

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 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
I.	Aktywa	103 335 576,45	301 269 674,05
1.	lokaty	102 210 170,91	300 083 879,41
2.	środki pieniężne	1 019 539,19	861 498,74
3.	należności	105 866,35	324 295,90
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	105 866,35	324 295,90
II.	Zobowiązania	1 834 375,85	2 848 350,33
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	1 834 375,85	2 848 350,33
III.	Aktywa netto (I-II)	101 501 200,60	298 421 323,72

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 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
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	27 792 277,29	101 501 200,60
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	70 972 919,75	186 651 067,23
I.	Zwiększenia funduszu	103 657 920,96	298 839 358,59
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	103 657 920,96	298 839 358,59
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
II.	Zmniejszenia funduszu	32 685 001,21	112 188 291,36
1.	tytułem wykupu	32 685 001,21	112 188 291,36
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	2 736 003,56	10 269 055,89
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	101 501 200,60	298 421 323,72

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 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
I. Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	275 172,92	950 312,04
2. na koniec okresu sprawozdawczego	950 312,04	2 652 862,90
II. Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	101,00	106,81
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	98,58	106,68
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	106,81	112,49
4. na koniec okresu sprawozdawczego	106,81	112,49

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 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
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I. Lokaty (suma 1-12)		300 083 879,41	100,56%
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		300 083 879,41	100,56%
6.1 jednostki uczestnictwa		191 274 688,77	64,10%
6.2 certyfikaty inwestycyjne		108 809 190,64	36,46%
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		861 498,74	0,29%
III. Należności		324 295,90	0,11%
IV. Zobowiązania		2 848 350,33	0,95%
V. Aktywa netto (w tym)		298 421 323,72	100,00%
1. krajowe		298 421 323,72	100,00%
2. zagraniczne – państwa UE		0,00	0,00%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%