

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2015**

Nazwa zakładu ubezpieczeń BZ WBK-Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego UFK Legg Mason Senior

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU UFK Legg Mason Senior

(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I. Aktywa		16 531 772,68	10 340 844,79
1. Lokaty		16 531 772,68	10 340 844,79
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)		16 531 772,68	10 340 844,79

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU UFK Legg Mason Senior

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu		16 845 572,17	16 531 772,68
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		-504 788,58	-5 479 867,14
I. Zwiększenia funduszu		5 071 816,63	379 093,89
1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu		4 438 893,29	378 719,33
2. Pozostałe przychody		0,00	0,00
3. Pozostałe zwiększenia		632 923,34	374,56
II. Zmniejszenia funduszu		5 576 605,21	5 858 961,03
1. Tytułem wykupu		4 650 418,60	5 653 902,44
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		926 186,61	205 058,59
6. Pozostałe koszty		0,00	0,00
7. Pozostałe zmniejszenia		0,00	0,00
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej		190 989,09	-711 060,75
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego		16 531 772,68	10 340 844,79

0,00
0,00

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH UFK Legg Mason Senior

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1. Liczba jednostek rozrachunkowych:			
1.1 liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego		58 719,93	56 503,43
1.2 liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego		56 503,43	37 133,17
2. Wartość jednostki rozrachunkowej:			
2.1 wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego		286,88	292,58
2.2 minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		284,15	274,55
2.3 maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		296,20	297,83
2.4 wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego		292,58	278,48

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2,00	3,00
I. Lokaty (suma 1-12)		10 340 844,79	0,00
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		10 340 844,79	100,00%
6.1 Jednostki uczestnictwa		0,00	0,00%
6.2 Certyfikaty inwestycyjne		10 340 844,79	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		10 340 844,79	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 Śwapy walutowe		0,00	0,00%
7.4 Śwapy 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. Należności		0,00	0,00%
IV. Zobowiązania		0,00	0,00%
VI. Aktywa netto (w tym)		10 340 844,79	100,00%
1 krajowe		10 340 844,79	100,00%
2 zagraniczne - kraje UE		0,00	0,00%
3 zagraniczne - kraje poza UE		0,00	0,00%