

Fundusz Strategia Wiele Klas Aktywów
 sprawozdanie okresowe sporządzone na dzień 31-12-2010

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	103 308 030,42	52 898 331,10
1.	Lokaty	89 592 418,63	51 162 961,78
2.	Środki pieniężne	9 167 918,50	1 715 051,71
3.	Należności, w tym	4 547 693,29	20 317,61
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	4 547 693,29	20 317,61
3.2	Pozostałe należności	-	-
4.	Pozostałe aktywa	-	-
II.	Zobowiązania	1 235 223,85	900 312,92
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	-	-
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	-
3.	Pozostałe zobowiązania	1 235 223,85	900 312,92
III.	Aktywa netto (I-II)	102 072 806,57	51 998 018,18

Fundusz Strategia Wiele Klas Aktywów
 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	115 134 335,70	102 072 806,50
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	- 22 506 652,32	- 55 820 313,41
I.	Zwiększenia funduszu	-	-
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	-	-
2	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
3	Pozostałe zwiększenia	-	-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	-	-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	-	-
II.	Zmniejszenia funduszu	22 506 652,32	55 820 313,41
1	Tytułem wykupu	19 878 703,09	53 904 515,21
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	2 627 949,23	1 805 682,90
8	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
9	Pozostałe zmniejszenia	-	-
9a	Przeniesienia do pozostałych funduszy	-	-
9b	Inne (w tym wycofanie środków własnych)	-	110 115,30
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	9 445 123,19	5 745 525,10
1	z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	-	2 145 941,59
2	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	2 495 907,66	-
3	z listów zastawnych	-	-
4	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	-	39 745,80
5	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
6	z akcji	11 669 979,25	4 166 484,01
7	z udziałów	-	-
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	- 2 297 756,72	42 679,40
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych	- 2 582 776,14	- 734 895,04
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek	-	-
12	z nieruchomości	-	-
13	z depozytów bankowych	159 769,14	85 569,35
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	102 072 806,57	51 998 018,19

Fundusz Strategia Wiele Klas Aktywów
 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	2 627 949,23	1 805 682,90
6.	Pozostałe koszty	-	-
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	2 627 949,23	1 805 682,90

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	12 902 287,39427	10 526 511,54
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	10 526 511,53986	4 985 833,28
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	8,92356	9,70
2.2.	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	4,50243	6,68
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10,86070	13,59
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	9,69674	10,43

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	18 865 361,37	36,28%
1.1	Obligacje	18 865 361,37	36,28%
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	3 915 433,43	7,53%
4.1	Notowane na rynku regulowanym	3 465 433,43	6,66%
4.2	Pozostałe	450 000,00	0,87%
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	25 891 699,86	49,79%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	25 891 699,86	49,79%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	25 891 699,86	49,79%
6.1.2	Pozostałe		
6.2	Nie dopuszczone do publicznego obrotu		
7.	Udziały		
8.	Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	2 070 182,12	3,98%
8.1	Jednostki uczestnictwa	2 070 182,12	3,98%
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	420 285,00	0,81%
9.1	Opcje		
9.2	Kontrakty terminowe	420 285,00	0,81%
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	51 162 961,78	98,39%
15.1	Ulokowane na terenie RP	50 407 077,26	96,94%
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	755 884,52	1,45%
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD		

