

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

**Pareto II - New Frontier V**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>33 435 494,94</b>	<b>34 507 095,57</b>
1.	lokaty	32 973 459,35	34 222 906,07
2.	środki pieniężne	234 266,96	284 189,50
3.	należności	227 768,63	0,00
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2	pozostałe	227 768,63	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>2 127,77</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	2 127,77
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>33 435 494,94</b>	<b>34 504 967,80</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

**Pareto II - New Frontier V**

**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>	<b>32 097 942,99</b>	<b>33 435 494,94</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-25 683,75</b>	<b>-783 065,47</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>3 089 200,00</b>	<b>2 556 150,00</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	3 089 200,00	2 556 150,00
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>3 114 883,75</b>	<b>3 339 215,47</b>
1. tytułem wykupu	3 114 883,75	3 339 215,47
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>1 363 235,70</b>	<b>1 852 538,33</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>33 435 494,94</b>	<b>34 504 967,80</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Pareto II - New Frontier V

III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	476 301,28	476 017,87
2. na koniec okresu sprawozdawczego	476 017,87	464 713,37
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	67,39	70,24
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	63,62	68,08
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	70,60	75,28
4. na koniec okresu sprawozdawczego	70,24	74,25

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Pareto II - New Frontier V

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

	1	2	3
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
<b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>		<b>34 222 906,07</b>	<b>99,18%</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		34 222 906,07	99,18%
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>284 189,50</b>	<b>0,82%</b>
<b>III. Należności</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV. Zobowiązania</b>		<b>2 127,77</b>	<b>0,01%</b>
<b>V. Aktywa netto (w tym)</b>		<b>34 504 967,80</b>	<b>100,00%</b>
1. krajowe		282 061,73	0,82%
2. zagraniczne – państwa UE		34 222 906,07	99,18%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%