

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

NAZWA ZAKŁADU UBEZPIECZEŃ: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA " Spółka Akcyjna**

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

**WARTA Novo Papierów Dłużnych****I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

|   | ( w zł ) | Koniec analogicznego<br>okresu<br>sprawozdawczego<br>poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Koniec bieżącego<br>okresu<br>sprawozdawczego |
|---|----------|--|---|
| <b>I. Aktywa</b>  |          | <b>2 153 684,84</b>  | <b>1 624 494,16</b>                           |
| 1. lokaty   |          | 2 153 684,84   | 1 624 494,16                                  |
| 2. środki pieniężne   |          | 0,00   | 0,00  |
| 3. aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy z dnia 22 maja 2003r. o działalności ubezpieczeniowej |          | 0,00   | 0,00  |
| 4. należności   |          | 0,00   | 0,00  |
| 4.1 z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym   |          | 0,00   | 0,00  |
| 4.2 pozostałe   |          | 0,00   | 0,00  |
| <b>II. Zobowiązania</b>   |          | <b>0,00</b>  | <b>0,00</b>                                   |
| 1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym  |          | 0,00   | 0,00  |
| 2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia                                  |          | 0,00   | 0,00  |
| 3. Pozostałe  |          | 0,00   | 0,00  |
| <b>III. Aktywa netto ( I - II )</b>   |          | <b>2 153 684,84</b>  | <b>1 624 494,16</b>                           |

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

NAZWA ZAKŁADU UBEZPIECZEŃ: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA " Spółka Akcyjna**

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

**WARTA Novo Papierów Dłużnych****II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

|            | ( w zł )   | Analogiczny okres<br>sprawozdawczy<br>poprzedniego roku<br>kalendarzowego | Bieżący okres<br>sprawozdawczy |
|------------|--|---|--------------------------------|
| <b>A.</b>  | <b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>                            | <b>1 880 092,21</b>   | <b>2 153 684,84</b>            |
| <b>B.</b>  | <b>Stan netto z działalności operacyjnej ( I- II )</b>                                     | <b>83 639,83</b>  | <b>-501 912,52</b>             |
| <b>I.</b>  | <b>Zwiększenia funduszu</b>  | <b>911 019,96</b>   | <b>816 285,43</b>              |
| 1.         | tytułem składek zwiększających wartość funduszu  | 305 530,46  | 224 177,68                     |
| 2.         | pozostałe przychody  | 0,00  | 0,00                           |
| 3.         | pozostałe zwiększenia  | 605 489,50  | 592 107,75                     |
| <b>II.</b> | <b>Zmniejszenia funduszu</b>   | <b>827 380,13</b>   | <b>1 318 197,95</b>            |
| 1.         | tytułem wykupu   | 394 731,77  | 503 344,72                     |
| 2.         | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych                                     | 4 776,25  | 13 624,43                      |
| 3.         | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu           | 50 123,97   | 64 668,46                      |
| 4.         | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych   | 0,00  | 0,00                           |
| 5.         | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 6 708,89  | 0,00                           |
| 6.         | pozostałe koszty   | 3 642,12  | 0,00                           |
| 7.         | pozostałe zmniejszenia   | 367 397,13  | 736 560,34                     |
| <b>C.</b>  | <b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>  | <b>189 952,80</b>   | <b>-27 278,16</b>              |
| <b>D.</b>  | <b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>                              | <b>2 153 684,84</b>   | <b>1 624 494,16</b>            |

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

NAZWA ZAKŁADU UBEZPIECZEŃ: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA " Spółka Akcyjna**

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

**WARTA Novo Papierów Dłużnych****III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

|            | Pozycja  | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|--|--|-----------------------------|
| <b>I.</b>  | <b>Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>                             |  |                             |
| 1.         | na początek okresu sprawozdawczego                                   | 10 242,3851  | 10 587,9005                 |
| 2.         | na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 10 587,9005  | 8 052,8140                  |
| <b>II.</b> | <b>Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>                             |  |                             |
| 1.         | na początek okresu sprawozdawczego                                   | 183,56   | 203,41                      |
| 2.         | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym  | 182,40   | 195,96                      |
| 3.         | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 203,41   | 208,21                      |
| 4.         | na koniec okresu sprawozdawczego                                     | 203,41   | 201,73                      |

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

NAZWA ZAKŁADU UBEZPIECZEŃ: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA " Spółka Akcyjna**

