

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Pareto - New Frontier II

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	25 127 119,87	24 620 699,07
1.	lokaty	24 995 546,71	24 401 711,92
2.	środki pieniężne	131 374,19	218 987,15
3.	należności	198,97	0,00
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	198,97	0,00
II.	Zobowiązania	0,00	308,53
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	308,53
III.	Aktywa netto (I-II)	25 127 119,87	24 620 390,54

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Pareto - New Frontier II

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	24 300 887,97	25 127 119,87
B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-973 559,23	-1 498 242,18
I. Zwiększenia funduszu	2 505 050,00	2 132 800,00
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 505 050,00	2 132 800,00
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
II. Zmniejszenia funduszu	3 478 609,23	3 631 042,18
1. tytułem wykupu	3 478 609,23	3 631 042,18
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	1 799 791,13	991 512,85
D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	25 127 119,87	24 620 390,54

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Pareto - New Frontier II

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	257 043,45	247 387,22
2. na koniec okresu sprawozdawczego	247 387,22	233 037,30
II. Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1. na początek okresu sprawozdawczego	94,54	101,57
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	94,54	97,44
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	108,28	108,35
4. na koniec okresu sprawozdawczego	101,57	105,65

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

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

Pareto - New Frontier II

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- PÓŁROCZNE

1		2	3
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I.	Lokaty (suma 1-12)	24 401 711,92	99,11%
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	24 401 711,92	99,11%
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	218 987,15	0,89%
III.	Należności	0,00	0,00%
IV.	Zobowiązania	308,53	0,00%
V.	Aktywa netto (w tym)	24 620 390,54	100,00%
1.	krajowe	218 678,62	0,89%
2.	zagraniczne – państwa UE	24 401 711,92	99,11%
3.	zagraniczne – państwa poza UE	0,00	0,00%