591 728,68	77,14%
6.1	jednostki uczestnictwa	50 591 728,68	77,14%
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	8 265 540,19	12,60%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	12 405,01	0,02%
III.	Należności	32,65	0,00%
VI.	Zobowiązania	9 568,15	0,01%
V.	Aktywa netto (w tym)	65 581 186,92	100,00%
1	krajowe	65 568 244,66	99,98%
2	zagraniczne - państwa UE	2 429,36	0,00%
3	zagraniczne - państwa poza UE	10 512,90	0,02%