

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|
| I. Aktywa | 2 659 914,89 | 2 082 389,27 |
| 1. Lokaty | 2 659 914,89 | 2 082 389,27 |
| 2. Środki pieniężne | | |
| 3. Należności, w tym | 0,00 | 0,00 |
| 3.1. Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego | | |
| 3.2. Pozostałe należności | | |
| 4. Pozostałe aktywa | | |
| II. Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 1. Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego | | |
| 2. Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | | |
| 3. Pozostałe zobowiązania | | |
| III. Aktywa netto (I-II) | 2 659 914,89 | 2 082 389,27 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|----------------------|
| A. Aktywa netto funduszu na początek okresu | 240 409,02 | 3 029 141,64 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 2 400 676,52 | -1 002 364,51 |
| I. Zwiększenia funduszu | 2 406 859,41 | 383 650,96 |
| 1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 2 385 121,78 | 383 650,96 |
| 2. Tytułem udzielonych gwarancji | | |
| 3. Pozostałe zwiększenia | 21 737,63 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 6 182,89 | 1 386 015,47 |
| 1. Tytułem wykupu | 0,00 | 71 242,66 |
| 2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | | |
| 3. Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 0,00 | 277,50 |
| 4. Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | | |
| 5. Tytułem prowizji od składek | | |
| 6. Tytułem pozostałych prowizji | | |
| 7. Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 6 182,89 | 23 903,79 |
| 8. Tytułem udzielonych gwarancji | | |
| 9. Pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 1 290 591,52 |
| C. Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów) | 18 829,35 | 55 612,14 |
| 1. z papierów wartościowych emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | | |
| 2. z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | | |
| 3. z listów zastawnych | | |
| 4. z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu | | |
| 5. z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | | |
| 6. z akcji | | |
| 7. z udziałów | | |
| 8. z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych | 18 829,35 | 55 612,14 |
| 9. z instrumentów pochodnych, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | | |
| 10. z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | | |
| 11. z pożyczek | | |
| 12. z nieruchomości | | |
| 13. z depozytów bankowych | | |
| 14. z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | | |
| D. Pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| E. Pozostałe zmniejszenia | | |
| F. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 2 659 914,89 | 2 082 389,27 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

III. KOSZTY FUNDUSZU

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

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------|
| 1. Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1.1 liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 1 514,10 | 18 265,45 |
| 1.2 liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 16 392,92 | 12 273,90 |
| 2. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł): | | |
| 2.1 wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 158,78 | 165,84 |
| 2.2 minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 158,78 | 165,10 |
| 2.3 maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 162,26 | 169,66 |
| 2.4 wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 162,26 | 169,66 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach funduszu (w %) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|----------------------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| 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 | | |
| 1.2 Bony skarbowe | | |
| 1.3 Inne | | |
| 2. Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | | |
| 3. Listy zastawne | 0,00 | 0,00% |
| 3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.1 Notowane na rynku regulowanym | | |
| 3.1.2 Pozostałe | | |
| 3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | 0,00 | 0,00% |
| 4.1. Notowane na rynku regulowanym | | |
| 4.2. Pozostałe | | |
| 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 | | |
| 5.1.2 Pozostałe | | |
| 5.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 6. Akcje | 0,00 | 0,00% |
| 6.1. Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.1 Notowane na rynku regulowanym | | |
| 6.1.2 Pozostałe | | |
| 6.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 7. Udziały | | |
| 8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 8.1. Jednostki uczestnictwa | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 8.2. Certyfikaty inwestycyjne | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | | |
| 8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych | | |
| 9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00% |
| 9.1. Opcje | | |
| 9.2. Kontrakty terminowe | | |
| 9.3. Swapy walutowe | | |
| 9.4. Swapy procentowe | | |
| 9.5. Prawa poboru | | |
| 9.6. Inne instrumenty pochodne | | |
| 10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | | |
| 11. Pożyczki | 0,00 | 0,00% |
| 11.1. Zabezpieczone hipotecznie | | |
| 11.2. Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | | |
| 11.3. Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | | |
| 11.4. Inne pożyczki | | |
| 12. Nieruchomości | | |
| 13. Depozyty bankowe | | |
| 14. Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | | |
| 15. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM: | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 15.1. Ulokowane na terenie RP | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 15.2. Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE | | |
| 15.3. Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD | | |
| 15.4. Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD | | |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005
Nazwa zakładu ubezpieczeń Nationwide Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

VI. 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: | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 1.1 | Obligacje | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 1.1.1 | | | | |
| 1.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 1.1.N | | | | |
| 1.2 | Bony skarbowe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 1.2.1 | | | | |
| 1.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 1.2.N | | | | |
| 1.3 | Inne | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 1.3.1 | | | | |
| 1.3.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 1.3.N | | | | |
| 2. | Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 2.1 | | | | |
| 2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 2.N | | | | |
| 3. | Listy zastawne | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1. | Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.1.1 | | | | |
| 3.1.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 3.1.1.N | | | | |
| 3.1.2 | Pozostałe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.2.1 | | | | |
| 3.1.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 3.1.2.N | | | | |
| 3.2. | Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 3.2.1 | | | | |
| 3.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 3.2.N | | | | |
| 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% |
| 4.1.1 | | | | |
| 4.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 4.1.N | | | | |
| 4.2. | Pozostałe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 4.2.1 | | | | |
| 4.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 4.2.N | | | | |
| 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% |
| 5.1.1.1 | | | | |
| 5.1.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 5.1.1.N | | | | |
| 5.1.2 | Pozostałe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1.2.1 | | | | |
| 5.1.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 5.1.2.N | | | | |
| 5.2. | Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 5.2.1 | | | | |
| 5.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 5.2.N | | | | |
| 6. | Akcje | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1. | Dopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.1.1 | | | | |
| 6.1.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 6.1.1.N | | | | |
| 6.1.2 | Pozostałe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.2.1 | | | | |
| 6.1.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 6.1.2.N | | | | |
| 6.2. | Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 6.2.1 | | | | |
| 6.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 6.2.N | | | | |
| 7. | Udziały | | | |

| | | | | |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------------|---------|
| 8. | Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 12 273,90 | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 8.1. | Jednostki uczestnictwa | 12 273,90 | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 8.1.1 | DWS Polska FIO Rynku Pieniężnego | 12 273,90 | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 8.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 8.1.N | | | | |
| 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% |
| 8.2.1.1 | | | | |
| 8.2.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 8.2.1.N | | | | |
| 8.2.2 | Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.2.1 | | | | |
| 8.2.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 8.2.2.N | | | | |
| 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% |
| 9.1.1 | | | | |
| 9.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.1.N | | | | |
| 9.2. | Kontrakty terminowe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 9.2.1 | | | | |
| 9.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.2.N | | | | |
| 9.3. | Swapy walutowe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 9.3.1 | | | | |
| 9.3.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.3.N | | | | |
| 9.4. | Swapy procentowe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 9.4.1 | | | | |
| 9.4.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.4.N | | | | |
| 9.5. | Prawa poboru | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 9.5.1 | | | | |
| 9.5.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.5.N | | | | |
| 9.6. | Inne instrumenty pochodne | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 9.6.1 | | | | |
| 9.6.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 9.6.N | | | | |
| 10. | Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu | | | |
| 11. | Pożyczki | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 11.1. | Zabezpieczone hipotecznie | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 11.1.1 | | | | |
| 11.1.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 11.1.N | | | | |
| 11.2. | Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 11.2.1 | | | | |
| 11.2.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 11.2.N | | | | |
| 11.3. | Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 11.3.1 | | | | |
| 11.3.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 11.3.N | | | | |
| 11.4. | Inne pożyczki | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 11.4.1 | | | | |
| 11.4.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 11.4.N | | | | |
| 12. | Nieruchomości | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 12.1 | | | | |
| 12.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 12.N | | | | |
| 13. | Depozyty bankowe | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 13.1 | | | | |
| 13.2 | | | | |
| ... | | | | |
| 13.N | | | | |
| 14. | Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 14.1 | | | | |
| ... | | | | |
| 14.N | | | | |
| 15. | Razem lokaty (suma 1-14), w tym: | 12 273,90 | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 15.1. | Ulokowane na terenie RP | 12 273,90 | 2 082 389,27 | 100,00% |
| 15.2. | Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE | | | |
| 15.3. | Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD | | | |
| 15.4. | Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD | | | |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 30-06-2005

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Rynku Pieniężnego

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 | 299 460 174,15 | 403 328 355,57 |
| 2 Oplaty za ryzyko potrącane 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 potrącane ze składek przed ich przekazaniem na fundusze | 1 202 477,24 | 376 005,52 |
| 5 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, przed ich przekazaniem na fundusze | 298 257 696,91 | 402 952 350,05 |
| 6 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, zwiększających aktywa funduszu, dla którego sporządzane jest sprawozdanie | 2 385 121,78 | 383 650,96 |