

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

Pareto Millenium II

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|---|---|---|
| I. | Aktywa | 3 405 303,00 | 2 754 006,10 |
| 1. | lokaty | 0,00 | 0,00 |
| 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 | 3 405 303,00 | 2 753 826,32 |
| 4. | należności | 0,00 | 179,78 |
| 4.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | | |
| 4.2. | pozostałe | 0,00 | 179,78 |
| II. | Zobowiązania | 229 368,75 | 0,00 |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | | |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | | |
| 3. | pozostałe | 229 368,75 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 3 175 934,25 | 2 754 006,10 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

Pareto Millenium II

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|--|-----------------------------|
| A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 1 779 217,96 | 3 175 934,25 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 318 067,96 | -460 535,67 |
| I. Zwiększenia funduszu | 561 400,00 | 451 850,00 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 561 400,00 | 451 850,00 |
| 2. pozostałe przychody | | |
| 3. pozostałe zwiększenia | | |
| II. Zmniejszenia funduszu | 243 332,04 | 912 385,67 |
| 1. tytułem wykupu | 243 332,04 | 912 385,67 |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | | |
| 3. tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 4. tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | | |
| 5. tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00 | 0,00 |
| 6. pozostałe koszty | | |
| 7. pozostałe zmniejszenia | | |
| C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 1 078 648,33 | 38 607,52 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 3 175 934,25 | 2 754 006,10 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

Pareto Millenium II

III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| (w zł) | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| I. Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 40 910,9670 | 47 572,4124 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 47 572,4124 | 40 721,6635 |
| II. Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł): | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 43,49 | 66,76 |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 40,20 | 62,59 |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 66,76 | 82,61 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 66,76 | 67,63 |

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

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

Pareto Millenium II

| V ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU | | | |
|--------------------------------------|--|--------------------------|--|
| (w zł) | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 0,00 | 0,00% |
| 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 | 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% |
| 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 | 2 753 826,32 | 99,99% |
| III. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Należności | 179,78 | 0,01% |
| V. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Aktywa netto (w tym) | 2 754 006,10 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 179,78 | 0,01% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 2 753 826,32 | 99,99% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |