

**AGIO Multistrategia**

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego  
sporządzone na dzień 31-12-2016**

**COMPENSA Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A. Vienna Insurance Group  
Fundusz AGIO Multistrategia**

**I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU**

		XII/2015	XII/2016
	(w zł)	Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego o poprzedniego roku obrotowego	Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	<b>69 514,57</b>	<b>70 569,28</b>
1.	Lokaty	69 514,57	70 568,57
2.	Środki pieniężne		
3.	Należności		
3.1.	<i>z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>		0,71
3.2.	<i>Pozostałe</i>		
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	Wobec ubezpieczających, ubezpieczonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe		
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	<b>69 514,57</b>	<b>70 569,28</b>

AGIO Multistrategia

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego  
sporządzone na dzień 31-12-2016

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		XII/2015	XII/2016
		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>A.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego</b>	<b>69 568,37</b>	<b>69 514,57</b>
<b>B.</b>	<b>Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	<b>-5 342,73</b>	<b>-1 571,47</b>
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>0,00</b>	<b>147,64</b>
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	0,00	0,00
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia	0,00	147,64
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>5 342,73</b>	<b>1 719,11</b>
1.	Tytułem wykupu	0,00	0,00
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3.	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	1 815,62	1 719,11
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych		
5.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0,00	0,00
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	3 527,11	
<b>C.</b>	<b>Wynik netto z działalności inwestycyjnej</b>	<b>5 288,93</b>	<b>2 626,18</b>
<b>D.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>69 514,57</b>	<b>70 569,28</b>

0,00

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU

Pozycja		XII/2015	XII/2016
		Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego	Bieżący okres sprawozdawczy
<b>I.</b>	<b>Liczba jednostek uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	80,86653	78,27139
2.	na koniec okresu sprawozdawczego	78,27139	76,50193
<b>II.</b>	<b>Wartość jednostki uczestnictwa funduszu:</b>		
1.	na początek okresu sprawozdawczego	860,28636	888,12239
2.	minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	858,59789	815,41661
3.	maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym	962,08747	922,88941
4.	na koniec okresu sprawozdawczego	888,12239	922,45099

AGIO Multistrategia

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego  
sporządzone na dzień 31-12-2016

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

XII/2016

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>70 568,57</b>	<b>100,00%</b>
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	70 568,57	100,00%
7.	Instrumenty pochodne		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>		
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>0,71</b>	
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>		
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>70 569,28</b>	<b>100,00%</b>
1	<i>krajowe</i>	70 569,28	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		

AGIO Multistrategia

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego  
sporządzone na dzień 31-12-2016

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

XII/2016

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
<b>I.</b>	<b>Lokaty (suma 1-12)</b>	<b>70 568,57</b>	<b>100,00%</b>
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	<b>70 568,57</b>	<b>100,00%</b>
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	70 568,57	100,00%
6.2	<i>Certyfikaty inwestycyjne</i>		
6.2.1	<i>funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i>		
6.2.2	<i>innych funduszy inwestycyjnych</i>		
7.	Instrumenty pochodne		
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>pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i>		
9.4	<i>Inne pożyczki</i>		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
<b>II.</b>	<b>Środki pieniężne</b>		
<b>III.</b>	<b>Należności</b>	<b>0,71</b>	
<b>IV.</b>	<b>Zobowiązania</b>		
<b>V.</b>	<b>Aktywa netto (w tym)</b>	<b>70 569,28</b>	<b>100,00%</b>
1	<i>krajowe</i>	70 569,28	100,00%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>		