

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 Schroder ISF Frontier Markets Equity A1 (Acc) Hedged (PLN)

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|---|---|
| I. | Aktywa | 369 784,46 | 465 319,56 |
| 1. | lokaty | 369 784,46 | 465 319,56 |
| 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 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 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 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 369 784,46 | 465 319,56 |

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 Schroder ISF Frontier Markets Equity A1 (Acc) Hedged (PLN)

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 | 1 885 492,01 | 369 784,46 |
| B. Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | -1 367 603,15 | 66 023,63 |
| I. Zwiększenia funduszu | 110 653,43 | 221 802,54 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 110 653,43 | 221 802,54 |
| 2. pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 1 478 256,58 | 155 778,91 |
| 1. tytułem wykupu | 1 467 691,36 | 152 371,76 |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 207,09 | 119,05 |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 10 358,13 | 3 288,10 |
| 6. pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 0,00 |
| C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej | -148 104,40 | 29 511,47 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 369 784,46 | 465 319,56 |

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 Schroder ISF Frontier Markets Equity A1 (Acc) Hedged (PLN)

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 | 4 550,81 | 1 075,89 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 1 075,89 | 1 202,34 |
| II. Wartość jednostki uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 414,32 | 343,70 |
| 2. minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 337,26 | 301,18 |
| 3. maksymalna wartość jednostki uczestnictwa w okresie sprawozdawczym | 427,57 | 391,99 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 343,70 | 387,01 |

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 Schroder ISF Frontier Markets Equity A1 (Acc) Hedged (PLN)

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- ROCZNE

| | 1 | 2 | 3 |
|---|---|--------------------------|--|
| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I. Lokaty (suma 1-12) | | 465 319,56 | 100,00% |
| 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 | | 465 319,56 | 100,00% |
| 6.1 jednostki uczestnictwa | | 465 319,56 | 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% |
| II. Środki pieniężne | | 0,00 | 0,00% |
| III. Należności | | 0,00 | 0,00% |
| IV. Zobowiązania | | 0,00 | 0,00% |
| V. Aktywa netto (w tym) | | 465 319,56 | 100,00% |
| 1. krajowe | | 465 319,56 | 100,00% |
| 2. zagraniczne – państwa UE | | 0,00 | 0,00% |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE | | 0,00 | 0,00% |