

Portfel Zrównoważony

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

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

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	22 229 986,99	17 378 834,66
1.	Lokaty	22 086 234,10	16 408 971,61
2.	Środki pieniężne	143 752,89	959 497,89
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
4.	Należności	0,00	10 365,16
4.1.	<i>Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>		10 365,16
4.2.	<i>Pozostałe należności</i>		
II.	Zobowiązania	45 746,75	0,00
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	45 746,75	0,00
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe zobowiązania		
III.	Aktywa netto (I-II)	22 184 240,24	17 378 834,66

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2013	XII/2014
		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	70 845,03	22 184 240,24
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	21 761 232,08	-4 568 273,33
I.	Zwiększenia funduszu	22 028 970,33	7 592 202,99
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	21 806 071,98	4 497 477,81
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	222 898,35	3 094 725,18
II.	Zmniejszenia funduszu	267 738,25	12 160 476,32
1.	Tytułem wykupu	106 141,48	3 287 956,32
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	108 454,31	485 551,27
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	53 142,46	8 386 968,73
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	352 163,13	-237 132,24
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	22 184 240,24	17 378 834,66

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	584,31673	162 671,28997
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	162 671,29001	128 884,62206
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	121,24422	136,37465
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	120,56102	131,12960
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	140,28298	140,32737
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	136,37465	134,84025

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)	16 408 971,61	94,42%
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	16 408 971,61	94,42%
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	959 497,89	5,52%
IV.	Należności	10 365,16	
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	17 378 834,66	99,94%
1	<i>krajowe</i>	13 376 879,67	76,97%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	2 265 086,41	13,03%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	1 736 868,58	9,99%

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)	16 408 971,61	94,42%
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	16 408 971,61	94,42%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	16 408 971,61	94,42%
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	959 497,89	5,52%
IV.	Należności	10 365,16	0,06%
V.	Zobowiązania	0,00	0,00%
VI.	Aktywa netto (w tym)	17 378 834,66	100,00%
1	<i>krajowe</i>	13 376 879,67	76,97%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>	2 265 086,41	13,03%
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	1 736 868,58	9,99%