

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

**UFK Europa Skarbiec Absolute Return Akcji II**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł)      |  | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego<br>poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|---|---|
| <b>I.</b>   | <b>Aktywa</b>  | <b>25 891,17</b>  | <b>0,00</b>                             |
| 1.          | lokaty   | 25 891,17   | 0,00                                    |
| 2.          | środki pieniężne   | 0,00  | 0,00                                    |
| 3.          | należności   | 0,00  | 0,00                                    |
| 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>0,00</i>                             |
| <b>II.</b>  | <b>Zobowiązania</b>  | <b>0,00</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  | 0,00  | 0,00                                    |
| <b>III.</b> | <b>Aktywa netto (I-II)</b>   | <b>25 891,17</b>  | <b>0,00</b>                             |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

**UFK Europa Skarbiec Absolute Return Akcji II**

**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł)  | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| <b>A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            | <b>36 195,22</b>  | <b>25 891,17</b>            |
| <b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>  | <b>-382,20</b>  | <b>-26 697,46</b>           |
| <b>I. Zwiększenia funduszu</b>  | <b>0,00</b>   | <b>0,00</b>                 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 0,00  | 0,00                        |
| 2. pozostałe przychody  | 0,00  | 0,00                        |
| 3. pozostałe zwiększenia  | 0,00  | 0,00                        |
| <b>II. Zmniejszenia funduszu</b>  | <b>382,20</b>   | <b>26 697,46</b>            |
| 1. tytułem wykupu   | 0,00  | 26 697,46                   |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     | 0,00  | 0,00                        |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu           | 5,92  | 0,00                        |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych   | 0,00  | 0,00                        |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 376,28  | 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>-9 921,85</b>  | <b>806,29</b>               |
| <b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>25 891,17</b>  | <b>0,00</b>                 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

**UFK Europa Skarbiec Absolute Return Akcji II**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

| Pozycja   | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| <b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 1,99  | 1,96                        |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 1,96  | 0,00                        |
| <b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                            |   |                             |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego                                   | 18 190,73   | 13 190,15                   |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 11 924,20   | 13 190,15                   |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 18 190,73   | 13 606,39                   |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 13 190,15   | 0,00                        |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2023 r.

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

UFK Europa Skarbiec Absolute Return Akcji II

| 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>0,00</b>              | <b>0,00%</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   | 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.</b>                                     | <b>Środki pieniężne</b>  | <b>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| <b>III.</b>                                    | <b>Należności</b>  | <b>0,00</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>0,00</b>              | <b>0,00%</b>                           |
| 1.   | krajowe  | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 2.   | zagraniczne – państwa UE   | 0,00                     | 0,00%                                  |
| 3.   | zagraniczne – państwa poza UE  | 0,00                     | 0,00%                                  |