Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: **Strategia New Frontier XII**

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	**Aktywa**	**8 873 280,00**	**4 724 496,00**
1.	lokaty		0,00
2.	środki pieniężne		0,00
3.	aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej	8 873 280,00	4 724 496,00
4.	należności		0,00
4.1.	*z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym*		
4.2.	*pozostałe*		***0,00***
II.	**Zobowiązania**	**32 862,09**	**15 520,99**
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	pozostałe	32 862,09	15 520,99
III.	**Aktywa netto (I-II)**	**8 840 417,91**	**4 708 975,01**

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: **Strategia New Frontier XII**

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	**Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego**	**0,00**	**8 840 417,91**
B.	**Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)**	**14 936 418,15**	**3 555 905,48**
I.	**Zwiększenia funduszu**	**14 965 650,00**	**3 667 900,11**
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	14 965 650,00	3 667 900,11
2.	pozostałe przychody		
3.	pozostałe zwiększenia		
II.	**Zmniejszenia funduszu**	**29 231,85**	**111 994,63**
1.	tytułem wykupu	29 231,85	111 994,63
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z fuduszu		0,00
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem		0,00
6.	pozostałe koszty		
7.	pozostałe zmniejszenia		
C.	**Wynik netto z działalności inwestycyjnej**	**-6 096 000,24**	**-7 687 348,38**
D.	**Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego**	**8 840 417,91**	**4 708 975,01**

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: **Strategia New Frontier XII**

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	0,0000	76 653,2378
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	76 653,2378	135 432,1257
II.	**Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):**		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	0,00	115,33
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	111,77	29,97
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	200,00	121,71
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	115,33	34,77

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011 r.

Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie Europa S.A.
Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego: **Strategia New Frontier XII**

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%
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%
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*	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*	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%
II.	**Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.. 154 ust.9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej**	**4 724 496,00**	**100,33%**
III.	**Środki pieniężne**	**0,00**	**0,00%**
IV	**Należności**	**0,00**	**0,00%**
V.	**Zobowiązania**	**15 520,99**	**0,33%**
VI.	**Aktywa netto (w tym)**	**4 708 975,01**	**100,00%**
1.	krajowe	-15 520,99	-0,33%
2.	zagraniczne - kraje UE	4 724 496,00	100,33%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%