

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	4 927 257,84	5 140 327,09
1.	lokaty	4 846 142,80	5 131 555,74
2.	środki pieniężne	76 516,39	3 585,53
3.	należności	4 598,65	5 185,82
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	4 598,65	5 185,82
II.	Zobowiązania	375 812,20	290 052,70
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	375 812,20	290 052,70
III.	Aktywa netto (I-II)	4 551 445,64	4 850 274,39

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"

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	0,00	4 551 445,64
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	4 536 373,43	60 036,81
I.	Zwiększenia funduszu	5 277 085,47	4 090 879,73
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	5 277 085,47	4 090 879,73
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
II.	Zmniejszenia funduszu	740 712,04	4 030 842,92
1.	tytułem wykupu	740 712,04	4 030 842,92
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
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	15 072,21	238 791,94
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	4 551 445,64	4 850 274,39

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"

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	0,00	45 273,51
2. na koniec okresu sprawozdawczego	45 273,51	45 799,50
II. Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,00	100,53
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	97,52	94,56
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	101,41	105,90
4. na koniec okresu sprawozdawczego	100,53	105,90

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

	1	2	3
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I. Lokaty (suma 1-12)		5 131 555,74	105,80%
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		5 131 555,74	105,80%
6.1 jednostki uczestnictwa		3 793 414,57	78,21%
6.2 certyfikaty inwestycyjne		1 338 141,17	27,59%
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		3 585,53	0,07%
III. Należności		5 185,82	0,11%
IV. Zobowiązania		290 052,70	5,98%
V. Aktywa netto (w tym)		4 850 274,39	100,00%
1. krajowe		4 850 274,39	100,00%
2. zagraniczne – państwa UE		0,00	0,00%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%