**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2014 r.**

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

**UFK Europa Agio Multistrategia (Agio SFIO)**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|---|---|---|---|
| **I.** | **Aktywa** | **293 232,51** | **45 803,44** |
| 1. | lokaty | 293 232,51 | 45 803,44 |
| 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* |
| **II.** | **Zobowiązania** | **0,00** | **0,00** |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | | |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | | |
| 3. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| **III.** | **Aktywa netto (I-II)** | **293 232,51** | **45 803,44** |

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2014 r.**

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

**UFK Europa Agio Multistrategia (Agio SFIO)**

**II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł) | | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|---|---|
| **A.** | **Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego** | **0,00** | **293 232,51** |
| **B.** | **Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)** | **299 652,54** | **-211 646,61** |
| **I.** | **Zwiększenia funduszu** | **300 000,00** | **218 000,00** |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 300 000,00 | 218 000,00 |
| 2. | pozostałe przychody | | |
| 3. | pozostałe zwiększenia | | |
| **II.** | **Zmniejszenia funduszu** | **347,46** | **429 646,61** |
| 1. | tytułem wykupu | 0,00 | 427 500,98 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | | |
| 3. | tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z fuduszu | 6,81 | 42,18 |
| 4. | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | | |
| 5. | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 340,65 | 2 103,45 |
| 6. | pozostałe koszty | | |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | | |
| **C.** | **Wynik netto z działalności inwestycyjnej** | **-6 420,03** | **-35 782,46** |
| **D.** | **Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego** | **293 232,51** | **45 803,44** |

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2014 r.**

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

**UFK Europa Agio Multistrategia (Agio SFIO)**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

| (w zł) | | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|---|---|
| **I.** | **Liczba jednostek rozrachunkowych:** | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 0,0000 | 269,5746 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 269,5746 | 49,3098 |
| **II.** | **Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):** | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 0,00 | 1 087,76 |
| 2. | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 953,15 | 922,22 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 1 127,62 | 1 108,74 |
| 4. | na koniec okresu sprawozdawczego | 1 087,76 | 928,89 |

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2014 r.**

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

**UFK Europa Agio Multistrategia (Agio SFIO)**

**V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł) | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|---|---|---|---|
| **I.** | **Lokaty (suma 1-12)** | **45 803,44** | **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% |
| *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 | 45 803,44 | 100,00% |
| *6.1* | *jednostki uczestnictwa* | 45 803,44 | 100,00% |
| *6.2* | *certyfikaty inwestycyjne* | 0,00 | 0,00% |
| *6.2.1.* | *funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości* | | 0,00% |
| *6.2.2.* | *innych funduszy inwestycyjnych* | 0,00 | 0,00% |
| 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** | **0,00** | **0,00%** |
| **IV** | **Należności** | **0,00** | **0,00%** |
| **V.** | **Zobowiązania** | **0,00** | **0,00%** |
| **VI.** | **Aktywa netto (w tym)** | **45 803,44** | **100,00%** |
| 1. | krajowe | 45 803,44 | 100,00% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 0,00 | 0,00% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |