

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2018 r.

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

Strategia New Frontier XII

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|
| I. | Aktywa | 26 041 321,36 | 26 766 014,39 |
| 1. | lokaty | 25 905 402,96 | 26 579 775,78 |
| 2. | środki pieniężne | 133 895,41 | 184 399,71 |
| 3. | należności | 2 022,99 | 1 838,90 |
| 3.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2. | pozostałe | 2 022,99 | 1 838,90 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 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 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 26 041 321,36 | 26 766 014,39 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2018 r.

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

Strategia New Frontier XII

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 | 25 174 993,36 | 26 041 321,36 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | -284 324,43 | -448 122,26 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 2 576 400,00 | 2 321 350,00 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 2 576 400,00 | 2 321 350,00 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 2 860 724,43 | 2 769 472,26 |
| 1. | tytułem wykupu | 2 860 724,43 | 2 769 472,26 |
| 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 | 1 150 652,43 | 1 172 815,29 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 26 041 321,36 | 26 766 014,39 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2018 r.

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

Strategia New Frontier XII

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 | 488 360,69 | 482 962,19 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 482 962,19 | 475 080,13 |
| II. Wartość jednostki rozrachunkowej: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 51,55 | 53,92 |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 49,26 | 50,46 |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 55,41 | 56,61 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 53,92 | 56,34 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2018 r.

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

Strategia New Frontier XII

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

| | 1 | 2 | 3 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|--------------------------|----------------------------------------|
| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I. Lokaty (suma 1-12) | | 26 579 775,78 | 99,30% |
| 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 | | 26 579 775,78 | 99,30% |
| 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 | | 184 399,71 | 0,69% |
| III. Należności | | 1 838,90 | 0,01% |
| IV. Zobowiązania | | 0,00 | 0,00% |
| V. Aktywa netto (w tym) | | 26 766 014,39 | 100,00% |
| 1. krajowe | | 186 238,61 | 0,70% |
| 2. zagraniczne – państwa UE | | 26 579 775,78 | 99,30% |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE | | 0,00 | 0,00% |