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

**WARTA Novo Papierów Dłużnych****IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

|             |  | Wartość bilansowa<br>(w zł.) | Udział w aktywach<br>netto funduszu (w %) |
|-------------|--|------------------------------|---|
|             | 1  | 2                            | 3   |
| <b>I.</b>   | <b>Lokaty (suma 1-12)</b>  | <b>1 624 494,16</b>          | <b>100,00%</b>                            |
| 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  | 1 624 494,16                 | 100,00%                                   |
| 7.          | instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych               | 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   | 0,00                         | 0,00%                                     |
| 12.         | pozostałe lokaty   | 0,00                         | 0,00%                                     |
| <b>II.</b>  | <b>Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust 9 ustawy z dnia 22 maja 2003r. o działalności ubezpieczeniowej</b>                          | <b>0,00</b>                  | <b>0,00%</b>                              |
| <b>III.</b> | <b>Środki pieniężne</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>0,00%</b>                              |
| <b>IV.</b>  | <b>Należności</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>0,00%</b>                              |
| <b>V.</b>   | <b>Zobowiązania</b>  | <b>0,00</b>                  | <b>0,00%</b>                              |
| <b>VI.</b>  | <b>Aktywa netto ( w tym)</b>   | <b>1 624 494,16</b>          | <b>100,00%</b>                            |
| 1.          | <i>krajowe</i>   | 1 624 494,16                 | 100,00%                                   |
| 2.          | <i>zagraniczne - kraje UE</i>  | 0,00                         | 0,00%                                     |
| 3.          | <i>zagraniczne - kraje poza UE</i>   | 0,00                         | 0,00%                                     |

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2015 r.

NAZWA ZAKŁADU UBEZPIECZEŃ: **Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie "WARTA" Spółka Akcyjna**

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

**WARTA Novo Papierów Dłużnych**

**V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

|             |  | Wartość bilansowa<br>(w zł) | Udział w aktywach<br>netto funduszu (w %) |
|-------------|--|-----------------------------|---|
|             | 1  | 2                           | 3   |
| <b>I.</b>   | <b>Lokaty (suma 1-12)</b>  | <b>1 624 494,16</b>         | <b>100,00%</b>                            |
| 1.          | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 1.1         | <i>obligacje</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 1.2         | <i>bony skarbowe</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 1.3         | <i>inne</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 2.          | obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związku jednostek samorządu terytorialnego                                  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 3.          | inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 3.1         | <i>notowane na rynku regulowanym</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 3.2         | <i>pozostałe</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 4.          | akcje  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 4.1         | <i>notowane na rynku regulowanym</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 4.2         | <i>pozostałe</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 5.          | udziały  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 6.          | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych  | 1 624 494,16                | 100,00%                                   |
| 6.1         | <i>jednostki uczestnictwa</i>  | 1 624 494,16                | 100,00%                                   |
| 6.2         | <i>certyfikaty inwestycyjne</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 6.2.1       | <i>funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 6.2.2       | <i>innych funduszy inwestycyjnych</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.          | instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieceniowych                | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.1         | <i>opcje</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.2         | <i>kontrakty terminowe</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.3         | <i>swapy walutowe</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.4         | <i>swapy procentowe</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 7.5         | <i>inne instrumenty pochodne</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 8.          | inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 9.          | pożyczki   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 9.1         | <i>zabezpieczone hipotecznie</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 9.2         | <i>zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 9.3         | <i>pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 9.4         | <i>inne pożyczki</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 10.         | nieruchomości  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 11.         | depozyty bankowe   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 12.         | pozostałe lokaty   | 0,00                        | 0,00%                                     |
| <b>II.</b>  | <b>Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej</b>                       | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                              |
| <b>III.</b> | <b>Środki pieniężne</b>  | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                              |
| <b>IV.</b>  | <b>Należności</b>  | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                              |
| <b>V.</b>   | <b>Zobowiązania</b>  | <b>0,00</b>                 | <b>0,00%</b>                              |
| <b>VI.</b>  | <b>Aktywa netto ( w tym)</b>   | <b>1 624 494,16</b>         | <b>100,00%</b>                            |
| 1.          | <i>krajowe</i>   | 1 624 494,16                | 100,00%                                   |
| 2.          | <i>zagraniczne - kraje UE</i>  | 0,00                        | 0,00%                                     |
| 3.          | <i>zagraniczne - kraje poza UE</i>   | 0,00                        | 0,00%                                     |