

Fundusz Zrównoważony Modelowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2016

COMPENSA Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A. Vienna Insurance Group
Fundusz Zrównoważony Modelowy

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2015	XII/2016
		Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego o poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego o
I.	Aktywa	249 613,46	308 393,44
1.	Lokaty	200 300,19	306 740,47
2.	Środki pieniężne	49 313,27	1 652,97
3.	Należności		
3.1.	<i>z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>		
3.2.	<i>Pozostałe</i>		
II.	Zobowiązania	0,00	0,00
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	Wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe		
III.	Aktywa netto (I-II)	249 613,46	308 393,44

Fundusz Zrównoważony Modelowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2016

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2015	XII/2016
		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	307 595,38	249 613,46
B.	Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)	-46 134,47	52 709,42
I.	Zwiększenia funduszu	91 462,10	82 110,62
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	81 136,52	69 916,92
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	10 325,58	12 193,70
II.	Zmniejszenia funduszu	137 596,57	29 401,20
1.	Tytułem wykupu	106 576,41	7 443,88
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	10 966,92	6 732,95
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	12 709,33	12 357,89
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	7 343,91	2 866,48
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-11 847,45	6 070,56
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	249 613,46	308 393,44

0,00

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU

Pozycja		XII/2015	XII/2016
		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
I.	Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	3 104,02227	2 667,97289
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	2 667,97286	3 247,39529
II.	Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	99,09574	93,55922
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	91,66258	89,77160
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	103,65631	95,68806
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	93,55922	94,96640

Fundusz Zrównoważony Modelowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2016

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

XII/2016

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	306 740,47	99,46%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska		
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		
4.	Akcje		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	306 740,47	99,46%
7.	Instrumenty pochodne		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Środki pieniężne	1 652,97	0,54%
III.	Należności		
IV.	Zobowiązania		
V.	Aktywa netto (w tym)	308 393,44	100,00%
1	<i>krajowe</i>	308 393,44	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

Fundusz Zrównoważony Modelowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2016

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

XII/2016

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	306 740,47	99,46%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska		
1.1	Obligacje		
1.2	Bony skarbowe		
1.3	Inne		
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		
3.1	Notowane na rynku regulowanym		
3.2	Pozostałe		
4.	Akcje		
4.1	Akcje notowane na rynku regulowanym		
4.2	Pozostałe akcje		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	306 740,47	99,46%
6.1	Jednostki uczestnictwa	306 740,47	99,46%
6.2	Certyfikaty inwestycyjne		
6.2.1	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		
6.2.2	innych funduszy inwestycyjnych		
7.	Instrumenty pochodne		
7.1	Opcje		
7.2	Kontrakty terminowe		
7.3	Swapy walutowe		
7.4	Swapy procentowe		
7.5	Inne instrumenty pochodne		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
9.1	Zabezpieczone hipotecznie		
9.2	Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		
9.3	pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		
9.4	Inne pożyczki		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Środki pieniężne	1 652,97	0,54%
III.	Należności		
IV.	Zobowiązania		
V.	Aktywa netto (w tym)	308 393,44	100,00%
1	krajowe	308 393,44	100,00%
2	zagraniczne - kraje UE		
3	zagraniczne - kraje poza UE		