

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

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Euroobligacji

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--|-------------------|-----------------|
| I. Aktywa | 800 373,32 | 4 105,16 |
| 1. Lokaty | 800 373,32 | 4 105,16 |
| 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) | 800 373,32 | 4 105,16 |

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

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Euroobligacji

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--|-------------------|---------------------|
| A. Aktywa netto funduszu na początek okresu | 650 687,95 | 800 373,32 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 195 421,74 | -824 349,35 |
| I. Zwiększenia funduszu | 617 944,94 | 182 615,88 |
| 1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 617 944,94 | 171 362,50 |
| 2. Tytułem udzielonych gwarancji | 0,00 | 0,00 |
| 3. Pozostałe zwiększenia | 0,00 | 11 253,38 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 422 523,20 | 1 006 965,03 |
| 1. Tytułem wykupu | 36 471,75 | 2 793,72 |
| 2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 1 356,14 | 156,59 |
| 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 | 14 241,19 | 13 980,43 |
| 8. Tytułem udzielonych gwarancji | 0,00 | 0,00 |
| 9. Pozostałe zmniejszenia | 370 454,12 | 990 034,29 |
| C. Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów) | -45 736,37 | 28 081,19 |
| 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 | -45 736,37 | 28 081,19 |
| 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 | 800 373,32 | 4 105,16 |

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

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

DWS Euroobligacji

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 31-12-2006
Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Euroobligacji

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--|-----------------|---------------|
| 1. Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1.1 liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 465,292252 | 595,821754 |
| 1.2 liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 595,821754 | 3,073852 |
| 2. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł): | | |
| 2.1 wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 1 398,45 | 1 343,31 |
| 2.2 minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 1 329,20 | 1 307,61 |
| 2.3 maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 1 475,29 | 1 418,61 |
| 2.4 wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 1 343,31 | 1 335,51 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2006
Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Euroobligacji

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 | 0,00 | 0,00% |
| 1.1 Obligacje | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 1.2 Bony skarbowe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 1.3 Inne | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 2. Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 3. Listy zastawne | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1.2 Pozostałe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 4.1. Notowane na rynku regulowanym | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 4.2. Pozostałe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1. Dopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 5.1.2 Pozostałe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 5.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 6. Akcje | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1. Dopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.1 Notowane na rynku regulowanym | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1.2 Pozostałe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 6.2. Niedopuszczone do publicznego obrotu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 7. Udziały | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 3,0739 | 4 105,16 | 100,00% |
| 8.1. Jednostki uczestnictwa | 3,0739 | 4 105,16 | 100,00% |
| 8.1.1 DWS Polska SFIO Euroobligacji | 3,0739 | 4 105,16 | 100,00% |
| 8.2. Certyfikaty inwestycyjne | 0,00 | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.1. Opcje | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.2. Kontrakty terminowe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.3. Swapy walutowe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.4. Swapy procentowe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.5. Prawa poboru | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 9.6. Inne instrumenty pochodne | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 11. Pożyczki | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 11.1. Zabezpieczone hipotecznie | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 11.2. Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 11.3. Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 11.4. Inne pożyczki | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 12. Nieruchomości | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 13. Depozyty bankowe | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 14. Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | 0 | 0,00 | 0,00% |
| 15. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM: | 0 | 4 105,16 | 100,00% |
| 15.1. Ulokowane na terenie RP | | 4 105,16 | 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 31-12-2006
 Nazwa zakładu ubezpieczeń AEGON Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
 Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: DWS Euroobligacji

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 | 1 012 589 556,67 | 1 845 870 904,45 |
| 2 Opłaty 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 | 499 399,17 | 315 527,00 |
| 5 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, przed ich przekazaniem na fundusze | 1 012 090 157,50 | 1 845 555 377,45 |
| 6 Wielkość składek netto po potrąceniu kosztów, zwiększających aktywa funduszu, dla którego sporządzane jest sprawozdanie | 617 944,94 | 171 362,50 |