

**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 Złote Źródła II****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>10 115 180,37</b>	<b>8 262 484,71</b>
1.	lokaty	10 115 180,37	8 262 484,71
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
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>517 189,90</b>	<b>262 553,16</b>
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	517 189,90	262 553,16
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	0,00	0,00
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I - II)</b>	<b>9 597 990,47</b>	<b>7 999 931,55</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>0,00</b>	<b>9 597 990,47</b>
<b>B.</b>	<b>Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>9 573 508,06</b>	<b>-1 804 743,08</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>10 333 806,95</b>	<b>3 785,56</b>
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	10 333 469,96	0,00
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	336,99	3 785,56
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>760 298,89</b>	<b>1 808 528,64</b>
1.	tytułem wykupu	509 258,91	1 657 469,87
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	45 521,78	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	103 334,70	0,00
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	96 635,91	151 058,77
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	5 547,59	0,00
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>24 482,41</b>	<b>206 684,16</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>9 597 990,47</b>	<b>7 999 931,55</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 Złote Źródła II****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	0,0000	97 037,6147
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	97 037,6147	80 103,4500
<b>II.</b>	<b>Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	0,00	98,91
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	0,00	98,91
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	100,77	100,24
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	98,91	99,87

**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>8 262 484,71</b>	<b>103,28%</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	8 041 918,08	100,52%
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	86 900,59	1,09%
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	133 666,04	1,67%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>262 553,16</b>	<b>3,28%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>7 999 931,55</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	8 175 584,12	102,20%
2.	zagraniczne - kraje UE	-175 652,57	-2,20%
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 Złote Źródła II**

**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>8 262 484,71</b>	<b>103,28%</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	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	8 041 918,08	100,52%
3.1	notowane na rynku regulowanym	5 402 887,07	67,54%
3.2	pozostałe	2 639 031,01	32,99%
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	86 900,59	1,09%
7.1	opcje	86 900,59	1,09%
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	133 666,04	1,67%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>262 553,16</b>	<b>3,28%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>7 999 931,55</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	8 175 584,12	102,20%
2.	zagraniczne - kraje UE	-175 652,57	-2,20%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%