

Portfel Stabilnego Wzrostu

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2014	XII/2015
(w zł)		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	39 426 675,96	30 560 105,46
1.	Lokaty	36 657 070,02	26 122 435,23
2.	Środki pieniężne	2 756 521,68	4 437 670,23
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
4.	Należności	13 084,26	0,00
4.1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	13 084,26	0,00
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)	39 426 675,96	30 560 105,46

Portfel Stabilnego Wzrostu

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	48 086 141,76	39 426 675,96
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-9 319 630,94	-8 555 428,05
I.	Zwiększenia funduszu	14 048 843,23	5 458 931,96
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	5 951 218,27	409 991,34
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	8 097 624,96	5 048 940,62
II.	Zmniejszenia funduszu	23 368 474,17	14 014 360,01
1.	Tytułem wykupu	6 320 335,79	12 143 412,07
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	738 737,16	574 185,28
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	16 309 401,22	1 296 762,66
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	660 165,14	-311 142,46
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	39 426 675,96	30 560 105,46

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	364 457,29334	295 935,01253
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	295 935,01251	231 521,21230
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	131,93903	133,22748
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	129,98339	129,67780
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	134,68680	138,36042
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	133,22748	131,99700

Portfel Stabilnego Wzrostu

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)	26 122 435,23	85,48%
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	1 129 659,14	3,70%
4.	Akcje		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	24 992 776,09	81,78%
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	4 437 670,23	14,52%
IV.	Należności	0,00	0,00%
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	30 560 105,46	100,00%
1	<i>krajowe</i>	24 929 274,36	81,57%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	3 487 614,01	11,41%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	2 143 217,09	7,01%

Portfel Stabilnego Wzrostu

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)	26 122 435,23	85,48%
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>	1 129 659,14	3,70%
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	24 992 776,09	81,78%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	24 992 776,09	81,78%
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	4 437 670,23	14,52%
IV.	Należności	0,00	0,00%
V.	Zobowiązania		
VI.	Aktywa netto (w tym)	30 560 105,46	100,00%
1	<i>krajowe</i>	24 929 274,36	78,84%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	3 487 614,01	16,15%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	2 143 217,09	5,02%