

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Niebieska (umiarkowane ryzyko)"

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|---|---|
| I. | Aktywa | 98 645 725,93 | 38 129 112,91 |
| 1. | lokaty | 95 206 480,21 | 38 058 858,27 |
| 2. | środki pieniężne | 190,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 3 439 055,72 | 70 254,64 |
| 3.1 | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2 | pozostałe | 3 439 055,72 | 70 254,64 |
| II. | Zobowiązania | 7 770 418,47 | 460 327,81 |
| 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 | 7 770 418,47 | 460 327,81 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 90 875 307,46 | 37 668 785,10 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Niebieska (umiarkowane ryzyko)"

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 | 298 421 323,72 | 90 875 307,46 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | -191 526 995,51 | -51 424 212,91 |
| I. Zwiększenia funduszu | 79 089 775,43 | 837 355,23 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 79 089 775,43 | 837 355,23 |
| 2. pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 270 616 770,94 | 52 261 568,14 |
| 1. tytułem wykupu | 270 616 770,94 | 52 261 568,14 |
| 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 | -16 019 020,75 | -1 782 309,45 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 90 875 307,46 | 37 668 785,10 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Niebieska (umiarkowane ryzyko)"

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 | 2 652 862,90 | 885 201,46 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 885 201,46 | 382 812,86 |
| II. Wartość jednostki rozrachunkowej: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 112,49 | 102,66 |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 102,30 | 98,03 |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 113,67 | 106,44 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 102,66 | 98,40 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Niebieska (umiarkowane ryzyko)"

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE

| | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|---|--------------------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| I. Lokaty (suma 1-12) | 38 058 858,27 | 101,04% |
| 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 | 37 668 995,01 | 100,00% |
| 6.1 jednostki uczestnictwa | 23 943 734,72 | 63,56% |
| 6.2 certyfikaty inwestycyjne | 13 725 260,29 | 36,44% |
| 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 | 0,00 | 0,00% |
| 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 | 389 863,26 | 1,03% |
| 12. pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. Należności | 70 254,64 | 0,19% |
| IV. Zobowiązania | 460 327,81 | 1,22% |
| V. Aktywa netto (w tym) | 37 668 785,10 | 100,00% |
| 1. krajowe | 37 668 785,10 | 100,00% |
| 2. zagraniczne – państwa UE | 0,00 | 0,00% |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE | 0,00 | 0,00% |