

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 Obligacji Rynków Wschodzących**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	290 586,68	491 822,66
1.	lokaty	290 502,59	491 370,49
2.	środki pieniężne	84,09	451,55
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	0,62
4.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,62
4.2	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	11 595,39	0,00
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	11 595,39	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)	278 991,29	491 822,66

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 Obligacji Rynków Wschodzących**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	0,00	278 991,29
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I- II)	280 439,50	-142 549,06
I.	Zwiększenia funduszu	283 500,00	247 504,96
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	283 500,00	205 300,00
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	42 204,96
II.	Zmniejszenia funduszu	3 060,50	390 054,02
1.	tytułem wykupu	0,00	29 074,75
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	1 288,14	5 708,50
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	43 549,99
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	1 772,36	311 720,78
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-1 448,21	355 380,43
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	278 991,29	491 822,66

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 Obligacji Rynków Wschodzących**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	0,0000	2 841,3412
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	2 841,3412	4 983,0057
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	0,00	98,19
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	0,00	97,08
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	100,00	102,57
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	98,19	98,70

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 Obligacji Rynków Wschodzących**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł.)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	491 370,49	99,91%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	32 335,95	6,57%
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	432 223,27	87,88%
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, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	7 829,44	1,59%
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	18 981,83	3,86%
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	451,55	0,09%
IV.	Należności	0,62	0,00%
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	491 822,66	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	51 769,95	10,53%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	136 730,86	27,80%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	303 321,85	61,67%

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 Obligacji Rynków Wschodzących

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	491 370,49	99,91%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	32 335,95	6,57%
1.1	<i>obligacje</i>	32 335,95	6,57%
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 związku jednostek samorządu terytorialnego	0,00	0,00%
3.	inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	432 223,27	87,88%
3.1	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	432 223,27	87,88%
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	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, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieceniowych	7 829,44	1,59%
7.1	<i>opcje</i>	0,00	0,00%
7.2	<i>kontrakty terminowe</i>	7 829,44	1,59%
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	18 981,83	3,86%
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	451,55	0,09%
IV.	Należności	0,62	0,00%
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	491 822,66	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	51 769,95	10,53%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	136 730,86	27,80%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	303 321,85	61,67%