

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 VI**

**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>31 643 467,64</b>	<b>32 333 188,22</b>
1.	lokaty	31 192 968,16	32 059 912,25
2.	środki pieniężne	228 412,89	273 275,97
3.	należności	222 086,59	0,00
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2	pozostałe	222 086,59	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>1 161,72</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	1 161,72
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>31 643 467,64</b>	<b>32 332 026,50</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 VI**

**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>30 451 166,67</b>	<b>31 643 467,64</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-150 369,79</b>	<b>-1 070 953,92</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>2 762 750,00</b>	<b>2 458 250,00</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 762 750,00	2 458 250,00
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>2 913 119,79</b>	<b>3 529 203,92</b>
1. tytułem wykupu	2 913 119,79	3 529 203,92
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>1 342 670,76</b>	<b>1 759 512,78</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>31 643 467,64</b>	<b>32 332 026,50</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 VI**

**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	521 870,89	519 341,34
2. na koniec okresu sprawozdawczego	519 341,34	501 116,34
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	58,35	60,93
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	55,13	59,26
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	61,21	65,41
4. na koniec okresu sprawozdawczego	60,93	64,52

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 VI

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>32 059 912,25</b>	<b>99,16%</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		32 059 912,25	99,16%
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>273 275,97</b>	<b>0,85%</b>
<b>III. Należności</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV. Zobowiązania</b>		<b>1 161,72</b>	<b>0,00%</b>
<b>V. Aktywa netto (w tym)</b>		<b>32 332 026,50</b>	<b>100,00%</b>
1. krajowe		272 114,25	0,84%
2. zagraniczne – państwa UE		32 059 912,25	99,16%
3. zagraniczne – państwa poza UE		0,00	0,00%