

Fundusz Strategia Skarbowa Plus
 sprawozdanie okresowe sporządzone na dzień 31-12-2010

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-------------|---|-----------------|---------------------|
| I. | Aktywa | - | 4 042 758,29 |
| 1. | Lokaty | - | 4 021 443,96 |
| 2. | Środki pieniężne | | 1 225,26 |
| 3. | Należności, w tym | | 20 089,07 |
| 3.1 | Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego | | 20 089,07 |
| 3.2 | Pozostałe należności | - | - |
| 4. | Pozostałe aktywa | - | - |
| II. | Zobowiązania | - | 3 116,58 |
| 1 | Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego | | - |
| 2 | Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | | - |
| 3 | Pozostałe zobowiązania | - | 3 116,58 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | - | 4 039 641,71 |

Fundusz Strategia Skarbowa Plus
sprawozdanie okresowe sporządzone na dzień 31-12-2010

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------|---|----------------------|---------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu | - | - |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 32 575,20 | 3 964 270,53 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 15 050 214,21 | 3 982 692,76 |
| 1 | Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 15 050 214,21 | 3 964 632,70 |
| 2 | Tytułem udzielonych gwarancji | - | - |
| 3 | Pozostałe zwiększenia | - | - |
| 3a | Przeniesienia z pozostałych funduszy | - | - |
| 3b | Inne (w tym przydział środków własnych) | - | 18 060,06 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 15 017 639,01 | 18 422,23 |
| 1 | Tytułem wykupu | 14 959 912,61 | - |
| 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 prowizji od składek | - | - |
| 6 | Tytułem pozostałych prowizji | - | - |
| 7 | Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 57 726,40 | 18 422,23 |
| 8 | Tytułem udzielonych gwarancji | - | - |
| 9 | Pozostałe zmniejszenia | - | - |
| 9a | Przeniesienia do pozostałych funduszy | - | - |
| 9b | Inne (w tym wycofanie środków własnych) | - | - |
| C. | Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów) | - 32 575,20 | 75 371,18 |
| 1 | z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | - | 92 051,49 |
| 2 | z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związku jednostek samorządu terytorialnego | - 51 333,75 | - |
| 3 | z listów zastawnych | - | - |
| 4 | z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu | - | - |
| 5 | z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | - | - |
| 6 | z akcji | 11 558,93 | - 17 542,40 |
| 7 | z udziałów | - | - |
| 8 | z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych | - | - |
| 9 | z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych | - | - |
| 10 | z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | - | - |
| 11 | z pożyczek | - | - |
| 12 | z nieruchomości | - | - |
| 13 | z depozytów bankowych | 7 199,62 | 862,09 |
| 14 | z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | - | - |
| D. | Pozostałe zwiększenia | - | - |
| E. | Pozostałe zmniejszenia | - | - |
| F. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 0,00 | 4 039 641,71 |

Fundusz Strategia Skarbowa Plus
 sprawozdanie okresowe sporządzone na dzień 31-12-2010

III. KOSZTY FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|---------|--|------------------|------------------|
| 1. | Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych | - | - |
| 2. | Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych | - | - |
| 3. | Koszty przechowywania aktywów funduszu | - | - |
| 4. | Koszty transakcyjne | | |
| 5. | Koszty zarządzania i administrowania funduszem | 57 726,40 | 18 422,23 |
| 6. | Pozostałe koszty | - | - |
| 7. | RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6) | 57 726,40 | 18 422,23 |

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-----------|--|-----------------|---------------|
| 1. | Liczba jednostek rozrachunkowych | | |
| 1.1 | Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | - | - |
| 1.2 | Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | - | 399 194,93 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej | | |
| 2.1 | Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | - | - |
| 2.2. | Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 4,89890 | 9,92 |
| 2.3 | Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 9,97421 | 10,26 |
| 2.4 | Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | - | 10,12 |

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach funduszu (%) |
|--------|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| 1. | Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 4 021 443,96 | 100% |
| 1.1 | Obligacje | 4 021 443,96 | 100% |
| 1.2 | Bony skarbowe | | |
| 1.3 | Inne | | |
| 2. | Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | | |
| 3. | Listy zastawne | | |
| 3.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 3.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | | |
| 3.1.2 | Pozostałe | | |
| 3.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 4. | Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | | |
| 4.1 | Notowane na rynku regulowanym | | |
| 4.2 | Pozostałe | | |
| 5. | Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | | |
| 5.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 5.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | | |
| 5.1.2 | Pozostałe | | |
| 5.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 6. | Akcje | - | - |
| 6.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | - | - |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | - | - |
| 6.1.2 | Pozostałe | | |
| 6.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 7. | Udziały | | |
| 8. | Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | - | - |
| 8.1 | Jednostki uczestnictwa | - | - |
| 8.2 | Certyfikaty inwestycyjne | | |
| 8.2.1 | Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | | |
| 8.2.2 | Certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | | |
| 9. | Instrumenty pochodne o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | - | - |
| 9.1 | Opcje | | |
| 9.2 | Kontrakty terminowe | - | - |
| 9.3 | Swapy walutowe | | |
| 9.4 | Swapy procentowe | | |
| 9.5 | Prawa poboru | | |
| 9.6 | Inne instrumenty pochodne | | |
| 10. | Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | | |
| 11. | Pożyczki | | |
| 11.1 | Zabezpieczone hipotecznie | | |
| 11.2 | Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | | |
| 11.3 | Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | | |
| 11.4 | Inne pożyczki | | |
| 12. | Nieruchomości | | |
| 13. | Depozyty bankowe | | |
| 14. | Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | | |
| 15. | Razem lokaty (suma 1-14), w tym | 4 021 443,96 | 100% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 4 021 443,96 | 100% |
| 15.2 | Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE | - | - |
| 15.3 | Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD | - | - |
| 15.4 | Ulokowane poza RP, UE i OECD | | |

