

Fundusz Obligacji Modelowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2014

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	280 852,60	323 965,96
1.	Lokaty	280 852,60	321 358,57
2.	Środki pieniężne		2 607,39
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)	280 852,60	323 965,96

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	240 659,39	280 852,60
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	50 361,55	34 109,92
I.	Zwiększenia funduszu	216 319,52	203 318,77
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	187 048,43	157 146,35
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	29 271,09	46 172,42
II.	Zmniejszenia funduszu	165 957,97	169 208,85
1.	Tytułem wykupu	116 730,27	109 808,26
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	28 157,29	20 504,13
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	14 745,91	15 414,01
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	6 324,50	23 482,45
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-10 168,35	9 003,44
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	280 852,60	323 965,96

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		XII/2013	XII/2014
		Okres bieżący	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	2 129,02355	2 539,18062
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	2 539,18064	2 845,44534
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	113,03745	110,60757
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	106,54528	109,71027
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	114,49487	114,44423
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	110,60757	113,85422

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

XII/2014

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	321 358,57	99,20%
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	321 358,57	99,20%
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	2 607,39	0,80%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	323 965,96	100,00%
1	<i>krajowe</i>	323 965,96	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

XII/2014

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	321 358,57	99,20%
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	321 358,57	99,20%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	321 358,57	99,20%
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	2607,39	0,80%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	323 965,96	100,00%
1	<i>krajowe</i>	323 965,96	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		