

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK DEBT & EQUITY

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł)      |   | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego<br>poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|---|---|---|
| <b>I.</b>   | <b>Aktywa</b>   | <b>0,00</b>   | <b>98 746 253,52</b>                    |
| 1.          | lokaty  | 0,00  | 77 890 300,24                           |
| 2.          | środki pieniężne  | 0,00  | 20 706 018,97                           |
| 3.          | aktywa za zezwoleniem organu nadzoru,<br>zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja<br>2003 r. o działalności ubezpieczeniowej | 0,00  | 0,00                                    |
| 4.          | należności  | 0,00  | 149 934,31                              |
| 4.1.        | z tytułu transakcji zawartych na rynku<br>finansowym  |   |   |
| 4.2.        | pozostałe   | 0,00  | 149 934,31                              |
| <b>II.</b>  | <b>Zobowiązania</b>   | <b>0,00</b>   | <b>799 965,79</b>                       |
| 1.          | z tytułu transakcji zawartych na rynku<br>finansowym  |   |   |
| 2.          | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych,<br>uposażonych lub uprawnionych z umów<br>ubezpieczenia                                     |   |   |
| 3.          | pozostałe   | 0,00  | 799 965,79                              |
| <b>III.</b> | <b>Aktywa netto (I-II)</b>  | <b>0,00</b>   | <b>97 946 287,73</b>                    |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK DEBT & EQUITY

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł)     |  | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|--|--|-----------------------------|
| <b>A.</b>  | <b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            | <b>0,00</b>  | <b>0,00</b>                 |
| <b>B.</b>  | <b>Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>0,00</b>  | <b>97 186 435,47</b>        |
| <b>I.</b>  | <b>Zwiększenia funduszu</b>  | <b>0,00</b>  | <b>101 717 000,66</b>       |
| 1.         | tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 0,00   | 101 717 000,66              |
| 2.         | pozostałe przychody  |  |                             |
| 3.         | pozostałe zwiększenia  |  |                             |
| <b>II.</b> | <b>Zmniejszenia funduszu</b>   | <b>0,00</b>  | <b>4 530 565,19</b>         |
| 1.         | tytułem wykupu   | 0,00   | 4 530 565,19                |
| 2.         | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     |  |                             |
| 3.         | tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu          | 0,00   | 0,00                        |
| 4.         | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych   |  |                             |
| 5.         | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00   | 0,00                        |
| 6.         | pozostałe koszty   |  |                             |
| 7.         | pozostałe zmniejszenia   |  |                             |
| <b>C.</b>  | <b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>  | <b>0,00</b>  | <b>759 852,26</b>           |
| <b>D.</b>  | <b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>0,00</b>  | <b>97 946 287,73</b>        |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK DEBT & EQUITY

III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| (w zł)  | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| <b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 0,0000  | 0,0000                      |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 0,0000  | 944 868,3366                |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):</b>                     |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 0,00  | 0,00                        |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 0,00  | 100,00                      |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 0,00  | 103,66                      |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 0,00  | 103,66                      |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK DEBT & EQUITY

| V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU |  |                          |  |
|--------------------------------------|--|--------------------------|--|
| (w zł)                               |  | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I.                                   | Lokaty (suma 1-12)   | 77 890 300,24            | 79,52%                                 |
| 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%                                  |
| 1.2                                  | bony skarbowe  |                          | 0,00%                                  |
| 1.3                                  | inne   |                          | 0,00%                                  |
| 2.                                   | obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego                                  |                          | 0,00%                                  |
| 3.                                   | Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu  | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 3.1                                  | notowane na rynku regulowanym  |                          | 0,00%                                  |
| 3.2                                  | pozostałe  | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 4.                                   | akcje  | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 4.1                                  | notowane na rynku regulowanym  |                          | 0,00%                                  |
| 4.2                                  | pozostałe  |                          | 0,00%                                  |
| 5.                                   | udziały  |                          | 0,00%                                  |
| 6.                                   | jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych  | 77 890 300,24            | 79,52%                                 |
| 6.1                                  | jednostki uczestnictwa   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 6.2                                  | certyfikaty inwestycyjne   | 77 890 300,24            | 79,52%                                 |
| 6.2.1.                               | funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości   |                          | 0,00%                                  |
| 6.2.2.                               | innych funduszy inwestycyjnych   | 77 890 300,24            | 79,52%                                 |
| 7.                                   | instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych               | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 7.1.                                 | opcje  |                          | 0,00%                                  |
| 7.2.                                 | kontrakty terminowe  |                          | 0,00%                                  |
| 7.3.                                 | swapy walutowe   |                          | 0,00%                                  |
| 7.4.                                 | swapy procentowe   |                          | 0,00%                                  |
| 7.5.                                 | inne instrumenty pochodne  |                          | 0,00%                                  |
| 8.                                   | inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu   |                          | 0,00%                                  |
| 9.                                   | pożyczki   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 9.1                                  | zabezpieczone hipotecznie  |                          | 0,00%                                  |
| 9.2                                  | zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej  |                          | 0,00%                                  |
| 9.3                                  | pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie   |                          | 0,00%                                  |
| 9.4                                  | inne pożyczki  |                          | 0,00%                                  |
| 10.                                  | nieruchomości  |                          | 0,00%                                  |
| 11.                                  | depozyty bankowe   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 12.                                  | pozostałe lokaty   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| II.                                  | Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust.9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej                               | 0,00                     | 0,00%                                  |
| III.                                 | Środki pieniężne   | 20 706 018,97            | 21,14%                                 |
| IV.                                  | Należności   | 149 934,31               | 0,15%                                  |
| V.                                   | Zobowiązania   | 799 965,79               | 0,82%                                  |
| VI.                                  | Aktywa netto (w tym)   | 97 946 287,73            | 100,00%                                |
| 1.                                   | krajowe  | 97 946 287,73            | 100,00%                                |
| 2.                                   | zagraniczne - kraje UE   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 3.                                   | zagraniczne - kraje poza UE  | 0,00                     | 0,00%                                  |