

Fundusz Europejski

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2014	XII/2015
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	1 036 716,05	1 049 539,65
1.	Lokaty	1 016 607,41	1 020 431,90
2.	Środki pieniężne	20 108,64	29 107,75
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
4.	Należności		
4.1.	<i>Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>		
4.2.	<i>Pozostałe należności</i>		
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)	1 036 716,05	1 049 539,65

Fundusz Europejski

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	966 288,42	1 036 716,05
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	1 521,90	-10 529,87
I.	Zwiększenia funduszu	177 754,69	180 469,48
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	169 729,92	151 688,13
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	8 024,77	28 781,35
II.	Zmniejszenia funduszu	176 232,79	190 999,35
	Tytułem wykupu	103 737,32	102 659,65
	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	41 923,36	38 137,51
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	26 127,69	27 728,20
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	4 444,42	22 473,99
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	68 905,73	23 353,47
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	1 036 716,05	1 049 539,65

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	185 133,29362	189 311,65298
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	189 311,65362	192 713,28028
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	5,21942	5,47624
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	5,11922	5,25033
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	5,49374	5,73275
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	5,47624	5,44612

Fundusz Europejski

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)	1 049 539,65	97,23%
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	1 020 431,90	97,23%
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	29 107,75	2,77%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 049 539,65	100,00%
1	<i>krajowe</i>	774 324,01	73,78%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	275 215,64	26,22%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

Fundusz Europejski

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)	1 049 539,65	97,23%
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	1 020 431,90	97,23%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	1 020 431,90	97,23%
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 zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
III.	Środki pieniężne	29 107,75	2,77%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	1 049 539,65	100,00%
1	<i>krajowe</i>	774 324,01	73,78%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	275 215,64	26,22%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		