VII. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

Lokaty	Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (%)
1. Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarż Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	18 510	18 865 361,37	36,28%
1.1 Obligacje	18 510	18 865 361,37	36,28%
1.1.1 PL0000103305	4 020	4 068 722,40	7,82%
1.1.2 PL0000104717	3 582	3 590 023,68	6,90%
1.1.3 PL0000102546	1 911	1 900 489,50	3,65%
1.1.4 PL0000105391	96	97 188,48	0,19%
1.1.5 PL0000105953	383	400 491,61	0,77%
1.1.6 PL0000105912	2 115	1 973 295,00	3,79%
1.1.7 PL0000105524	983	962 150,40	1,85%
1.1.8 PL0000105730	2 504	2 395 077,60	4,81%
1.1.9 PLIPFIP00025	6	634 980,70	1,22%
1.1.10 PL0000103222	450	451 386,00	0,87%
1.1.11 PL0000102224	545	551 877,90	1,06%
1.1.12 PL0000106126	1 915	1 838 668,10	3,54%
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	27 660	3 915 433,43	7,53%
4.1 Notowane na rynku regulowanym	27 657	3 465 433,43	6,66%
4.1.1 PLMRVPL00032	580	590 126,80	1,13%
4.1.2 PLPRMCM00022	27 077	2 875 306,63	5,53%
4.2 Pozostałe	3	450 000,00	0,87%
4.2.1 PLPOLND00084	1	249 815,46	0,48%
4.2.2 PLJWC000035	2	200 184,54	0,38%
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	5 306 621	25 891 699,86	49,79%
6.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	5 306 621	25 891 699,86	49,79%
6.1.1 Notowane na rynku regulowanym	5 306 621	25 891 699,86	49,79%
6.1.1.1 PLNFI0400015	222 554	589 788,10	1,13%
6.1.1.2 PLNFI1000012	40 520	43 761,60	0,08%
6.1.1.3 PLNFI1200018	306 882	141 165,72	0,27%
6.1.1.4 PLNFI0800016	55 293	110 033,07	0,21%
6.1.1.5 PLNFI0600010	498 762	399 038,60	0,77%
6.1.1.6 PLTVN0000017	1 487	25 427,70	0,05%
6.1.1.7 PLTLKPL00017	13 040	213 204,00	0,41%
6.1.1.8 PLTSGS0000019	8 150	133 660,00	0,26%
6.1.1.9 PLCELZ000018	3 167	245 442,50	0,47%
6.1.1.10 PLSTLP000017	7 111	195 307,10	0,38%
6.1.1.12 PLPZU000011	5 096	1 811 628,00	3,48%
6.1.1.13 PLPROJP00018	10 432	112 874,24	0,22%
6.1.1.14 PLPZBDT00013	95 035	598 720,50	1,15%
6.1.1.15 PLMSTSD00019	94 329	379 716,00	0,73%
6.1.1.16 PLPKN000016	49 149	2 130 659,15	4,10%
6.1.1.17 PLPKN000018	31 548	1 444 898,40	2,78%
6.1.1.18 PLPGNIG00014	237 504	847 889,28	1,63%
6.1.1.19 PLPGER000010	67 431	1 563 724,89	3,01%
6.1.1.20 PLPEKA000016	8 956	1 603 124,00	3,08%
6.1.1.21 PLPBG000029	1 016	216 408,00	0,42%
6.1.1.22 PLTRFRM00018	939	72 303,00	0,14%
6.1.1.23 PLMSTW500019	6 005	367 205,75	0,71%
6.1.1.24 PLSZPTL00010	182 667	593 667,75	1,14%
6.1.1.25 PLMRBUD00015	190 996	830 789,10	1,60%
6.1.1.26 PLBHS000016	14 759	72 231,10	0,14%
6.1.1.27 PLMRCOR00016	36 345	704 729,55	1,36%
6.1.1.28 PLMAKRM00019	272 036	533 190,56	1,03%
6.1.1.29 PLLOTO500025	19 817	720 347,95	1,39%
6.1.1.30 CAS012401058	245 868	368 471,44	0,75%
6.1.1.31 PLKLNRF00017	37 328	530 057,60	1,02%
6.1.1.32 PLIQPR00017	59 340	163 778,40	0,31%
6.1.1.33 PLIDMSA00044	62 021	184 822,58	0,36%
6.1.1.34 BG1100018057	41 003	190 253,82	0,37%
6.1.1.36 PLHBRWL00010	131 154	409 230,48	0,79%
6.1.1.38 PLBH0000012	563	52 640,50	0,10%
6.1.1.37 PLGTC0000037	10 887	266 731,50	0,51%
6.1.1.38 PLZPW0000017	26 817	284 260,20	0,55%
6.1.1.39 PLGSPR000014	38 511	442 876,50	0,85%
6.1.1.40 PLFERR000016	11 090	121 990,00	0,23%
6.1.1.41 PLERP000017	6 083	109 798,15	0,21%
6.1.1.42 PLESSYS00030	87 563	481 596,50	0,93%
6.1.1.43 PLERBUD00012	4 395	259 305,00	0,50%
6.1.1.44 PLEMZKA00019	41 459	48 507,03	0,09%
6.1.1.45 PLELDRO00017	5 562	585 234,80	1,13%
6.1.1.46 PLEM LAB00018	206 430	280 747,52	0,54%
6.1.1.47 PLEMCM00017	50 999	736 935,55	1,42%
6.1.1.48 PLEKHL00013	21 037	154 621,95	0,30%
6.1.1.49 PLEPH000022	408 336	469 586,40	0,90%
6.1.1.50 PLEDIN00014	25 194	165 280,40	0,32%
6.1.1.51 PLECHRS00019	37 554	180 259,20	0,35%
6.1.1.52 PLDUDA000016	57 847	94 869,08	0,18%
6.1.1.53 PLDLSS000010	15 981	265 124,79	0,51%
6.1.1.54 PLCFRPT00013	8 986	148 269,00	0,29%
6.1.1.55 PLCIC0400018	24 549	609 654,78	1,17%
6.1.1.56 PLCNTZP00010	1 088 325	478 863,00	0,92%
6.1.1.57 PLBZ0000044	214	45 988,60	0,09%
6.1.1.58 PLATREM00017	48 034	887 187,98	1,71%
6.1.1.59 PLALMST00010	28 320	150 662,40	0,29%
6.1.2 Pozostałe			
6.2 Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
7. Udziały			
8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	19 252	2 070 182,12	3,98%
8.1 Jednostki uczestnictwa	19 252	2 070 182,12	3,98%
8.1.1 Altus FI2	9 779	1 314 297,60	2,53%
8.1.2 JE00B24DK645	9 473	755 884,52	1,45%
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	304	420 285,00	0,81%
9.1 Opcje			
9.2 Kontrakty terminowe	304	420 285,00	0,81%
9.2.1 PLOGF0000919	304	420 285,00	0,81%
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 zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej			
15. Razem lokaty (suma 1-14), w tym	5 372 347	51 162 961,78	98,39%
15.1 Ulokowane na terenie RP	5 372 347	51 162 961,78	98,39%
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	-	-	-

Fundusz Strategia Wiele Klas Aktywów
sprawozdanie okresowe sporządzone na dzień 31-12-2010

Informacja dodatkowa

I.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, potrącane ze składki przypisanej brutto, przed ich przekazaniem na wszystkie fundusze prowadzone przez zakład ubezpieczeń		
3.	provizje, potrącenia ze składek przed ich przekazaniem na fundusz		
4.	inne koszty potrącane 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 i 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	16 058 464,43	-