

Fundusz Strategia Wielu Klas Aktywów bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31-12-2015COMPENSA Towarzystwo na Życie SA Vienna Insurance Group
Strategia Wielu Klas Aktywów bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	13 205 399,76	10 535 542,22
1.	Lokaty	10 791 436,16	5 939 042,14
2.	Środki pieniężne	2 207 202,29	4 019 169,57
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	-	
4.	Należności	206 761,30	
4.1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	201 640,90	577 330,51
4.2.	Pozostałe należności	5 120,40	
II.	Zobowiązania	132 179,86	-
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	-	
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	
3.	Pozostałe zobowiązania	132 179,86	
III.	Aktywa netto (I-II)	13 073 219,90	10 535 542,22

Fundusz Strategia Wielu Klas Aktywów bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

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

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	15 649 652,12	13 073 219,86
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-2 918 455,87	-3 203 143,30
I.	Zwiększenia funduszu	0,00	0,00
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	0,00	0,00
2.	Pozostałe przychody		0,00
3.	Pozostałe zwiększenia	0,00	0,00
II.	Zmniejszenia funduszu	2 918 455,87	3 203 143,30
1.	Tytułem wykupu	2 555 173,16	2 962 785,49
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	0,00	0,00
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	292 423,92	240 357,82
6.	Pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	Pozostałe zmniejszenia	70 858,79	0,00
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	342 023,61	665 465,66
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	13 073 219,86	10 535 542,22

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH		XII/2014	XII/2015
Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	1 436 321,65056	1 194 979,91
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1 194 979,91	881 818,65
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	10,89565	10,98648
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10,79383	10,98648
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	11,34941	12,27122
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	10,98648	11,94752

Fundusz Strategia Wielu Klas Aktywów bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

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)	5 939 042,14	56,37%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	957 973,94	9,09%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	501 532,47	4,76%
4.	Akcje	4 308 136,79	40,89%
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	171 398,94	1,63%
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		0,00%
III.	Środki pieniężne	4 019 169,57	38,15%
IV.	Należności	577 330,51	5,48%
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	10 535 542,22	100,00%
1	<i>krajowe</i>	9 887 722,84	93,85%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	355 407,91	3,37%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	292 411,47	2,78%

Fundusz Strategia Wielu Klas Aktywów bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

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)	5 939 042,14	56,37%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska		
1.1	Obligacje	957 973,94	9,09%
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	501 532,47	4,76%
3.2	Pozostałe		
4.	Akcje		
4.1	Akcje notowane na rynku regulowanym	4 308 136,79	40,89%
4.2	Pozostałe akcje		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		
6.1	Jednostki uczestnictwa	171 398,94	1,63%
6.2	Certyfikaty inwestycyjne		
6.2.1	Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		
6.2.2	Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych		
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		
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	Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		
9.4	Inne 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	4 019 169,57	38,15%
IV.	Należności	577 330,51	5,48%
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	10 535 542,22	100,00%
1	krajowe	9 887 722,84	93,85%
2	zagraniczne - kraje UE	355 407,91	3,37%
3	zagraniczne - kraje poza UE	292 411,47	2,78%