

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 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 | 26 766 014,39 | 28 093 755,01 |
| 1. | lokaty | 26 579 775,78 | 27 866 720,95 |
| 2. | środki pieniężne | 184 399,71 | 226 645,83 |
| 3. | należności | 1 838,90 | 388,23 |
| 3.1 | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2 | pozostałe | 1 838,90 | 388,23 |
| 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) | 26 766 014,39 | 28 093 755,01 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 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 | 26 041 321,36 | 26 766 014,39 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | -448 122,26 | -482 285,75 |
| I. Zwiększenia funduszu | 2 321 350,00 | 2 110 200,00 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 2 321 350,00 | 2 110 200,00 |
| 2. pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 2 769 472,26 | 2 592 485,75 |
| 1. tytułem wykupu | 2 769 472,26 | 2 592 485,75 |
| 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 | 1 172 815,29 | 1 810 026,37 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 26 766 014,39 | 28 093 755,01 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 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 | 482 962,19 | 475 080,13 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 475 080,13 | 467 139,26 |
| II. Wartość jednostki rozrachunkowej: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 53,92 | 56,34 |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 50,46 | 54,12 |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 56,61 | 60,67 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 56,34 | 60,14 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Strategia New Frontier XII

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

| | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|----------------------------------------|
| 1 | 2 | 3 |
| I. Lokaty (suma 1-12) | 27 866 720,95 | 99,19% |
| 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 | 27 866 720,95 | 99,19% |
| 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 | 226 645,83 | 0,81% |
| III. Należności | 388,23 | 0,00% |
| IV. Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| V. Aktywa netto (w tym) | 28 093 755,01 | 100,00% |
| 1. krajowe | 227 034,06 | 0,81% |
| 2. zagraniczne – państwa UE | 27 866 720,95 | 99,19% |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE | 0,00 | 0,00% |