

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2021 r.

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

**Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"**

**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>1 999 080,76</b>	<b>1 656 240,87</b>
1.	lokaty	1 949 633,88	1 179 680,93
2.	środki pieniężne	49 446,88	256 559,91
3.	należności	0,00	220 000,03
3.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
3.2.	pozostałe	0,00	220 000,03
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>2 202,04</b>	<b>1 838,20</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	2 202,04	1 838,20
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>1 996 878,72</b>	<b>1 654 402,67</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2021 r.

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

**Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"**

**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>3 425 855,91</b>	<b>1 996 878,72</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-1 323 580,78</b>	<b>-449 079,37</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>3 000,00</b>	<b>1 200,00</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	3 000,00	1 200,00
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>1 326 580,78</b>	<b>450 279,37</b>
1. tytułem wykupu	1 000 163,74	382 120,71
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	28 167,45	23 747,90
6. pozostałe koszty	0,00	0,00
7. pozostałe zmniejszenia	298 249,59	44 410,76
<b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>-105 396,41</b>	<b>106 603,32</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>1 996 878,72</b>	<b>1 654 402,67</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2021 r.

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

**Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"**

**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	33 905,94	19 299,11
2. na koniec okresu sprawozdawczego	19 299,11	15 173,83
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	101,04	103,47
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	77,92	102,26
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	104,73	115,57
4. na koniec okresu sprawozdawczego	103,47	109,03

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2021 r.

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

Portfel Modelowy "Strategia Czerwona (wysokie ryzyko)"

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- ROCZNE

	1	Wartość bilansowa (w zł)	2	Udział w aktywach netto funduszu (w %)	3
<b>I. Lokaty (suma 1-12)</b>			<b>1 179 680,93</b>		<b>71,31%</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			1 179 680,93		71,31%
6.1 jednostki uczestnictwa			1 122 138,83		67,83%
6.2 certyfikaty inwestycyjne			57 542,10		3,48%
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			0,00		0,00%
12. pozostałe lokaty			0,00		0,00%
<b>II. Środki pieniężne</b>			<b>256 559,91</b>		<b>15,51%</b>
<b>III. Należności</b>			<b>220 000,03</b>		<b>13,30%</b>
<b>IV. Zobowiązania</b>			<b>1 838,20</b>		<b>0,11%</b>
<b>V. Aktywa netto (w tym)</b>			<b>1 654 402,67</b>		<b>100,00%</b>
1. krajowe			1 654 402,67		100,00%
2. zagraniczne – państwa UE			0,00		0,00%
3. zagraniczne – państwa poza UE			0,00		0,00%