

Fundusz Zrównoważony Modelowy

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2014	XII/2015
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	307 595,38	249 613,46
1.	Lokaty	299 298,37	200 300,19
2.	Środki pieniężne	8 297,01	49 313,27
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)	307 595,38	249 613,46

Fundusz Zrównoważony Modelowy

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	252 109,86	307 595,38
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	65 534,55	-46 134,47
I.	Zwiększenia funduszu	184 268,22	91 462,10
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	169 749,64	81 136,52
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	14 518,58	10 325,58
II.	Zmniejszenia funduszu	118 733,67	137 596,57
1.	Tytułem wykupu	82 565,36	106 576,41
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	20 856,87	10 966,92
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	12 864,53	12 709,33
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	2 446,91	7 343,91
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-10 049,03	-11 847,45
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	307 595,38	249 613,46

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	2 453,24837	3 104,02227
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	3 104,02223	2 667,97286
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	102,76573	99,09574
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	98,27882	91,66258
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	104,17823	103,65631
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	99,09574	93,55922

Fundusz Zrównoważony Modelowy

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)	200 300,19	80,24%
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	200 300,19	80,24%
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	49 313,27	19,76%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	249 613,46	100,00%
1	krajowe	249 613,46	100,00%
2	zagraniczne - kraje UE		
3	zagraniczne - kraje poza UE		

Fundusz Zrównoważony Modelowy

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)	200 300,19	80,24%
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	200 300,19	80,24%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	200 300,19	80,24%
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	49 313,27	19,76%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	249 613,46	100,00%
1	<i>krajowe</i>	249 613,46	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		