

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**EUROPA FUND POBP/2011/02**

**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>23 535 537,46</b>  | <b>30 342 820,03</b>                    |
| 1.          | lokaty   | 23 444 514,62   | 30 175 333,54                           |
| 2.          | środki pieniężne   | 90 338,40   | 167 300,88                              |
| 3.          | należności   | 684,44  | 185,61                                  |
| 3.1.        | <i>z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>                     | <i>0,00</i>   | <i>0,00</i>                             |
| 3.2.        | <i>pozostałe</i>   | <i>684,44</i>   | <i>185,61</i>                           |
| <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>23 535 537,46</b>  | <b>30 342 820,03</b>                    |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**EUROPA FUND POBP/2011/02**

**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>28 027 035,34</b>  | <b>23 535 537,46</b>        |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>1 436 924,28</b>   | <b>196 782,54</b>           |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>  | <b>2 443 350,00</b>   | <b>2 269 650,00</b>         |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 2 443 350,00  | 2 269 650,00                |
| 2. pozostałe przychody  | 0,00  | 0,00                        |
| 3. pozostałe zwiększenia  | 0,00  | 0,00                        |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>  | <b>1 006 425,72</b>   | <b>2 072 867,46</b>         |
| 1. tytułem wykupu   | 1 006 425,72  | 2 072 867,46                |
| 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>-5 928 422,16</b>  | <b>6 610 500,03</b>         |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>23 535 537,46</b>  | <b>30 342 820,03</b>        |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

**EUROPA FUND POBP/2011/02**

**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                                   | 132 489,53  | 139 445,06                  |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 139 445,06  | 140 132,18                  |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                            |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 211,54  | 168,78                      |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 157,32  | 157,99                      |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 237,10  | 220,29                      |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 168,78  | 216,53                      |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

EUROPA FUND POBP/2011/02

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- PÓŁROCZNE

|   | 1 | Wartość bilansowa (w zł) | 2                    | Udział w aktywach netto funduszu (w %) | 3              |
|---|---|--------------------------|----------------------|--|----------------|
| <b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>  |   |                          | <b>30 175 333,54</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   |   |                          | 30 175 333,54        |  | 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>167 300,88</b>    |  | <b>0,55%</b>   |
| <b>III. Należności</b>  |   |                          | <b>185,61</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>30 342 820,03</b> |  | <b>100,00%</b> |
| 1. krajowe  |   |                          | 167 486,49           |  | 0,55%          |
| 2. zagraniczne – państwa UE   |   |                          | 30 175 333,54        |  | 99,45%         |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE  |   |                          | 0,00                 |  | 0,00%          |