

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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

#### I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł)   | Okres poprzedni | Okres bieżący     |
|--|-----------------|-------------------|
| <b>I. Aktywa</b>   | <b>0,00</b>     | <b>624 892,52</b> |
| 1. Lokaty  | 0,00            | 624 892,52        |
| 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>0,00</b>     | <b>624 892,52</b> |

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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

#### II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł)   | Okres poprzedni | Okres bieżący     |
|--|-----------------|-------------------|
| <b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu</b>   | <b>0,00</b>     | <b>0,00</b>       |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>   | <b>0,00</b>     | <b>627 499,31</b> |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>   | <b>0,00</b>     | <b>662 703,27</b> |
| 1. Tytułem składek zwiększających wartość funduszu   | 0,00            | 624 566,90        |
| 2. Tytułem udzielonych gwarancji   | 0,00            | 0,00              |
| 3. Pozostałe zwiększenia   | 0,00            | 38 136,37         |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>   | <b>0,00</b>     | <b>35 203,96</b>  |
| 1. Tytułem wykupu  | 0,00            | 0,00              |
| 2. Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych  | 0,00            | 0,00              |
| 3. Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu   | 0,00            | 13,94             |
| 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  | 0,00            | 2 315,08          |
| 8. Tytułem udzielonych gwarancji   | 0,00            | 0,00              |
| 9. Pozostałe zmniejszenia  | 0,00            | 32 874,94         |
| <b>C. Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)</b>   | <b>0,00</b>     | <b>-2 606,79</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  | 0,00            | -2 606,79         |
| 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>0,00</b>     | <b>624 892,52</b> |

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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

#### 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>   |

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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

#### IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja  | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--|-----------------|---------------|
| <b>1. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                              |                 |               |
| 1.1 liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego  | 0,000000        | 0,000000      |
| 1.2 liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego    | 0,000000        | 2 108,203232  |
| <b>2. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):</b>                       |                 |               |
| 2.1 wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego  | 0,00            | 0,00          |
| 2.2 minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 0,00            | 257,75        |
| 2.3 maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 0,00            | 298,38        |
| 2.4 wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego    | 0,00            | 296,41        |

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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

#### V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty  | Ilość<br>(w szt.) | Wartość bilansowa<br>(w zł) | Udział w aktywach<br>funduszu (w %) |
|---|-------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| <b>1</b>  | <b>2</b>          | <b>3</b>                    | <b>4</b>                            |
| <b>1. Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:</b> | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>2. Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego</b>                                   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>3. Listy zastawne</b>  | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 4.1. Notowane na rynku regulowanym  | 0                 | 0,00                        | 0,00%                               |
| 4.2. Pozostałe  | 0                 | 0,00                        | 0,00%                               |
| <b>5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>6. Akcje</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>7. Udziały</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych</b>   | <b>2 108,24</b>   | <b>624 892,52</b>           | <b>100,00%</b>                      |
| 8.1. Jednostki uczestnictwa   | 2 108,24          | 624 892,52                  | 100,00%                             |
| 8.1.1 MLIF US Opportunities Fund USD  | 2 108,24          | 624 892,52                  | 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%                               |
| <b>9. Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych</b>                | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>11. Pożyczki</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| 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%                               |
| <b>12. Nieruchomości</b>  | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>13. Depozyty bankowe</b>   | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>14. Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej</b>  | <b>0</b>          | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                        |
| <b>15. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:</b>   | <b>0</b>          | <b>624 892,52</b>           | <b>100,00%</b>                      |
| 15.1. Ulokowane na terenie RP   |                   | 0,00                        | 0,00%                               |
| 15.2. Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE   |                   | 624 892,52                  | 100,00%                             |
| 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:

UFK - Merrill Lynch US Opportunities Fund (USD)

**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 | 0,00             | 624 566,90       |