

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2016 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 obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>506 586 550,17</b>	<b>194 732 113,02</b>
1.	lokaty	499 912 396,30	189 182 454,97
2.	środki pieniężne	6 225 126,45	5 033 175,55
3.	należności	449 027,42	516 482,50
3.1	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	449 027,42	516 482,50
3.2	pozostałe	0,00	0,00
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>8 942 919,74</b>	<b>857 909,41</b>
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	1 062 094,32	200 484,31
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	7 880 825,42	657 425,10
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I - II)</b>	<b>497 643 630,43</b>	<b>193 874 203,61</b>

**II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

(w zł)		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>	<b>761 475 711,07</b>	<b>497 643 630,43</b>
<b>B.</b>	<b>Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-267 297 720,09</b>	<b>-309 795 246,31</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>131 554 416,15</b>	<b>7 073 856,81</b>
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	120 444 675,19	450 996,94
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	11 109 740,96	6 622 859,87
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>398 852 136,24</b>	<b>316 869 103,12</b>
1.	tytułem wykupu	357 629 665,53	303 640 210,18
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	13 181 289,16	7 902 708,47
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	122 378,25	111 070,61
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	7 218 295,02	3 738 464,11
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	20 700 508,28	1 476 649,75
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>3 465 639,45</b>	<b>6 025 819,49</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>497 643 630,43</b>	<b>193 874 203,61</b>

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2016 r.

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

Nazwa ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego:

**Fundusz Stabilny Portfel Aktywów****III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU**

Pozycja		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I.</b>	<b>Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	591 244,5735	386 639,4456
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	386 639,4456	148 949,5345
<b>II.</b>	<b>Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	1 287,92	1 287,10
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	1 283,25	1 287,10
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	1 312,32	1 312,11
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	1 287,10	1 301,61

**IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>189 182 454,97</b>	<b>97,58%</b>
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	114 966 643,83	59,30%
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	59 687 877,94	30,79%
4.	akcje	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	2 789 081,39	1,44%
7.	instrumenty pochodne	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	11 738 851,81	6,05%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>5 033 175,55</b>	<b>2,60%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>516 482,50</b>	<b>0,27%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>857 909,41</b>	<b>0,44%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>193 874 203,61</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	186 241 691,02	96,06%
2.	zagraniczne - kraje UE	7 632 512,59	3,94%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%

**ROCZNE SPRAWOZDANIE UBEZPIECZENIOWEGO FUNDUSZU KAPITAŁOWEGO**

sporządzone na dzień 31.12.2016 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
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>189 182 454,97</b>	<b>97,58%</b>
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	114 966 643,83	59,30%
1.1	<i>obligacje</i>	114 966 643,83	59,30%
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	59 687 877,94	30,79%
3.1	<i>notowane na rynku regulowanym</i>	9 752 656,99	5,03%
3.2	<i>pozostałe</i>	49 935 220,95	25,76%
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	2 789 081,39	1,44%
6.1	<i>jednostki uczestnictwa</i>	2 789 081,39	1,44%
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	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	11 738 851,81	6,05%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>5 033 175,55</b>	<b>2,60%</b>
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>516 482,50</b>	<b>0,27%</b>
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>857 909,41</b>	<b>0,44%</b>
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto ( w tym)</b>	<b>193 874 203,61</b>	<b>100,00%</b>
1.	krajowe	186 241 691,02	96,06%
2.	zagraniczne - kraje UE	7 632 512,59	3,94%
3.	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%