

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 BPH Obligacji 2**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	5 774 042,28	5 771 458,38
1.	lokaty	5 774 042,28	5 771 458,38
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, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	Pozostałe	0,00	0,00
III.	Aktywa netto (I - II)	5 774 042,28	5 771 458,38

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 BPH Obligacji 2**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	5 870 453,33	5 774 042,28
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I- II)	-521 280,74	-115 171,00
I.	Zwiększenia funduszu	2 112 357,07	1 891 211,58
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	935 893,51	1 118 096,06
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	1 176 463,56	773 115,52
II.	Zmniejszenia funduszu	2 633 637,81	2 006 382,58
1.	tytułem wykupu	1 486 467,51	1 033 943,48
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	755,50	-13 162,23
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	254 307,92	337 917,70
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	18 881,72	0,00
6.	pozostałe koszty	9 541,64	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	863 683,52	647 683,63
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	424 869,69	112 587,10
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	5 774 042,28	5 771 458,38

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 BPH Obligacji 2**III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

	Pozycja	Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku kalendarzowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	1 920,0426	1 758,0311
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 758,0311	1 723,6363
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	3 057,46	3 284,38
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	3 019,40	3 274,05
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	3 299,31	3 366,10
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	3 284,38	3 348,42

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 BPH Obligacji 2**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł.)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	5 771 458,38	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	5 771 458,38	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%
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)	5 771 458,38	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	5 771 458,38	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 BPH Obligacji 2**V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	5 771 458,38	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	<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	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	5 771 458,38	100,00%
6.1	<i>jednostki uczestnictwa</i>	5 771 458,38	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-ubezpieczeniowych	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%
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. 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)	5 771 458,38	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	5 771 458,38	100,00%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	0,00	0,00%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	0,00	0,00%