

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2012 r.

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

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

Fundusz Warta Europa

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-------------|---|---------------------|---------------------|
| I. | Aktywa | 3 810 280,02 | 3 609 636,19 |
| 1. | Lokaty | 3 810 280,02 | 3 609 636,19 |
| 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 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 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 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I - II) | 3 810 280,02 | 3 609 636,19 |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2012 r.

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

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

Fundusz Warta Europa

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------|--|---------------------|---------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 4 430 262,63 | 3 810 280,02 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I- II) | -691 165,69 | -451 660,98 |
| I. | Zwiększenie funduszu | 9 513,58 | 88,72 |
| 1. | Tytulem składek zwiększających wartość funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 2. | Pozostałe przychody | 9 513,58 | 88,72 |
| 3. | Pozostałe zwiększenia | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 700 679,27 | 451 749,70 |
| 1. | Tytulem wykupu | 664 604,49 | 417 137,23 |
| 2. | Tytulem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 9 662,67 | 11 068,59 |
| 3. | Tytulem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 26 412,11 | 23 543,88 |
| 4. | Tytulem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 5. | Tytulem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00 | 0,00 |
| 6. | Pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | Pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 0,00 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 71 183,08 | 251 017,15 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 3 810 280,02 | 3 609 636,19 |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2012 r.

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

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

Fundusz Warta Europa

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| | Pozycja | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-----------|--|-----------------|---------------|
| 1. | Liczba jednostek rozrachunkowych | | |
| 1.1 | liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 40 422,1043 | 34 105,6213 |
| 1.2 | liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 34 105,6213 | 30 188,4769 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł) | | |
| 2.1 | wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 109,6000 | 111,7200 |
| 2.2 | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 108,0300 | 111,8700 |
| 2.3 | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 112,8600 | 119,5700 |
| 2.4 | wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 111,7200 | 119,5700 |
| | | | |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2012 r.

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

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

Fundusz Warta Europa**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| | Lokaty | Wartość bilansowa (w zł.) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|---------------------------|--|
| | 1 | 2 | 3 |
| 1. | Lokaty (suma 1-12) | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 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 | 3 609 636,19 | 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 stopie 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% |
| II. | Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust 9 ustawy z dnia 22 maja 2003r. o działalności ubezpieczeniowej | 0,00 | 0,00% |
| III. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| V. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Aktywa netto (w tym) | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 0,00 | 0,00% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2012 r.

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

NAZWA UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

Fundusz Warta Europa**V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

| | Lokaty | Wartość bilansowa (w zł.) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|--|---------------------------|--|
| | 1 | 2 | 3 |
| 1. | Lokaty (suma 1-12) | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 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 | 0,00% |
| 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 | 0,00 | 0,00% |
| 3.1 | notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00% |
| 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 | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 6.1 | jednostki uczestnictwa | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 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, 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 | 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 stopie 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 ubezpieczeń na życie | 0,00 | 0,00% |
| 9.4 | inne 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% |
| II. | Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust 9 ustawy z dnia 22 maja 2003r. o działalności ubezpieczeniowej | 0,00 | 0,00% |
| III. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| V. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| VI. | Aktywa netto (w tym) | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 0,00 | 0,00% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 3 609 636,19 | 100,00% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |