

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 2006-12-31

Nordea Polska Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Zrównoważony typu E

I AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I	Aktywa	222 537,06	484 350,86
1.	Lokaty	222 537,06	484 350,86
2.	Środki pieniężne	0,00	0,00
3.	Należności, w tym	0,00	0,00
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	0,00	0,00
3.2	Pozostałe należności	0,00	0,00
4.	Pozostałe aktywa	0,00	0,00
II	Zobowiązania	0,00	0,00
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	0,00	0,00
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	Pozostałe zobowiązania	0,00	0,00
III	Aktywa netto (I-II)	222 537,06	484 350,86

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 2006-12-31

Nordea Polska Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Zrównoważony typu E

II ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początku okresu	37 259,92	222 537,06
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	156 845,06	192 299,52
L.	Zwiększenie funduszu	175 344,91	251 645,64
1.	Tytułem składki zwiększających wartość funduszu	168 210,99	249 493,67
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0,00	0,00
3.	Pozostałe zwiększenia	7 133,92	2 151,97
II.	Zmniejszenia funduszu	18 499,85	59 346,12
1.	Tytułem wykupu	1 858,88	2 961,17
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	0,00	199,10
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	Tytułem prowizji od składek	0,00	0,00
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0,00	0,00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	36,86	-277,02
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0,00	0,00
9.	Pozostałe zmniejszenia	16 604,11	56 462,97
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	28 432,08	69 514,28
1.	z papierów wartościowych emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	4 078,91	8 570,42
2.	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00
3.	z listów zastawnych	0,00	0,00
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	1 236,44	0,00
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00
6.	z akcji	22 864,31	58 105,41
7.	z udziałów	0,00	0,00
8.	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	0,00	0,00
9.	z instrumentów pochodnych, o ile służyły zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerwy techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00
10.	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00
11.	z pożyczek	0,00	0,00
12.	z nieruchomości	0,00	0,00
13.	z depozytów banków	852,42	2 838,45
14.	z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00
D.	Pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
E.	Pozostałe zmniejszenia	0,00	0,00
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	222 537,06	484 350,86

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 2006-12-31

Nordea Polska Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Zrównoważony typu E

III KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	0,00	0,00
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0,00	0,00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	0,00	0,00
4.	Koszty transakcyjne	0,00	0,00
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	36,86	-277,02
6.	Pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6) :	36,86	-277,02

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 2006-12-31

Nordea Polska Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Zrównoważony typu E

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTKI ROZRACHUNKOWYCH

pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	3 603,4739	19 233,9723
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	19 233,9723	36 444,7600
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł) :		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	10,34	11,57
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10,15	11,57
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	11,61	13,62
2.4	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	11,57	13,29

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 2006-12-31

Nordea Polska Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy Zrównoważony typu E

V ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

Lokaty	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
Papier wartościowe emittowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:	181 800,19	37,53%
1.1 Obligacje	147 894,71	30,53%
1.2 Bony skarbowe	33 905,48	7,00%
1.3 Inne	0,00	0,00%
2. Obligacje emittowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00%
3. Listy zastawne	0,00	0,00%
3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00%
3.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
3.1.2 Pozostałe	0,00	0,00%
3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00%
4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
4.1 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
4.2 Pozostałe	0,00	0,00%
5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00%
5.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00%
5.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
5.1.2 Pozostałe	0,00	0,00%
5.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00%
6. Akcje	239 405,89	49,43%
6.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	239 405,89	49,43%
6.1.1 Notowane na rynku regulowanym	239 405,89	49,43%
6.1.2 Pozostałe	0,00	0,00%
6.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00%
7. Udziały	0,00	0,00%
8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	0,00	0,00%
8.1 Jednostki uczestnictwa	0,00	0,00%
8.2 Certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00%
8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0,00	0,00%
8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00%
9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
9.1 Opcje	0,00	0,00%
9.2 Kontrakty terminowe	0,00	0,00%
9.3 Swapy walutowe	0,00	0,00%
9.4 Swapy procentowe	0,00	0,00%
9.5 Prawa poboru	0,00	0,00%
9.6 Inne instrumenty pochodne	0,00	0,00%
10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00%
11. Pożyczki	0,00	0,00%
11.1 Zabezpieczenia hipoteczne	0,00	0,00%
11.2 Zabezpieczenia gwarancjami instytucji finansowej	0,00	0,00%
11.3 Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0,00	0,00%
11.4 Inne pożyczki	0,00	0,00%
12. Nieruchomości	0,00	0,00%
13. Depozyty bankowe	63 144,78	13,04%
Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00%
14. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM :	484 350,86	100,00%
15.1 Ulokowane na terenie RP	484 350,86	100,00%
15.2 Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	0,00	0,00%
15.3 Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD	0,00	0,00%
15.4 Ulokowane poza terenem RP, UE, i OECD	0,00	0,00%

WZESTAWIENIE LOKATY FUNDUSZU

Lokaty	Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa w (zł)	Udział w aktywach funduszu w (%)
1. Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:	3,46	181 800,19	37,53%
1.1 Obligacje	3,38	147 894,71	30,53%
1.1.1 PL0000102869	0,56	23 902,03	5,14%
1.1.2 PL0000103693	0,56	23 478,25	4,85%
1.1.3 PL0000103602	0,84	36 481,18	7,94%
1.1.4 PL0000102836	0,84	35 659,24	7,36%
1.1.5 PL0000101259	0,56	25 374,01	5,24%
1.2 Bony skarbowe	0,08	33 905,48	7,00%
1.2.1 PL0000004107	0,03	11 578,66	2,39%
1.2.2 PL0000004024	0,03	11 759,88	2,43%
1.2.3 PL0000004032	0,03	10 566,94	2,18%
1.3 Inne	0,00	0,00	0,00%
2. Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00	0,00%
3. Listy zastawne	0,00	0,00	0,00%
3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
3.1.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
3.1.2 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00	0,00%
3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00	0,00%
4.1 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00	0,00%
4.2 Pozostałe	0,00	0,00	0,00%
5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00	0,00%
5.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
5.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00	0,00%
5.1.2 Pozostałe	0,00	0,00	0,00%
5.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
6. Akcje	174,78	239 405,89	49,43%
6.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	174,78	239 405,89	49,43%
6.1.1 Notowane na rynku regulowanym	174,78	239 405,89	49,43%
6.1.1.1 Agora SA	1,15	1 773,81	0,37%
6.1.1.2 AMREST SA	0,36	1 135,34	0,23%
6.1.1.3 Apax SA	1,00	926,41	0,19%
6.1.1.4 ASSECOFOL	0,07	1 025,32	0,21%
6.1.1.5 Bank Handlowy	0,48	1 675,79	0,35%
6.1.1.6 Bank Inicjatyw	4,89	1 640,44	0,34%
6.1.1.7 Bank Polska Kasa	2,08	19 927,95	4,11%
6.1.1.8 Bank Przem-Han PBK	0,16	6 108,92	1,26%
6.1.1.9 Bank Rozwoju	0,36	6 076,37	1,05%
6.1.1.10 Bank Śląski SA	0,10	3 369,82	0,70%
6.1.1.11 Bank Zachodni WBK SA	0,66	6 302,41	1,30%
6.1.1.12 BARLINEK	1,04	721,79	0,15%
6.1.1.13 BIOTON	18,78	1 725,91	0,36%
6.1.1.14 Boryszew SA	0,91	883,50	0,18%
6.1.1.15 COC	0,48	1 010,38	0,21%
6.1.1.16 Cioch SA	0,70	1 900,12	0,39%
6.1.1.17 Comarch SA	0,28	2 287,70	0,47%
6.1.1.18 COMP	0,08	250,39	0,05%
6.1.1.19 Computerland SA	0,31	1 361,62	0,28%
6.1.1.20 Cresanit SA	4,03	6 219,73	1,28%
6.1.1.21 Dębica SA	0,19	697,64	0,13%
6.1.1.22 DUDA	3,12	1 757,94	0,36%
6.1.1.23 DWORY SA	0,48	1 583,21	0,33%
6.1.1.24 Echo SA	1,03	3 845,41	0,79%
6.1.1.25 ELDORADO SA	0,29	1 072,99	0,22%
6.1.1.26 ELSTAR OILS SA	4,74	2 989,12	0,62%
6.1.1.27 EMAX	0,09	428,22	0,09%
6.1.1.28 EUROCASH	2,74	902,10	0,19%
6.1.1.29 Farmacol SA	2,62	4 808,87	0,99%
6.1.1.30 GETIN	7,15	3 815,78	0,79%
6.1.1.31 GRAAL SA	0,24	374,75	0,08%
6.1.1.32 GTC	4,44	7 526,58	1,55%
6.1.1.33 IDM SA	0,17	509,30	0,10%
6.1.1.34 Inter Gracini SA	0,13	265,88	0,05%
6.1.1.35 INTERIA PL	0,49	1 322,34	0,27%
