

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO
sporządzone na dzień 31.12.2020 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:
Fundusz db Big Brands

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|--------|--|--|---|
| I. | Aktywa | 3 435 368,53 | 3 053 002,76 |
| 1. | lokaty | 3 435 368,53 | 3 052 955,70 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 0,00 | 47,06 |
| 3.1 | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 47,06 |
| 3.2 | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zobowiązania | 68 286,13 | 1 413,90 |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 68 286,13 | 1 413,90 |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I - II) | 3 367 082,40 | 3 051 588,86 |

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 | 3 717 381,65 | 3 367 082,40 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | -538 324,98 | -550 221,73 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 11 106,98 | 0,00 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 11 106,98 | 0,00 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 549 431,96 | 550 221,73 |
| 1. | tytułem wykupu | 488 432,84 | 497 976,63 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 4. | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 5. | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 60 999,12 | 51 083,64 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 1 161,46 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 188 025,73 | 234 728,19 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 3 367 082,40 | 3 051 588,86 |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO
sporządzone na dzień 31.12.2020 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:
Fundusz db Big Brands

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 | 37 244,5812 | 32 425,6780 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 32 425,6780 | 27 726,5933 |
| II. | Wartość jednostki uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 99,81 | 103,84 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 99,81 | 103,24 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 103,84 | 110,06 |
| 4. | na koniec okresu sprawozdawczego | 103,84 | 110,06 |

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|------|--|--------------------------|--|
| 1 | | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 3 052 955,70 | 100,04% |
| 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 | 0,00 | 0,00% |
| 7. | instrumenty pochodne | 269 668,27 | 8,84% |
| 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 | 2 783 287,43 | 91,21% |
| 12. | pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 47,06 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 1 413,90 | 0,05% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 3 051 588,86 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 2 783 334,49 | 91,21% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 268 254,37 | 8,79% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO
sporządzone na dzień 31.12.2020 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

Fundusz db Big Brands

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------|--|-----------------------------|--|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 3 052 955,70 | 100,04% |
| 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 | 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 | 269 668,27 | 8,84% |
| 7.1 | opcje | 269 668,27 | 8,84% |
| 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 | 2 783 287,43 | 91,21% |
| 12. | pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 47,06 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 1 413,90 | 0,05% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 3 051 588,86 | 100,00% |
| 1. | krajowe | 2 783 334,49 | 91,21% |
| 2. | zagraniczne - kraje UE | 268 254,37 | 8,79% |
| 3. | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |