

Portfel Konserwatywny

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	20 510 960,47	8 780 827,01
1.	Lokaty	19 726 614,30	8 774 179,87
2.	Środki pieniężne	784 346,17	6 647,14
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		
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)	20 510 960,47	8 780 827,01

Portfel Konserwatywny

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	3 205 430,13	20 510 960,47
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	16 495 065,35	-11 911 513,70
I.	Zwiększenia funduszu	25 025 392,80	842 900,07
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	1 458 037,11	0,00
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	23 567 355,69	842 900,07
II.	Zmniejszenia funduszu	8 530 327,45	12 754 413,77
1.	Tytułem wykupu	1 087 774,18	7 824 456,97
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	0,00	0,00
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	136 547,37	142 162,86
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	7 306 005,90	4 787 793,94
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	810 464,98	181 380,24
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	20 510 960,47	8 780 827,01

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	28 684,47756	175 309,97660
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	175 309,97660	74 480,81464
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	111,74790	116,99825
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	111,44740	117,08289
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	117,23132	118,88768
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	116,99825	117,89381

Portfel Konserwatywny

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)	8 774 179,87	99,92%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	560 191,97	6,38%
4.	Akcje		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	8 213 987,90	93,54%
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	6 647,14	0,08%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	8 780 827,01	100,00%
1	<i>krajowe</i>	8 224 247,84	93,66%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	556 579,17	6,34%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

Portfel Konserwatywny

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)	8 774 179,87	99,92%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
1.1	<i>Obligacje</i>	0,00	0,00%
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>	560 191,97	6,38%
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	8 213 987,90	93,54%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	8 213 987,90	93,54%
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	6 647,14	0,08%
IV.	Należności		
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	8 780 827,01	100,00%
1	<i>krajowe</i>	8 224 247,84	93,66%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	556 579,17	6,34%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		