

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

Nazwa zakładu ubezpieczeń: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA" Spółka Akcyjna**

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

**Fundusz Stabilny Portfel Aktywów**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>194 732 113,02</b>	<b>110 812 811,83</b>
1.	lokaty	189 182 454,97	110 299 430,22
2.	środki pieniężne	5 033 175,55	63 964,82
3.	należności	516 482,50	449 416,79
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	516 482,50	449 416,79
3.2	pozostałe	0,00	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>857 909,41</b>	<b>2 105 168,26</b>
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	200 484,31	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	657 425,10	2 105 168,26
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I - II)</b>	<b>193 874 203,61</b>	<b>108 707 643,57</b>

**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>	<b>497 643 630,43</b>	<b>193 874 203,61</b>
<b>B.</b>	<b>Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-309 795 246,31</b>	<b>-89 658 435,45</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>7 073 856,81</b>	<b>2 916 045,73</b>
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	450 996,94	124 153,45
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	6 622 859,87	2 791 892,28
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>316 869 103,12</b>	<b>92 574 481,18</b>
1.	tytułem wykupu	303 640 210,18	83 848 142,13
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	7 902 708,47	1 678 380,56
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	111 070,61	75 046,43
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	3 738 464,11	1 520 255,04
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	1 476 649,75	5 452 657,02
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>6 025 819,49</b>	<b>4 491 875,41</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>193 874 203,61</b>	<b>108 707 643,57</b>

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

Nazwa zakładu ubezpieczeń: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA" Spółka Akcyjna**

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

**Fundusz Stabilny Portfel Aktywów****III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU**

Pozycja		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I.</b>	<b>Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	386 639,4456	148 949,5345
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	148 949,5345	81 048,8970
<b>II.</b>	<b>Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	1 287,10	1 301,61
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	1 287,10	1 294,78
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	1 312,11	1 341,72
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 301,61	1 341,26

**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

1		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
		2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>110 299 430,22</b>	<b>101,46%</b>
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	85 497 596,58	78,65%
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	16 833 760,29	15,49%
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	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty bankowe	7 968 073,35	7,33%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>63 964,82</b>	<b>0,06%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>449 416,79</b>	<b>0,41%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>2 105 168,26</b>	<b>1,94%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>108 707 643,57</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	107 749 269,80	99,12%
2.	zagraniczne - kraje UE	958 373,77	0,88%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2017 r.

Nazwa zakładu ubezpieczeń: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA" Spółka Akcyjna**

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

**Fundusz Stabilny Portfel Aktywów**

**V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>110 299 430,22</b>	<b>101,46%</b>
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	85 497 596,58	78,65%
1.1	obligacje	85 497 596,58	78,65%
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	16 833 760,29	15,49%
3.1	notowane na rynku regulowanym	3 043 960,57	2,80%
3.2	pozostałe	13 789 799,72	12,69%
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	7 968 073,35	7,33%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>63 964,82</b>	<b>0,06%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>449 416,79</b>	<b>0,41%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>2 105 168,26</b>	<b>1,94%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>108 707 643,57</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	107 749 269,80	99,12%
2.	zagraniczne - kraje UE	958 373,77	0,88%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%