

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**UFK Europa Fidelity Funds Global Strategic Bond A (Acc) (PLN) (hedged)**

**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>92 726,90</b>  | <b>41 959,68</b>                        |
| 1.          | lokaty   | 92 726,90   | 41 959,68                               |
| 2.          | środki pieniężne   | 0,00  | 0,00                                    |
| 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>0,00</b>   | <b>0,00</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  | 0,00  | 0,00                                    |
| <b>III.</b> | <b>Aktywa netto (I-II)</b>   | <b>92 726,90</b>  | <b>41 959,68</b>                        |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**UFK Europa Fidelity Funds Global Strategic Bond A (Acc) (PLN) (hedged)**

**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>222 750,19</b>  | <b>92 726,90</b>            |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>-132 005,99</b>   | <b>-54 406,79</b>           |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>  | <b>25 755,35</b>   | <b>0,00</b>                 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 25 755,35  | 0,00                        |
| 2. pozostałe przychody  | 0,00   | 0,00                        |
| 3. pozostałe zwiększenia  | 0,00   | 0,00                        |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>  | <b>157 761,34</b>  | <b>54 406,79</b>            |
| 1. tytułem wykupu   | 156 865,72   | 53 584,77                   |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     | 0,00   | 0,00                        |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu           | 17,52  | 16,16                       |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych   | 0,00   | 0,00                        |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 878,10   | 805,86                      |
| 6. pozostałe koszty   | 0,00   | 0,00                        |
| 7. pozostałe zmniejszenia   | 0,00   | 0,00                        |
| <b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>  | <b>1 982,70</b>  | <b>3 639,57</b>             |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>92 726,90</b>   | <b>41 959,68</b>            |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**UFK Europa Fidelity Funds Global Strategic Bond A (Acc) (PLN) (hedged)**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

| Pozycja   | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| <b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 20 361,09   | 8 119,69                    |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 8 119,69  | 3 523,06                    |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                            |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 10,94   | 11,42                       |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 10,68   | 11,41                       |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 11,57   | 11,92                       |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 11,42   | 11,91                       |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

UFK Europa Fidelity Funds Global Strategic Bond A (Acc) (PLN) (hedged)

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- PÓŁROCZNE

|   | 1 | 2                        | 3                                      |
|---|---|--------------------------|--|
|   |   | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| <b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>  |   | <b>41 959,68</b>         | <b>100,00%</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  |   | 41 959,68                | 100,00%                                |
| 6.1 jednostki uczestnictwa  |   | 41 959,68                | 100,00%                                |
| 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   |   | 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. Środki pieniężne</b>   |   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>III. Należności</b>  |   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>IV. Zobowiązania</b>   |   | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>V. Aktywa netto (w tym)</b>  |   | <b>41 959,68</b>         | <b>100,00%</b>                         |
| 1. krajowe  |   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 2. zagraniczne – państwa UE   |   | 41 959,68                | 100,00%                                |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE  |   | 0,00                     | 0,00%                                  |