

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

**UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasol 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>888 623,42</b>	<b>3 541 547,08</b>
1.	lokaty	888 623,42	3 541 547,08
2.	środki pieniężne	0,00	0,00
3.	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
4.	należności	0,00	0,00
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
4.2.	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		
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	pozostałe	0,00	0,00
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>888 623,42</b>	<b>3 541 547,08</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 Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasol FIO)**

**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>888 623,42</b>
<b>B.</b>	<b>Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>878 515,87</b>	<b>2 625 523,59</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>1 483 698,77</b>	<b>3 548 708,64</b>
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	1 483 698,77	3 548 708,64
2.	pozostałe przychody		
3.	pozostałe zwiększenia		
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>605 182,90</b>	<b>923 185,05</b>
1.	tytułem wykupu	600 498,54	906 802,15
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	91,84	321,24
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	4 592,52	16 061,66
6.	pozostałe koszty		
7.	pozostałe zmniejszenia		
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>10 107,55</b>	<b>27 400,07</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>888 623,42</b>	<b>3 541 547,08</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 Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parosol FIO)**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,0000	3 442,9423
2. na koniec okresu sprawozdawczego	3 442,9423	13 515,8075
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,00	258,10
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	251,61	258,10
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	258,26	262,03
4. na koniec okresu sprawozdawczego	258,10	262,03

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK Europa Legg Mason Pieniężny (Legg Mason Parasol FIO)

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		
	(w zł)	
	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I.	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>3 541 547,08</b>
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	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	
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00
3.1	notowane na rynku regulowanym	0,00%
3.2	pozostałe	0,00
4.	akcje	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	3 541 547,08
6.1	jednostki uczestnictwa	3 541 547,08
6.2	certyfikaty inwestycyjne	0,00
6.2.1.	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	
6.2.2.	innych funduszy inwestycyjnych	0,00
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	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	
9.	pożyczki	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
12.	pozostałe lokaty	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
III.	Środki pieniężne	0,00
IV.	Należności	0,00
V.	Zobowiązania	0,00
VI.	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>3 541 547,08</b>
1.	krajowe	3 541 547,08
2.	zagraniczne - kraje UE	0,00
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00