

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**Strategia New Frontier XIII**

**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>27 083 312,70</b>  | <b>28 658 299,90</b>                    |
| 1.          | lokaty   | 26 997 809,97   | 28 501 001,23                           |
| 2.          | środki pieniężne   | 85 500,14   | 157 149,78                              |
| 3.          | należności   | 2,59  | 148,89                                  |
| 3.1.        | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym                            | 0,00  | 0,00                                    |
| 3.2.        | pozostałe  | 2,59  | 148,89                                  |
| <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>27 083 312,70</b>  | <b>28 658 299,90</b>                    |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Strategia New Frontier XIII

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>23 933 996,77</b>  | <b>27 083 312,70</b>        |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>959 493,22</b>   | <b>386 359,73</b>           |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>  | <b>3 101 050,00</b>   | <b>2 853 850,00</b>         |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 3 101 050,00  | 2 853 850,00                |
| 2. pozostałe przychody  | 0,00  | 0,00                        |
| 3. pozostałe zwiększenia  | 0,00  | 0,00                        |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>  | <b>2 141 556,78</b>   | <b>2 467 490,27</b>         |
| 1. tytułem wykupu   | 2 141 556,78  | 2 467 490,27                |
| 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>2 189 822,71</b>   | <b>1 188 627,47</b>         |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>27 083 312,70</b>  | <b>28 658 299,90</b>        |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**Strategia New Frontier XIII**

**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                                   | 370 894,69   | 383 616,33                  |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 383 616,33   | 388 745,25                  |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                            |  |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 64,53  | 70,60                       |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 64,53  | 67,17                       |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 79,92  | 76,21                       |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 70,60  | 73,72                       |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Strategia New Frontier XIII

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

|   | 1 | 2                        | 3                                      |
|---|---|--------------------------|--|
|   |   | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| <b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>  |   | <b>28 501 001,23</b>     | <b>99,45%</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   |   | 28 501 001,23            | 99,45%                                 |
| 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>157 149,78</b>        | <b>0,55%</b>                           |
| <b>III. Należności</b>  |   | <b>148,89</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>28 658 299,90</b>     | <b>100,00%</b>                         |
| 1. krajowe  |   | 157 298,67               | 0,55%                                  |
| 2. zagraniczne – państwa UE   |   | 28 501 001,23            | 99,45%                                 |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE  |   | 0,00                     | 0,00%                                  |