

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2011

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	16 419 560.15	16 514 016.90
1. Lokaty	16 096 420.92	16 492 980.64
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	323 139.23	21 036.25
4.1. Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0.00	0.00
4.2. Pozostałe należności	323 139.23	21 036.25
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)	16 419 560.15	16 514 016.90

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU UFK Legg Mason Senior

(w zł)	Okres poprzedni	Okres bieżący
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu	580 975.95	16 419 560.15
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	15 804 434.55	860 072.35
I. Zwiększenia funduszu	15 961 676.30	20 026 633.88
1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	15 961 676.30	20 012 097.27
2. Pozostałe przychody	0.00	0.00
3. Pozostałe zwiększenia	0.00	14 536.41
II. Zmniejszenia funduszu	157 241.75	19 166 561.33
1. Tytułem wwkupu	91 239.25	19 021 546.38
2. Tytułem wydatków pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0.00	0.00
3. Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącających 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	51 436.68	145 014.95
6. Pozostałe koszty	0.00	0.00
7. Pozostałe zmniejszenia	14 565.82	0.00
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej	34 149.65	-765 615.60
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	16 419 560.15	16 514 016.90

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	2 105.692923	59 288.724233
1.2. liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	59 288.724233	63 918.099369
2. Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1. wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	266.09	269.68
2.2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	263.93	255.11
2.3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	271.03	270.44
2.4. wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	269.68	257.94

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - Roczne UFK Legg Mason Senior

	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1	2	3
I. Lokaty (suma 1-12)	16 492 980.64	
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	16 487 034.55	99.84%
6.1. Jednostki uczestnictwa	16 487 034.55	99.84%
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 pasywny 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	5 946.09	0.04%
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	21 036.25	0.13%
V. Zobowiązania	0.00	0.00%
VI. Aktywa netto (w tym)	16 514 016.90	100.00%
1. Krajowe	16 514 016.90	100.00%
2. zagraniczne - kraje UE	0.00	0.00%
3. zagraniczne - kraje poza UE	0.00	0.00%