

Fundusz Zrównoważony Modelowy

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	252 109,86	307 595,38
1.	Lokaty	252 109,86	299 298,37
2.	Środki pieniężne		8 297,01
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)	252 109,86	307 595,38

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	169 345,20	252 109,86
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	72 441,86	65 534,55
I.	Zwiększenia funduszu	191 869,77	184 268,22
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	181 406,38	169 749,64
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	10 463,39	14 518,58
II.	Zmniejszenia funduszu	119 427,91	118 733,67
1.	Tytułem wykupu	87 082,53	82 565,36
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	19 634,81	20 856,87
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	12 320,49	12 864,53
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	390,08	2 446,91
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	10 322,80	-10 049,03
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	252 109,86	307 595,38

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		XII/2013	XII/2014
		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	1 675,43119	2 453,24837
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	2 453,24837	3 104,02223
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	101,07559	102,76573
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	95,05680	98,27882
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	105,72768	104,17823
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	102,76573	99,09574

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)	299 298,37	97,30%
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	299 298,37	97,30%
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	8 297,01	2,70%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	307 595,38	100,00%
1	<i>krajowe</i>	307 595,38	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)	299 298,37	97,30%
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	299 298,37	97,30%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	299 298,37	97,30%
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	8297,01	2,70%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	307 595,38	100,00%
1	<i>krajowe</i>	307 595,38	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		