

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2019 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 obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I.	Aktywa	249 453,43	721 564,34
1.	lokaty	249 384,67	721 233,97
2.	środki pieniężne	68,44	330,37
3.	należności	0,32	0,00
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,32	0,00
3.2	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	583,97	35,09
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	539,78	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	44,19	35,09
III.	Aktywa netto (I - II)	248 869,46	721 529,25

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	72 170,40	248 869,46
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	174 406,24	450 871,91
I.	Zwiększenia funduszu	303 163,82	840 241,46
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	302 781,06	696 788,50
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	382,76	143 452,96
II.	Zmniejszenia funduszu	128 757,58	389 369,55
1.	tytułem wykupu	16 280,64	29 804,41
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	104 286,18	180 634,42
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	2 569,15	7 103,70
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	5 621,61	171 827,02
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	2 292,82	21 787,88
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	248 869,46	721 529,25

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2019 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

WARTA Obligacji Rynków Wschodzących**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	626,0987	2 230,0131
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	2 230,0131	5 870,3869
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	115,27	111,60
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	110,23	111,60
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	115,71	122,97
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	111,60	122,91

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
1		2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	721 233,97	99,96%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	28 313,89	3,92%
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	671 078,59	93,01%
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	4 244,06	0,59%
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	17 597,43	2,44%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	330,37	0,05%
III.	Należności	0,00	0,00%
IV.	Zobowiązania	35,09	0,00%
V.	Aktywa netto (w tym)	721 529,25	100,00%
1.	krajowe	64 965,88	9,00%
2.	zagraniczne - kraje UE	237 289,27	32,89%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	419 274,10	58,11%

ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO

sporządzone na dzień 31.12.2019 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)	721 233,97	99,96%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	28 313,89	3,92%
1.1	obligacje	28 313,89	3,92%
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	671 078,59	93,01%
3.1	notowane na rynku regulowanym	671 078,59	93,01%
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	4 244,06	0,59%
7.1	opcje	0,00	0,00%
7.2	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
7.3	swapy walutowe	4 244,06	0,59%
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	17 597,43	2,44%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Środki pieniężne	330,37	0,05%
III.	Należności	0,00	0,00%
IV.	Zobowiązania	35,09	0,00%
V.	Aktywa netto (w tym)	721 529,25	100,00%
1.	krajowe	64 965,88	9,00%
2.	zagraniczne - kraje UE	237 289,27	32,89%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	419 274,10	58,11%