

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-------------|---|----------------------|---------------------|
| I. | Aktywa | 22 847 066,55 | 8 511 793,11 |
| 1. | Lokaty | 22 847 066,55 | 8 511 793,11 |
| 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 uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00 | 0,00 |
| 3. | Pozostałe zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 22 847 066,55 | 8 511 793,11 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------|---|----------------------|-----------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu | 6 965 747,46 | 22 847 066,55 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 15 582 850,26 | -11 678 967,23 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 17 947 949,91 | 659 214,50 |
| 1. | Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 16 156 280,20 | 659 214,50 |
| 2. | Tytułem udzielonych gwarancji | 0,00 | 0,00 |
| 3. | Pozostałe zwiększenia | 1 791 669,71 | 0,00 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 2 365 099,65 | 12 338 181,73 |
| 1. | Tytułem wykupu | 1 283 369,04 | 3 649 254,19 |
| 2. | Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. | Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu | 45 987,82 | 175 003,93 |
| 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 | 298 473,57 | 305 118,50 |
| 8. | Tytułem udzielonych gwarancji | 0,00 | 0,00 |
| 9. | Pozostałe zmniejszenia | 737 269,22 | 8 208 805,11 |
| C. | Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów) | 298 468,83 | -2 656 306,21 |
| 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 | 298 468,83 | -2 656 306,21 |
| 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 |
| D. | Pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| E. | Pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 0,00 |
| F. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 22 847 066,55 | 8 511 793,11 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

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 |
| 7. | RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6): | 0,00 | 0,00 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-----------|--|------------------|------------------|
| 1. | Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1.1 | liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 325 959,169864 | 1 012 275,877271 |
| 1.2 | liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 1 012 275,877271 | 465 125,306557 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł): | | |
| 2.1 | wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 21,37 | 22,57 |
| 2.2 | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 21,35 | 17,15 |
| 2.3 | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 23,50 | 22,57 |
| 2.4 | wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 22,57 | 18,30 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty | Ilość (w szt.) | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach funduszu (w %) |
|---|--------------------|--------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| 1. Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska: | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 1.1 Obligacje | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 1.2 Bony skarbowe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 1.3 Inne | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 2. Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 3. Listy zastawne | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.2 Pozostałe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 4.1. Notowane na rynku regulowanym | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 4.2. Pozostałe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1. Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1.2 Pozostałe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 5.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 6. Akcje | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1. Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.2 Pozostałe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 6.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 7. Udziały | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 465 125,307 | 8 511 793,11 | 100,00% |
| 8.1. Jednostki uczestnictwa | 465 125,307 | 8 511 793,11 | 100,00% |
| 8.1.1 DWS Zabezpieczenia Emerytalnego | 465 125,307 | 8 511 793,11 | 100,00% |
| 8.2. Certyfikaty inwestycyjne | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.1. Opcje | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.2. Kontrakty terminowe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.3. Swapy walutowe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.4. Swapy procentowe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.5. Prawa poboru | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 9.6. Inne instrumenty pochodne | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 11. Pożyczki | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 11.1. Zabezpieczone hipotecznie | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 11.2. Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 11.3. Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 11.4. Inne pożyczki | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 12. Nieruchomości | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 13. Depozyty bankowe | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 14. Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | 0,000 | 0,00 | 0,00% |
| 15. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM: | 465 125,307 | 8 511 793,11 | 100,00% |
| 15.1. Ulokowane na terenie RP | | 8 511 793,11 | 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% |
|-------|--------------------------------------|--|------|-------|

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2008

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Zabezpieczenia Emerytalnego

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

| | okres poprzedni | okres bieżący |
|---|------------------|----------------|
| 1 Składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 | 2 818 716 309,85 | 896 659 774,37 |
| 2 Oplaty 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 | 219 229,55 | 186 321,61 |
| 5 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, przed ich przekazaniem na fundusze | 2 818 497 080,30 | 896 473 452,76 |
| 6 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, zwiększających aktywa funduszu, dla którego sporządzane jest sprawozdanie | 16 156 280,20 | 659 214,50 |