

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Fundusz Złote Źródła II**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|--|--|---|
| I. | Aktywa | 0,00 | 10 115 180,37 |
| 1. | lokaty | 0,00 | 10 115 180,37 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 0,00 | 0,00 |
| 3.1 | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2 | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 517 189,90 |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 517 189,90 |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I - II) | 0,00 | 9 597 990,47 |

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 | 0,00 | 0,00 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | 0,00 | 9 573 508,06 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 0,00 | 10 333 806,95 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 0,00 | 10 333 469,96 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 0,00 | 336,99 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 0,00 | 760 298,89 |
| 1. | tytułem wykupu | 0,00 | 509 258,91 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 45 521,78 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu | 0,00 | 103 334,70 |
| 4. | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 5. | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00 | 96 635,91 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 5 547,59 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 0,00 | 24 482,41 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 0,00 | 9 597 990,47 |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Fundusz Złote Źródła II**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 | 0,0000 | 0,0000 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 0,0000 | 97 037,6147 |
| II. | Wartość jednostki uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 0,00 | 0,00 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 0,00 | 0,00 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 0,00 | 100,77 |
| 4. | na koniec okresu sprawozdawczego | 0,00 | 98,91 |

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|-----------------------------|--|
| 1 | | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 10 115 180,37 | 105,39% |
| 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 | 9 505 903,06 | 99,04% |
| 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 | 212 118,19 | 2,21% |
| 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 | 397 159,12 | 4,14% |
| 12. | pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 517 189,90 | 5,39% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 9 597 990,47 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 9 903 062,18 | 103,18% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | -305 071,71 | -3,18% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Fundusz Złote Źródła II

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|-----------------------------|---|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 10 115 180,37 | 105,39% |
| 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 związki jednostek samorządu terytorialnego | 0,00 | 0,00% |
| 3. | inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | 9 505 903,06 | 99,04% |
| 3.1 | <i>notowane na rynku regulowanym</i> | 6 386 250,11 | 66,54% |
| 3.2 | <i>pozostałe</i> | 3 119 652,95 | 32,50% |
| 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 | 0,00 | 0,00% |
| 6.1 | <i>jednostki uczestnictwa</i> | 0,00 | 0,00% |
| 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 | 212 118,19 | 2,21% |
| 7.1 | <i>opcje</i> | 212 118,19 | 2,21% |
| 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 | 397 159,12 | 4,14% |
| 12. | pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 517 189,90 | 5,39% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 9 597 990,47 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 9 903 062,18 | 103,18% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | -305 071,71 | -3,18% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |