

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

**UFK Europa ALTUS Absolutnej Stopy Zwrotu Rynku Polskiego (FIO Parasolowy)**

**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>2 585 235,98</b>	<b>2 625 716,04</b>
1.	lokaty	2 585 235,98	2 625 716,04
2.	środki pieniężne	0,00	0,00
3.	aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00
4.	należności	0,00	0,00
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
4.2.	pozostałe	0,00	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	pozostałe	0,00	0,00
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>2 585 235,98</b>	<b>2 625 716,04</b>

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

**UFK Europa ALTUS Absolutnej Stopy Zwrotu Rynku Polskiego (FIO Parasolowy)**

**II. ZMIANY 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>952 930,49</b>	<b>2 585 235,98</b>
<b>B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>1 622 951,81</b>	<b>-24 359,12</b>
<b>I. Zwiększenia funduszu</b>	<b>2 554 258,87</b>	<b>1 342 598,98</b>
1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 554 258,87	1 342 598,98
2. pozostałe przychody		
3. pozostałe zwiększenia		
<b>II. Zmniejszenia funduszu</b>	<b>931 307,06</b>	<b>1 366 958,10</b>
1. tytułem wykupu	909 021,54	1 341 257,10
2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3. tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	437,06	503,99
4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	21 848,46	25 197,01
6. pozostałe koszty		
7. pozostałe zmniejszenia		
<b>C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>9 353,68</b>	<b>64 839,18</b>
<b>D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>2 585 235,98</b>	<b>2 625 716,04</b>



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

**UFK Europa ALTUS Absolutnej Stopy Zwrotu Rynku Polskiego (FIO Parasolowy)**

**III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I. Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	7 359,6734	19 820,8688
2. na koniec okresu sprawozdawczego	19 820,8688	19 599,2826
<b>II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):</b>		
1. na początek okresu sprawozdawczego	129,48	130,43
2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	128,39	126,85
3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	132,69	135,07
4. na koniec okresu sprawozdawczego	130,43	133,97

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

UFK Europa ALTUS Absolutnej Stopy Zwrotu Rynku Polskiego (FIO Parasolowy)

V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU			
(w zł)		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
I.	Lokaty (suma 1-12)	2 625 716,04	100,00%
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%
1.2	bony skarbowe		0,00%
1.3	inne		0,00%
2.	obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0,00%
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
3.1	notowane na rynku regulowanym		0,00%
3.2	pozostałe	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
4.1	notowane na rynku regulowanym		0,00%
4.2	pozostałe		0,00%
5.	udziały		0,00%
6.	jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	2 625 716,04	100,00%
6.1	jednostki uczestnictwa	2 625 716,04	100,00%
6.2	certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00%
6.2.1.	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0,00%
6.2.2.	innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00%
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
7.1.	opcje		0,00%
7.2.	kontrakty terminowe		0,00%
7.3.	swapy walutowe		0,00%
7.4.	swapy procentowe		0,00%
7.5.	inne instrumenty pochodne		0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
9.1	zabezpieczone hipotecznie		0,00%
9.2	zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		0,00%
9.3	pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0,00%
9.4	inne pożyczki		0,00%
10.	nieruchomości		0,00%
11.	depozyty bankowe	0,00	0,00%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust.9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00%
III.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
IV.	Należności	0,00	0,00%
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	2 625 716,04	100,00%
1.	krajowe	2 625 716,04	100,00%
2.	zagraniczne - kraje UE	0,00	0,00%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%