

Portfel Agresywny

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

COMPENSA Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A. Vienna Insurance Group
Portfel Agresywny

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	10 054 507,88	8 957 927,25
1.	Lokaty	9 823 462,41	6 810 595,26
2.	Środki pieniężne	231 045,47	2 147 331,99
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)	10 054 507,88	8 957 927,25

Portfel Agresywny

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	12 898 308,72	10 054 507,88
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-2 454 321,81	-1 029 729,91
I.	Zwiększenia funduszu	3 497 480,43	1 489 790,54
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	814 405,06	520 734,72
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	2 683 075,37	969 055,82
II.	Zmniejszenia funduszu	5 951 802,24	2 519 520,45
1.	Tytułem wykupu	1 789 589,03	2 064 574,32
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu		
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	356 771,27	275 867,95
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	3 805 441,94	179 078,18
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	-389 479,03	-66 850,72
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	10 054 507,88	8 957 927,25

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	87 939,76225	70 243,77552
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	70 243,77551	66 160,88592
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	146,67209	143,13735
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	137,30039	132,21154
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	152,69553	154,14910
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	143,13735	135,39612

Portfel Agresywny

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)	6 810 595,26	76,03%
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	6 810 595,26	76,03%
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
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	2 147 331,99	23,97%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	8 957 927,25	100,00%
1	<i>krajowe</i>	5 582 945,25	63,24%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	1 573 387,66	16,97%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	1 801 594,34	19,79%

Portfel Agresywny

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)	6 810 595,26	76,03%
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	6 810 595,26	76,03%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	6 810 595,26	76,03%
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	0,00	0,00
7.1	<i>Opcje</i>		
7.2	<i>Kontrakty terminowe</i>	0,00	0,00%
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	2 147 331,99	23,97%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	8 957 927,25	100,00%
1	<i>krajowe</i>	5 582 945,25	62,32%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	1 573 387,66	17,56%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	1 801 594,34	20,11%