

Fundusz Rynku Surowców, Żywności i Energii

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

COMPENSA Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A. Vienna Insurance Group  
Fundusz Rynku Surowców, Żywności i Energii

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2014	XII/2015
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>393 355,61</b>	<b>351 318,14</b>
1.	Lokaty	302 572,74	259 556,71
2.	Środki pieniężne	90 782,87	91 761,43
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		
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe zobowiązania		
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>393 355,61</b>	<b>351 318,14</b>

Fundusz Rynku Surowców, Żywności i Energii

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
<b>A.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na początek okresu</b>	<b>376 870,42</b>	<b>393 355,61</b>
<b>B.</b>	<b>Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>43 026,45</b>	<b>7 963,39</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	195 161,62	117 210,05
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	171 524,61	101 072,53
2.	Pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	Pozostałe zwiększenia	23 637,01	16 137,52
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>152 135,17</b>	<b>109 246,66</b>
1.	Tytułem wykupu	87 896,81	58 091,90
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	18 818,96	11 179,17
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	11 865,43	12 435,59
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	33 553,97	27 540,00
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>-26 541,26</b>	<b>-50 000,86</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>393 355,61</b>	<b>351 318,14</b>

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		XII/2014	XII/2015
		Okres poprzedni	Okres bieżący
<b>1.</b>	<b>Liczba jednostek rozrachunkowych:</b>		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	5 023,25717	5 629,65683
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	5 629,65687	5 776,08525
<b>2.</b>	<b>Wartość jednostki rozrachunkowej:</b>		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	75,02511	69,87204
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	69,11550	59,05491
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	78,83532	70,28447
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	69,87204	60,82288

## Fundusz Rynku Surowców, Żywności i Energii

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
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>259 556,71</b>	<b>73,88%</b>
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	259 556,71	73,88%
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		
<b>II.</b>	<b>Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej</b>		
<b>III.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>91 761,43</b>	<b>26,12%</b>
<b>IV.</b>	<b>Należności</b>		
<b>V.</b>	<b>Zobowiązania</b>		
<b>VI.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>351 318,14</b>	<b>100,00%</b>
1	krajowe	351 318,14	100,00%
2	zagraniczne - kraje UE		
3	zagraniczne - kraje poza UE		

## Fundusz Rynku Surowców, Żywności i Energii

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
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>259 556,71</b>	<b>73,88%</b>
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	<b>259 556,71</b>	<b>73,88%</b>
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	259 556,71	73,88%
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		
<b>II.</b>	<b>Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej</b>		
<b>III.</b>	<b>Środki pieniężne</b>	<b>91 761,43</b>	<b>26,12%</b>
<b>IV.</b>	<b>Należności</b>		
<b>V.</b>	<b>Zobowiązania</b>		
<b>VI.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>351 318,14</b>	<b>100,00%</b>
1	<i>krajowe</i>	351 318,14	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		