

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2017

BZ WBK-Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Arka Prestiż Obligacji Skarbowych

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec okresu poprzedniego 31/12/2016	Koniec okresu bieżącego 31/12/2017
I. Aktywa		104 083 035.38	68 790 819.13
1. Lokaty		104 083 035.38	68 790 819.13
2. Środki pieniężne		0.00	0.00
3. Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		0.00	0.00
4. Należności		0.00	0.00
4.1. Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0.00	0.00
4.2. Pozostałe należności		0.00	0.00
II. Zobowiązania		0.00	0.00
1. Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0.00	0.00
2. Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		0.00	0.00
3. Pozostałe zobowiązania		0.00	0.00
III. Aktywa netto (I-II)		104 083 035.38	68 790 819.13

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni 31/12/2016	Okres bieżący 31/12/2017
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu		123 423 940.13	104 083 035.38
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-16 193 508.81	-34 941 601.52
I. Zwiększenia funduszu		5 857 544.60	5 020 760.27
1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu		5 857 544.60	5 020 760.27
2. Pozostałe przychody		0.00	0.00
3. Pozostałe zwiększenia		0.00	0.00
II. Zmniejszenia funduszu		22 051 053.41	39 962 361.79
1. Tytułem wykupu		20 131 253.14	38 612 890.00
2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		0.00	0.00
3. Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych 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		1 920 044.91	1 348 070.65
6. Pozostałe koszty		0.00	0.00
7. Pozostałe zmniejszenia		-244.64	1 401.14
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		-3 147 395.94	-350 614.73
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		104 083 035.38	68 790 819.13

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni 31/12/2016	Okres bieżący 31/12/2017
1. Liczba jednostek rozrachunkowych:			
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	93 595.162000	79 546.211105
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	79 546.211105	50 269.150600
2. Wartość jednostki rozrachunkowej:			
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	1 318.70	1 308.46
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1 298.87	1 299.67
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1 352.91	1 369.68
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	1 308.46	1 368.45

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I. Lokaty (suma 1-12)		68 790 819.13	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	Akcje notowane na rynku regulowanym	0.00	0.00%
4.2	Pozostałe akcje	0.00	0.00%
5.	Udziały	0.00	0.00%
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	68 790 819.13	100.00%
6.1	Jednostki uczestnictwa	68 790 819.13	100.00%
6.2	Certyfikaty inwestycyjne	0.00	0.00%
6.2.1	Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0.00	0.00%
6.2.2	Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych	0.00	0.00%
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	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	Pożyczki 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. Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		0.00	0.00%
III. Środki pieniężne		0.00	0.00%
IV. Należności		0.00	0.00%
V. Zobowiązania		0.00	0.00%
VI. Aktywa netto (w tym)		68 790 819.13	100.00%
1	krajowe	68 790 819.13	100.00%
2	zagraniczne - kraje UE	0.00	0.00%
3	zagraniczne - kraje poza UE	0.00	0.00%