6.1.1.36 Kety SA	0,39	3 268,31	0,67%
6.1.1.37 KOELNER	0,73	1 636,67	0,34%
6.1.1.38 Kombinat Gorniczo-	4,42	16 570,44	3,42%
6.1.1.39 Kredyt Bank PBI SA	1,37	1 162,64	0,24%
6.1.1.40 Kruk SA	0,13	758,85	0,16%
6.1.1.41 LOTOS SA	2,73	5 682,74	1,17%
6.1.1.42 LPP SA	0,02	754,70	0,16%
6.1.1.43 Mol	0,29	3 979,61	0,82%
6.1.1.44 Neta SA	8,08	1 720,93	0,36%
6.1.1.45 OPOCZNO SA	0,47	788,51	0,16%
6.1.1.46 PRS SA	0,43	4 638,85	0,96%
6.1.1.47 PCNIG SA	31,28	4 747,10	0,98%
6.1.1.48 PKO BP SA	11,70	23 180,95	4,79%
6.1.1.49 POLICE SSA	1,13	323,86	0,07%
6.1.1.50 POLIMEXMS SA	0,46	2 963,40	0,61%
6.1.1.51 POLMOS SA	0,18	707,49	0,15%
6.1.1.52 Polska Grupa	0,36	3 233,74	0,67%
6.1.1.53 Polski Moneta	12,60	25 347,65	5,23%
6.1.1.54 Pralerm SA	0,37	707,62	0,15%
6.1.1.55 Prochem SA	1,00	2 948,60	0,61%
6.1.1.56 Prokom SA	0,46	2 626,91	0,54%
6.1.1.57 PULAWY SA	0,17	415,31	0,09%
6.1.1.58 Rządowska Fabryka	0,42	700,05	0,14%
6.1.1.59 RMFM	0,15	898,92	0,19%
6.1.1.60 Sotbank SA	0,55	1 157,30	0,24%
6.1.1.61 Swiece SA	0,50	2 190,39	0,45%
6.1.1.62 Telekomunikacja	18,06	18 693,84	3,86%
6.1.1.63 TOORA SA	0,38	396,45	0,08%
6.1.1.64 TRAVEL.PL	0,92	1 936,56	0,40%
6.1.1.65 TVN	5,64	9 920,50	2,02%
6.1.1.66 ZELMER	0,38	911,19	0,19%
6.1.1.67 DUDAPP	2,56	1 295,56	0,27%
6.1.2 Pozostałe	0,00	0,00	0,00%
6.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0,00	0,00	0,00%
7. Udziały	0,00	0,00	0,00%
8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	0,00	0,00	0,00%
8.1 Jednostki uczestnictwa	0,00	0,00	0,00%
8.2 Certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00	0,00%
8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0,00	0,00	0,00%
8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00	0,00%
9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00	0,00%
9.1 Opcje	0,00	0,00	0,00%
9.2 Kontrakty terminowe	0,00	0,00	0,00%
9.3 Swapy walutowe	0,00	0,00	0,00%
9.4 Swapy procentowe	0,00	0,00	0,00%
9.5 Prawa poboru	0,00	0,00	0,00%
9.6 Inne instrumenty pochodne	0,00	0,00	0,00%
10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0,00	0,00	0,00%
11. Pożyczki	0,00	0,00	0,00%
11.1 Zabezpieczenia hipoteczne	0,00	0,00	0,00%
11.2 Zabezpieczenia gwarancjami instytucji finansowej	0,00	0,00	0,00%
11.3 Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0,00	0,00	0,00%
11.4 Inne pożyczki	0,00	0,00	0,00%
12. Nieruchomości	0,00	0,00	0,00%
13. Depozyty bankowe	0,00	63 144,78	13,04%
13.1 Depozyty bankowe w ING Bank Śląski S.A. (depozytariusz)	0,00	63 144,78	13,04%
Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00	0,00%
14. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM :	178,24	484 350,86	100,00%
15.1 Ulokowane na terenie RP	178,24	484 350,86	100,00%

15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	0,00	0,00	0,00%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD	0,00	0,00	0,00%
15.4	Ulokowane poza terenem RP, UE, i OECD	0,00	0,00	0,00%