

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:

WARTA Obligacji Rynków Wschodzących**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	0,00	72 274,77
1.	lokaty	0,00	72 202,06
2.	środki pieniężne	0,00	72,62
3.	należności	0,00	0,09
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,09
3.2	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	0,00	104,37
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	104,37
III.	Aktywa netto (I - II)	0,00	72 170,40

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	491 822,66	0,00
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	-501 634,30	73 056,16
I.	Zwiększenia funduszu	25 670,71	119 473,69
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	0,00	117 011,50
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	25 670,71	2 462,19
II.	Zmniejszenia funduszu	527 305,01	46 417,53
1.	tytułem wykupu	522 463,87	4 260,09
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	1 874,76	41 692,53
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	2 966,36	349,46
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	0,02	115,45
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	9 811,64	-885,76
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	0,00	72 170,40

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:

WARTA Obligacji Rynków Wschodzących**III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU**

	Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I.	Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	4 983,0057	0,0000
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	0,0000	626,0987
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	98,70	108,51
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	96,38	108,45
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	110,42	115,42
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	108,51	115,27

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	72 202,06	100,04%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	2 587,78	3,59%
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	66 949,78	92,77%
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	1 804,57	2,50%
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	859,93	1,19%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	72,62	0,10%
III.	Należności	0,09	0,00%
IV.	Zobowiązania	104,37	0,14%
V.	Aktywa netto (w tym)	72 170,40	100,00%
1.	krajowe	3 416,05	4,73%
2.	zagraniczne - kraje UE	16 986,93	23,54%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	51 767,42	71,73%

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:

WARTA Obligacji Rynków Wschodzących

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	72 202,06	100,04%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	2 587,78	3,59%
1.1	obligacje	2 587,78	3,59%
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	66 949,78	92,77%
3.1	notowane na rynku regulowanym	66 949,78	92,77%
3.2	pozostałe	0,00	0,00%
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	1 804,57	2,50%
7.1	opcje	0,00	0,00%
7.2	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
7.3	swapy walutowe	1 804,57	2,50%
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	859,93	1,19%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	72,62	0,10%
III.	Należności	0,09	0,00%
IV.	Zobowiązania	104,37	0,14%
V.	Aktywa netto (w tym)	72 170,40	100,00%
1.	krajowe	3 416,05	4,73%
2.	zagraniczne - kraje UE	16 986,93	23,54%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	51 767,42	71,73%