

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

**EUROPA FUND LIBIII/2011/01**

**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>8 679 451,40</b>   | <b>9 518 574,03</b>                     |
| 1.          | lokaty   | 8 679 451,40  | 9 472 334,10                            |
| 2.          | środki pieniężne   | 0,00  | 46 239,93                               |
| 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>2 269,94</b>   | <b>2 007,39</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  | 2 269,94  | 2 007,39                                |
| <b>III.</b> | <b>Aktywa netto (I-II)</b>   | <b>8 677 181,46</b>   | <b>9 516 566,64</b>                     |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

EUROPA FUND LIBIII/2011/01

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł)  | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| <b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            | <b>7 551 766,91</b>   | <b>8 677 181,46</b>         |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>1 353 587,81</b>   | <b>634 828,81</b>           |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>  | <b>1 856 950,00</b>   | <b>1 684 100,00</b>         |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 1 856 950,00  | 1 684 100,00                |
| 2. pozostałe przychody  | 0,00  | 0,00                        |
| 3. pozostałe zwiększenia  | 0,00  | 0,00                        |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>  | <b>503 362,19</b>   | <b>1 049 271,19</b>         |
| 1. tytułem wykupu   | 503 362,19  | 1 049 271,19                |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     | 0,00  | 0,00                        |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu           | 0,00  | 0,00                        |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych   | 0,00  | 0,00                        |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00  | 0,00                        |
| 6. pozostałe koszty   | 0,00  | 0,00                        |
| 7. pozostałe zmniejszenia   | 0,00  | 0,00                        |
| <b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>  | <b>-228 173,26</b>  | <b>204 556,37</b>           |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>8 677 181,46</b>   | <b>9 516 566,64</b>         |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

**EUROPA FUND LIBIII/2011/01**

**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                                   | 521 170,94   | 605 103,31                  |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 605 103,31   | 646 505,89                  |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                            |  |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 14,49  | 14,34                       |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 13,39  | 13,81                       |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 19,29  | 17,56                       |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 14,34  | 14,72                       |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

EUROPA FUND LIBIII/2011/01

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

|        | 1  | 2                        | 3                                      |
|--------|--|--------------------------|--|
|        | Lokaty (suma 1-12)   | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I.     | <b>Lokaty (suma 1-12)</b>  | <b>9 472 334,10</b>      | <b>99,54%</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  | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 6.1    | jednostki uczestnictwa   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 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   | 9 472 334,10             | 99,54%                                 |
| 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.    | <b>Środki pieniężne</b>  | <b>46 239,93</b>         | <b>0,49%</b>                           |
| III.   | <b>Należności</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| IV.    | <b>Zobowiązania</b>  | <b>2 007,39</b>          | <b>0,02%</b>                           |
| V.     | <b>Aktywa netto (w tym)</b>  | <b>9 516 566,64</b>      | <b>100,00%</b>                         |
| 1.     | krajowe  | 44 232,54                | 0,46%                                  |
| 2.     | zagraniczne – państwa UE   | 9 472 334,10             | 99,54%                                 |
| 3.     | zagraniczne – państwa poza UE  | 0,00                     | 0,00%                                  |