

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

Fundusz Wielu Klas Aktywów**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	24 473 895,47	109 881 731,00
1.	lokaty	21 053 610,02	99 631 475,98
2.	środki pieniężne	3 415 995,82	9 691 489,29
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	4 289,63	558 765,73
4.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	4 289,63	558 765,73
4.2	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	241 891,40	800 245,45
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	241 891,40	800 245,45
III.	Aktywa netto (I - II)	24 232 004,07	109 081 485,55

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

Fundusz Wielu Klas Aktywów**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	24 232 004,07
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I- II)	23 896 920,51	85 069 646,99
I.	Zwiększenia funduszu	32 902 572,27	103 988 306,13
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	21 793 019,14	82 937 149,29
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	11 109 553,13	21 051 156,84
II.	Zmniejszenia funduszu	9 005 651,76	18 918 659,14
1.	tytułem wykupu	4 886 973,78	9 840 736,89
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	1 772 466,31
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	163,73	602,01
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	800 301,31
6.	pozostałe koszty	130 757,06	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	3 987 757,19	6 504 552,62
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	335 083,56	-220 165,51
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	24 232 004,07	109 081 485,55

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

Fundusz Wielu Klas Aktywów**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	23 616,5566
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	23 616,5566	102 427,7771
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	0,00	1 026,06
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	997,32	1 026,06
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1 030,38	1 101,02
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 026,06	1 064,96

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

Fundusz Wielu Klas Aktywów**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł.)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	99 631 475,98	91,34%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	22 260 164,60	20,41%
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	17 385 342,19	15,94%
4.	akcje	54 669 068,28	50,12%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	5 316 900,91	4,87%
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	9 691 489,29	8,88%
IV.	Należności	558 765,73	0,51%
V.	Zobowiązania	800 245,45	0,73%
VI.	Aktywa netto (w tym)	109 081 485,55	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	91 100 495,01	83,52%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	8 616 122,36	7,90%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	9 364 868,18	8,59%

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

Fundusz Wielu Klas Aktywów

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	99 631 475,98	91,34%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	22 260 164,60	20,41%
1.1	<i>obligacje</i>	22 260 164,60	20,41%
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	17 385 342,19	15,94%
3.1	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	2 264 847,39	2,08%
3.2	<i>pozostałe</i>	15 120 494,80	13,86%
4.	akcje	54 669 068,28	50,12%
4.1	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	52 222 617,12	47,87%
4.2	<i>pozostałe</i>	2 446 451,16	2,24%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	5 316 900,91	4,87%
6.1	<i>jednostki uczestnictwa</i>	5 316 900,91	4,87%
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	9 691 489,29	8,88%
IV.	Należności	558 765,73	0,51%
V.	Zobowiązania	800 245,45	0,73%
VI.	Aktywa netto (w tym)	109 081 485,55	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	91 100 495,01	83,52%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	8 616 122,36	7,90%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	9 364 868,18	8,59%