

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 Stabilny Portfel Aktywów**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku kalendarzowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
I. Aktywa		764 445 959,82	506 586 550,17
1. lokaty		748 222 375,72	499 912 396,30
2. środki pieniężne		15 818 986,68	6 225 126,45
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		404 597,42	449 027,42
4.1 z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		404 597,42	449 027,42
4.2 pozostałe		0,00	0,00
II. Zobowiązania		2 970 248,75	8 942 919,74
1. z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		1 589 966,78	1 062 094,32
2. wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		0,00	0,00
3. Pozostałe		1 380 281,97	7 880 825,42
III. Aktywa netto (I - II)		761 475 711,07	497 643 630,43

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 Stabilny Portfel 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	787 265 100,37	761 475 711,07
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I- II)	-50 182 074,30	-267 297 720,09
I.	Zwiększenia funduszu	199 807 414,31	131 554 416,15
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	195 814 955,99	120 444 675,19
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	3 992 458,32	11 109 740,96
II.	Zmniejszenia funduszu	249 989 488,61	398 852 136,24
1.	tytułem wykupu	236 477 716,37	357 629 665,53
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	894 605,88	13 181 289,16
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	69 828,40	122 378,25
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	7 218 295,02
6.	pozostałe koszty	1 444 735,83	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	11 102 602,13	20 700 508,28
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	24 392 684,99	3 465 639,45
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	761 475 711,07	497 643 630,43

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 Stabilny Portfel 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	630 649,5829	591 244,5735
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	591 244,5735	386 639,4456
II.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	1 248,34	1 287,92
2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1 248,34	1 283,25
3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1 288,41	1 312,32
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 287,92	1 287,10

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 Stabilny Portfel Aktywów**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł.)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	499 912 396,30	100,46%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	120 670 526,94	24,25%
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	360 644 413,00	72,47%
4.	akcje	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	3 683 766,93	0,74%
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	176 327,05	0,04%
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	14 737 362,38	2,96%
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	6 225 126,45	1,25%
IV.	Należności	449 027,42	0,09%
V.	Zobowiązania	8 942 919,74	1,80%
VI.	Aktywa netto (w tym)	497 643 630,43	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	450 112 604,84	90,45%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	30 655 649,81	6,16%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	16 875 375,78	3,39%

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 Stabilny Portfel Aktywów

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	499 912 396,30	100,46%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	120 670 526,94	24,25%
1.1	<i>obligacje</i>	120 670 526,94	24,25%
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	360 644 413,00	72,47%
3.1	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	67 653 419,80	13,59%
3.2	<i>pozostałe</i>	292 990 993,20	58,88%
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	3 683 766,93	0,74%
6.1	<i>jednostki uczestnictwa</i>	3 683 766,93	0,74%
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	176 327,05	0,04%
7.1	<i>opcje</i>	0,00	0,00%
7.2	<i>kontrakty terminowe</i>	176 327,05	0,04%
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	14 737 362,38	2,96%
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	6 225 126,45	1,25%
IV.	Należności	449 027,42	0,09%
V.	Zobowiązania	8 942 919,74	1,80%
VI.	Aktywa netto (w tym)	497 643 630,43	100,00%
1.	<i>krajowe</i>	450 112 604,84	90,45%
2.	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	30 655 649,81	6,16%
3.	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	16 875 375,78	3,39%