VI. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

| Lokaty | | Ilość (w szt.) | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach funduszu (%) |
|--------|---|----------------|--------------------------|--------------------------------|
| 1. | Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 4 069 | 4 021 443,96 | 99,55% |
| 1.1 | Obligacje | 4 069 | 4 021 443,96 | 99,55% |
| 1.1.1 | PL0000103305 | 169 | 171 048,28 | 4,23% |
| 1.1.2 | PL0000104717 | 784 | 785 756,16 | 19,45% |
| 1.1.3 | PL0000102646 | 696 | 692 172,00 | 17,13% |
| 1.1.4 | PL0000105391 | 122 | 123 510,36 | 3,06% |
| 1.1.5 | PL0000105953 | 370 | 386 897,90 | 9,58% |
| 1.1.6 | PL0000105912 | 225 | 209 925,00 | 5,20% |
| 1.1.7 | PL0000105524 | 91 | 89 070,80 | 2,20% |
| 1.1.8 | PL0000105730 | 675 | 645 907,50 | 15,99% |
| 1.1.9 | PL0000103222 | 173 | 173 532,84 | 4,30% |
| 1.1.10 | PL0000102224 | 192 | 194 423,04 | 4,81% |
| 1.1.11 | PL0000106126 | 572 | 549 200,08 | 13,60% |
| 1.2 | Bony skarbowe | | | |
| 1.2.1 | | | | |
| 1.3 | Inne | | | |
| 1.3.1 | | | | |
| 2. | Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego | | | |
| 3. | Listy zastawne | | | |
| 3.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | | | |
| 3.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | | | |
| 3.1.2 | Pozostałe | | | |
| 3.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | | |
| 4. | Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu | | | |
| 4.1 | Notowane na rynku regulowanym | | | |
| 4.2 | Pozostałe | | | |
| 5. | Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | | | |
| 5.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | | | |
| 5.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | | | |
| 5.1.2 | Pozostałe | | | |
| 5.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | | |
| 6. | Akcje | - | - | - |
| 6.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | - | - | - |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | - | - | - |
| 6.1.2 | Pozostałe | - | - | - |
| 6.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | | |
| 7. | Udziały | | | |
| 8. | Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | | | |
| 8.1 | Jednostki uczestnictwa | | | |
| 8.2 | Certyfikaty inwestycyjne | | | |
| 8.2.1 | Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości | | | |
| 8.2.2 | Certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | | | |
| 9. | Instrumenty pochodne o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych | - | - | - |
| 9.1 | Opcje | | | |
| 9.2 | Kontrakty terminowe | - | - | - |
| 9.2.1 | PL0GF0000919 | - | - | - |
| 9.3 | Swapy walutowe | | | |
| 9.4 | Swapy procentowe | | | |
| 9.5 | Prawa poboru | | | |
| 9.6 | Inne instrumenty pochodne | | | |
| 10. | Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu | | | |
| 11. | Pożyczki | | | |
| 11.1 | Zabezpieczone hipotecznie | | | |
| 11.2 | Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej | | | |
| 11.3 | Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie | | | |
| 11.4 | Inne pożyczki | | | |
| 12. | Nieruchomości | | | |
| 13. | Depozyty bankowe | | | |
| 14. | Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej | | | |
| 15. | Razem lokaty (suma 1-14), w tym | 4 069 | 4 021 443,96 | 99,55% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 4 069 | 4 021 443,96 | 99,55% |
| 15.2 | Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE | - | - | - |
| 15.3 | Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD | - | - | - |
| 15.4 | Ulokowane poza RP, UE i OECD | | | |

Informacja dodatkowa

| l.p. | | stan na dzień 31-12-2009 | stan na dzień 31-12-2010 |
|------|--|--------------------------|--------------------------|
| 1. | składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy | 35 215 810,93 | 18 673 750,63 |
| 2. | opłaty za ryzyko, potrącone ze składki przypisanej brutto, przed ich przekazaniem na wszystkie fundusze prowadzone przez zakład ubezpieczeń | | |
| 3. | prowinizje, potrącenia ze składek przed ich przekazaniem na fundusz | | |
| 4. | inne koszty potrącone ze składek przed ich przekazaniem na fundusze (koszty wstępne, różnice w cenach) | 1 269 230,60 | 1 186 163,50 |
| 5. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń | 33 946 580,33 | 17 487 587,13 |
| 6. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie | 201 234,79 | 3 964 632,70 |