

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Pareto II - New Frontier IV

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|---|---|
| I. | Aktywa | 35 079 525,47 | 39 487 050,72 |
| 1. | lokaty | 35 078 543,62 | 39 372 192,53 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 114 858,19 |
| 3. | należności | 981,85 | 0,00 |
| 3.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2. | pozostałe | 981,85 | 0,00 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 892,00 |
| 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 | 892,00 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 35 079 525,47 | 39 486 158,72 |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Pareto II - New Frontier IV

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|---|-----------------------------|
| A. Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 31 511 628,64 | 35 079 525,47 |
| B. Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 1 986 465,53 | 820 926,48 |
| I. Zwiększenia funduszu | 4 569 100,00 | 4 199 950,00 |
| 1. tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 4 569 100,00 | 4 199 950,00 |
| 2. pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. Zmniejszenia funduszu | 2 582 634,47 | 3 379 023,52 |
| 1. tytułem wykupu | 2 582 634,47 | 3 379 023,52 |
| 2. tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych 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 |
| C. Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 1 581 431,30 | 3 585 706,77 |
| D. Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 35 079 525,47 | 39 486 158,72 |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Pareto II - New Frontier IV

III LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|---|--|-----------------------------|
| I. Liczba jednostek rozrachunkowych: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 485 765,82 | 514 362,54 |
| 2. na koniec okresu sprawozdawczego | 514 362,54 | 525 151,73 |
| II. Wartość jednostki rozrachunkowej: | | |
| 1. na początek okresu sprawozdawczego | 64,87 | 68,20 |
| 2. minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 62,91 | 68,20 |
| 3. maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 79,79 | 81,72 |
| 4. na koniec okresu sprawozdawczego | 68,20 | 75,19 |

Półroczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Pareto II - New Frontier IV

IV ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU- PÓLROCZNE

| | 1 | 2 | 3 |
|---|---|--------------------------|--|
| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
| I. Lokaty (suma 1-12) | | 39 372 192,53 | 99,71% |
| 1. papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | | 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% |
| 4. akcje | | 0,00 | 0,00% |
| 5. udziały | | 0,00 | 0,00% |
| 6. jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | | 0,00 | 0,00% |
| 7. instrumenty pochodne | | 0,00 | 0,00% |
| 8. inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu | | 39 372 192,53 | 99,71% |
| 9. 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% |
| II. Środki pieniężne | | 114 858,19 | 0,29% |
| III. Należności | | 0,00 | 0,00% |
| IV. Zobowiązania | | 892,00 | 0,00% |
| V. Aktywa netto (w tym) | | 39 486 158,72 | 100,00% |
| 1. krajowe | | 113 966,19 | 0,29% |
| 2. zagraniczne – państwa UE | | 39 372 192,53 | 99,71% |
| 3. zagraniczne – państwa poza UE | | 0,00 | 0,00% |