

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

#### I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł)   | Okres poprzedni       | Okres bieżący         |
|--|-----------------------|-----------------------|
| <b>I. Aktywa</b>   | <b>170 990 845,85</b> | <b>140 589 221,82</b> |
| 1. Lokaty  | 170 990 845,85        | 140 589 221,82        |
| 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                  |
| <b>II. Zobowiązania</b>  | <b>0,00</b>           | <b>0,00</b>           |
| 1. Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego                      | 0,00                  | 0,00                  |
| 2. Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00                  | 0,00                  |
| 3. Pozostałe zobowiązania  | 0,00                  | 0,00                  |
| <b>III. Aktywa netto (I-II)</b>  | <b>170 990 845,85</b> | <b>140 589 221,82</b> |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

#### II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł)   | Okres poprzedni       | Okres bieżący         |
|--|-----------------------|-----------------------|
| <b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu</b>   | <b>158 363 798,66</b> | <b>193 533 934,78</b> |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>   | <b>-12 242 261,98</b> | <b>-30 634 663,85</b> |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>   | <b>15 679 355,39</b>  | <b>4 898 442,94</b>   |
| 1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu   | 15 604 491,39         | 4 898 442,94          |
| 2. Tytułem udzielonych gwarancji   | 0,00                  | 0,00                  |
| 3. Pozostałe zwiększenia   | 74 864,00             | 0,00                  |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>   | <b>27 921 617,37</b>  | <b>35 533 106,79</b>  |
| 1. Tytułem wykupu  | 4 969 159,67          | 12 531 927,60         |
| 2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych  | 0,00                  | 0,00                  |
| 3. Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu  | 480 183,21            | 712 458,29            |
| 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  | 1 530 651,16          | 1 665 564,41          |
| 8. Tytułem udzielonych gwarancji   | 0,00                  | 0,00                  |
| 9. Pozostałe zmniejszenia  | 20 941 623,33         | 20 623 156,49         |
| <b>C. Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)</b>   | <b>24 869 309,17</b>  | <b>-22 310 049,11</b> |
| 1. z papierów wartościowych emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 0,00                  | 0,00                  |
| 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  | 0,00                  | 0,00                  |
| 5. z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu  | 0,00                  | 0,00                  |
| 6. z akcji   | 0,00                  | 0,00                  |
| 7. z udziałów  | 0,00                  | 0,00                  |
| 8. z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych  | 24 869 309,17         | -22 310 049,11        |
| 9. z instrumentów pochodnych, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw 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 bankowych  | 0,00                  | 0,00                  |
| 14. z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej   | 0,00                  | 0,00                  |
| <b>D. Pozostałe zwiększenia</b>  | <b>0,00</b>           | <b>0,00</b>           |
| <b>E. Pozostałe zmniejszenia</b>   | <b>0,00</b>           | <b>0,00</b>           |
| <b>F. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>   | <b>170 990 845,85</b> | <b>140 589 221,82</b> |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

#### 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   | 0,00            | 0,00          |
| 6. Pozostałe koszty                                 | 0,00            | 0,00          |
| <b>7. RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6):</b>    | <b>0,00</b>     | <b>0,00</b>   |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

#### IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja   |  | Okres poprzedni | Okres bieżący  |
|-----------|--|-----------------|----------------|
| <b>1.</b> | <b>Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |                 |                |
| 1.1       | liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego  | 717 845,059879  | 723 897,268674 |
| 1.2       | liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego    | 596 618,443301  | 598 124,747148 |
| <b>2.</b> | <b>Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):</b>                      |                 |                |
| 2.1       | wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego  | 220,61          | 267,35         |
| 2.2       | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 218,70          | 235,01         |
| 2.3       | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 288,41          | 267,35         |
| 2.4       | wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego    | 286,60          | 235,05         |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

#### V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty     |  | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach funduszu (w %) |
|------------|--|--------------------------|----------------------------------|
| 1          |  | 2                        | 3                                |
| <b>1.</b>  | <b>Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:</b> | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 1.1        | Obligacje  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 1.2        | Bony skarbowe  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 1.3        | Inne   | 0,00                     | 0,00%                            |
| <b>2.</b>  | <b>Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego</b>                                   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>3.</b>  | <b>Listy zastawne</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 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%                            |
| <b>4.</b>  | <b>Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 4.1        | Notowane na rynku regulowanym  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 4.2        | Pozostałe  | 0,00                     | 0,00%                            |
| <b>5.</b>  | <b>Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 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%                            |
| <b>6.</b>  | <b>Akcje</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 6.1        | Dopuszczone do publicznego obrotu  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 6.1.1      | Notowane na rynku regulowanym  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 6.1.2      | Pozostałe  | 0,00                     | 0,00%                            |
| 6.2        | Niedopuszczone do publicznego obrotu   | 0,00                     | 0,00%                            |
| <b>7.</b>  | <b>Udziały</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>8.</b>  | <b>Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych</b>   | <b>140 589 221,82</b>    | <b>100,00%</b>                   |
| 8.1        | Jednostki uczestnictwa   | 140 589 221,82           | 100,00%                          |
| 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%                            |
| <b>9.</b>  | <b>Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych</b>                | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 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%                            |
| <b>10.</b> | <b>Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>11.</b> | <b>Pożyczki</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| 11.1       | Zabezieczone hipotecznie   | 0,00                     | 0,00%                            |
| 11.2       | Zabezieczone 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%                            |
| <b>12.</b> | <b>Nieruchomości</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>13.</b> | <b>Depozyty bankowe</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>14.</b> | <b>Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej</b>   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                     |
| <b>15.</b> | <b>RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:</b>  | <b>140 589 221,82</b>    | <b>100,00%</b>                   |
| 15.1.      | Ulokowane na terenie RP  | 140 589 221,82           | 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%                            |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2008

Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Legg Mason Zrównoważony Środkowoeuropejski

**VI. INFORMACJA DODATKOWA W ZAKRESIE KWOTY SKŁADEK BRUTTO ORAZ OPŁAT POTRĄCANYCH PRZED ICH PRZEKAZANIEM NA FUNDUSZE**

|   | okres poprzedni  | okres bieżący  |
|---|------------------|----------------|
| 1 Składka przypisana brutto w dziale I grupa 3  | 1 461 644 497,25 | 530 281 484,13 |
| 2 Opłaty za ryzyko potrącone ze składek, przed ich przekazaniem na wszystkie fundusze prowadzone przez zakład ubezpieczeń | 0,00             | 0,00           |
| 3 Prowizji potrącanych ze składek przed ich przekazaniem na fundusze  | 0,00             | 0,00           |
| 4 Inne koszty potrącone ze składek przed ich przekazaniem na fundusze   | 120 418,33       | 101 615,50     |
| 5 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, przed ich przekazaniem na fundusze  | 1 461 524 078,92 | 530 179 868,63 |
| 6 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, zwiększających aktywa funduszu, dla którego sporządzane jest sprawozdanie | 15 604 491,39    | 4 898 442,94   |