

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

**Strategia New Frontier XI**

**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>53 857 663,19</b>	<b>57 787 754,70</b>
1.	lokaty	53 059 715,58	56 923 999,92
2.	środki pieniężne	797 947,61	861 856,05
3.	należności	0,00	1 898,73
3.1.	<i>z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>	<i>0,00</i>	<i>0,00</i>
3.2.	<i>pozostałe</i>	<i>0,00</i>	<i>1 898,73</i>
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>2 428,84</b>	<b>0,00</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	2 428,84	0,00
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>53 855 234,35</b>	<b>57 787 754,70</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

Strategia New Frontier XI

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>62 275 285,46</b>	<b>53 855 234,35</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-2 879 946,73</b>	<b>-1 130 114,40</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>4 156 650,00</b>	<b>3 716 350,00</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	4 156 650,00	3 716 350,00
2. pozostałe przychody	0,00	0,00
3. pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>7 036 596,73</b>	<b>4 846 464,40</b>
1. tytułem wykupu	7 036 596,73	4 846 464,40
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>-5 540 104,38</b>	<b>5 062 634,75</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>53 855 234,35</b>	<b>57 787 754,70</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

**Strategia New Frontier XI**

**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	944 137,14	897 138,67
2. na koniec okresu sprawozdawczego	897 138,67	879 034,91
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	65,96	60,03
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	57,06	60,03
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	66,12	65,91
4. na koniec okresu sprawozdawczego	60,03	65,74

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

Strategia New Frontier XI

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU – ROCZNE		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>56 923 999,92</b>	<b>98,51%</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	56 923 999,92	98,51%
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.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>861 856,05</b>	<b>1,49%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>1 898,73</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>57 787 754,70</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajoowe	863 754,78	1,49%
2.	zagraniczne – państwa UE	56 923 999,92	98,51%
3.	zagraniczne – państwa poza UE	0,00	0,00%