

Fundusz Aktywnego Inwestowania

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2015

COMPENSA Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A. Vienna Insurance Group
Fundusz Aktywnego Inwestowania

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	2 133 461,84	1 954 887,34
1.	Lokaty	2 114 422,46	1 783 221,46
2.	Środki pieniężne	19 039,38	171 665,88
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
4.	Należności		
4.1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
4.2.	Pozostałe należności		
II.	Zobowiązania	0,00	0,00
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe zobowiązania		
III.	Aktywa netto (I-II)	2 133 461,84	1 954 887,34

Fundusz Aktywnego Inwestowania

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2015

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2014	XII/2015
		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	2 239 231,52	2 133 461,84
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	30 429,48	-34 709,80
I.	Zwiększenia funduszu	597 809,95	518 109,84
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	530 847,96	401 987,28
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	66 961,99	116 122,56
II.	Zmniejszenia funduszu	567 380,47	552 819,64
1.	Tytułem wykupu	392 048,40	420 636,76
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	88 240,00	58 742,31
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	61 395,53	59 397,68
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	25 696,54	14 042,89
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-136 199,15	-143 864,70
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	2 133 461,84	1 954 887,34

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		XII/2014	XII/2015
		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	33 223,34486	33 991,67272
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	33 991,67265	33 800,90208
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	67,39934	62,76425
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	62,00482	56,05072
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	69,27267	67,85530
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	62,76425	57,83536

Fundusz Aktywnego Inwestowania

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2015

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne		XII/2015	
		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 783 221,46	91,22%
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	1 783 221,46	91,22%
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
III.	Środki pieniężne	171 665,88	8,78%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 954 887,34	100,00%
1	<i>krajowe</i>	1 954 887,34	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

Fundusz Aktywnego Inwestowania

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2015

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

XII/2015

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	1 783 221,46	91,22%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska		
1.1	<i>Obligacje</i>		
1.2	<i>Bony skarbowe</i>		
1.3	<i>Inne</i>		
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	<i>Notowane na rynku regulowanym</i>		
3.2	<i>Pozostałe</i>		
4.	Akcje		
4.1	<i>Akcje notowane na rynku regulowanym</i>		
4.2	<i>Pozostałe akcje</i>		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	1 783 221,46	91,22%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	1 783 221,46	91,22%
6.2	<i>Certyfikaty inwestycyjne</i>		
6.2.1	<i>Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i>		
6.2.2	<i>Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych</i>		
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		
7.1	<i>Opcje</i>		
7.2	<i>Kontrakty terminowe</i>		
7.3	<i>Swapy walutowe</i>		
7.4	<i>Swapy procentowe</i>		
7.5	<i>Inne instrumenty pochodne</i>		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
9.1	<i>Zabezpieczone hipotecznie</i>		
9.2	<i>Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej</i>		
9.3	<i>Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i>		
9.4	<i>Inne pożyczki</i>		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Aktywa za pozwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
III.	Środki pieniężne	171 665,88	8,78%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 954 887,34	100,00%
1	<i>krajowe</i>	1 954 887,34	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		