

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Portfel Modelowy "Strategia Żółta (średnie ryzyko)"

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	16 820 994,71	22 606 743,04
1.	lokaty	16 412 318,70	22 026 694,97
2.	środki pieniężne	392 178,66	556 526,97
3.	należności	16 497,35	23 521,10
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	16 497,35	23 521,10
II.	Zobowiązania	61 026,88	140 987,99
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	61 026,88	140 987,99
III.	Aktywa netto (I-II)	16 759 967,83	22 465 755,05

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Portfel Modelowy "Strategia Żółta (średnie ryzyko)"

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	0,00	16 759 967,83
B. Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	16 718 711,92	4 800 197,00
I. Zwiększenia funduszu	17 788 946,55	17 832 366,63
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	17 788 946,55	17 832 366,63
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
II. Zmniejszenia funduszu	1 070 234,63	13 032 169,63
1. tytułem wykupu	1 070 234,63	13 032 169,63
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	0,00	0,00
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	0,00
6. pozostałe koszty	0,00	0,00
7. pozostałe zmniejszenia	0,00	0,00
C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej	41 255,91	905 590,22
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	16 759 967,83	22 465 755,05

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
 Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Portfel Modelowy "Strategia Żółta (średnie ryzyko)"

III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I. Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,00	166 461,85
2. na koniec okresu sprawozdawczego	166 461,85	211 621,93
II. Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,00	100,68
2. minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	97,99	96,97
3. maksymalna wartość jednostki uczestnictwa w okresie sprawozdawczym	101,44	106,16
4. na koniec okresu sprawozdawczego	100,68	106,16

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Portfel Modelowy "Strategia Żółta (średnie ryzyko)"

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- ROCZNE

	1	2	3
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I. Lokaty (suma 1-12)		22 026 694,97	98,05%
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		0,00	0,00%
1.2 bony skarbowe		0,00	0,00%
1.3 inne		0,00	0,00%
2. obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0,00	0,00%
3. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		0,00	0,00%
3.1 notowane na rynku regulowanym		0,00	0,00%
3.2 pozostałe		0,00	0,00%
4. akcje		0,00	0,00%
4.1 notowane na rynku regulowanym		0,00	0,00%
4.2 pozostałe		0,00	0,00%
5. udziały		0,00	0,00%
6. jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		22 026 694,97	98,05%
6.1 jednostki uczestnictwa		14 377 486,91	64,00%
6.2 certyfikaty inwestycyjne		7 649 208,06	34,05%
6.2.1. funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0,00	0,00%
6.2.2. innych funduszy inwestycyjnych		7 649 208,06	34,05%
7. instrumenty pochodne		0,00	0,00%
7.1. opcje		0,00	0,00%
7.2. kontrakty terminowe		0,00	0,00%
7.3. swapy walutowe		0,00	0,00%
7.4. swapy procentowe		0,00	0,00%
7.5. inne instrumenty pochodne		0,00	0,00%
8. inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		0,00	0,00%
9. pożyczki		0,00	0,00%
9.1 zabezpieczone hipotecznie		0,00	0,00%
9.2 zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		0,00	0,00%
9.3 pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0,00	0,00%
9.4 inne pożyczki		0,00	0,00%
10. nieruchomości		0,00	0,00%
11. depozyty bankowe		0,00	0,00%
12. pozostałe lokaty		0,00	0,00%
II. Środki pieniężne		556 526,97	2,48%
III. Należności		23 521,10	0,10%
IV. Zobowiązania		140 987,99	0,63%
V. Aktywa netto (w tym)		22 465 755,05	100,00%
1. krajowe		22 465 755,05	100,00%
2. zagraniczne – państwa UE		0,00	0,00%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%