

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 Niebieska (umiarkowane ryzyko)"**

**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>28 264 069,36</b>	<b>103 335 576,45</b>
1.	lokaty	28 124 086,16	102 210 170,91
2.	środki pieniężne	112 236,12	1 019 539,19
3.	należności	27 747,08	105 866,35
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	27 747,08	105 866,35
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>471 792,07</b>	<b>1 834 375,85</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	471 792,07	1 834 375,85
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>27 792 277,29</b>	<b>101 501 200,60</b>

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 Niebieska (umiarkowane ryzyko)"**

**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>	<b>0,00</b>	<b>27 792 277,29</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>27 753 221,40</b>	<b>70 972 919,75</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>31 586 068,00</b>	<b>103 657 920,96</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	31 586 068,00	103 657 920,96
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>3 832 846,60</b>	<b>32 685 001,21</b>
1. tytułem wykupu	3 832 846,60	32 685 001,21
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych 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>39 055,89</b>	<b>2 736 003,56</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>27 792 277,29</b>	<b>101 501 200,60</b>

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 Niebieska (umiarkowane ryzyko)"**

**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	0,00	275 172,92
2. na koniec okresu sprawozdawczego	275 172,92	950 312,04
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	0,00	101,00
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	99,31	98,58
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	101,49	106,81
4. na koniec okresu sprawozdawczego	101,00	106,81

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 Niebieska (umiarkowane ryzyko)"

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

	1	2	3
	Lokaty (suma 1-12)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>102 210 170,91</b>	<b>100,70%</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	102 210 170,91	100,70%
6.1	jednostki uczestnictwa	68 586 808,36	67,57%
6.2	certyfikaty inwestycyjne	33 623 362,55	33,13%
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%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>1 019 539,19</b>	<b>1,00%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>105 866,35</b>	<b>0,10%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>1 834 375,85</b>	<b>1,81%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>101 501 200,60</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	101 501 200,60	100,00%
2.	zagraniczne – państwa UE	0,00	0,00%
3.	zagraniczne – państwa poza UE	0,00	0,00%