

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

**UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parosol FIO)**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>3 541 547,08</b>	<b>1 781 959,67</b>
1.	lokaty	3 541 547,08	1 781 959,67
2.	środki pieniężne	0,00	0,00
3.	należności	0,00	0,00
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	0,00	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
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	0,00	0,00
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>3 541 547,08</b>	<b>1 781 959,67</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

**UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasol FIO)**

**II. ZMIANY WARTOŚCI 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>888 623,42</b>	<b>3 541 547,08</b>
<b>B.</b>	<b>Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>2 625 523,59</b>	<b>-1 795 351,03</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>3 548 708,64</b>	<b>286 398,20</b>
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	3 548 708,64	286 398,20
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>923 185,05</b>	<b>2 081 749,23</b>
1.	tytułem wykupu	906 802,15	2 052 654,54
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	321,24	570,49
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	16 061,66	28 524,20
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	0,00	0,00
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>27 400,07</b>	<b>35 763,62</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>3 541 547,08</b>	<b>1 781 959,67</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

**UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasol FIO)**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	3 442,94	13 515,81
2. na koniec okresu sprawozdawczego	13 515,81	6 724,63
<b>II. Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	258,10	262,03
2. minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	258,10	262,05
3. maksymalna wartość jednostki uczestnictwa w okresie sprawozdawczym	262,03	264,99
4. na koniec okresu sprawozdawczego	262,03	264,99

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasoł FIO)

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- ROCZNE

	1	2	3
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
<b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>		<b>1 781 959,67</b>	<b>100,00%</b>
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		1 781 959,67	100,00%
6.1 jednostki uczestnictwa		1 781 959,67	100,00%
6.2 certyfikaty inwestycyjne		0,00	0,00%
6.2.1. funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0,00	0,00%
6.2.2. innych funduszy inwestycyjnych		0,00	0,00%
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%
<b>II. Środki pieniężne</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>III. Należności</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV. Zobowiązania</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>V. Aktywa netto (w tym)</b>		<b>1 781 959,67</b>	<b>100,00%</b>
1. krajowe		1 781 959,67	100,00%
2. zagraniczne – państwa UE		0,00	0,00%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%