

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2009

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	11 313 901,29	7 143 502,71
1.	Lokaty	11 255 939,89	6 634 709,86
2.	Środki pieniężne	57 961,40	292 398,87
3.	Należności, w tym	-	216 393,98
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	-	216 393,98
3.2	Pozostałe należności	-	-
4.	Pozostałe aktywa	-	-
II.	Zobowiązania	21 242,34	84 171,77
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	-	-
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	-
3	Pozostałe zobowiązania	21 242,34	84 171,77
III.	Aktywa netto (I-II)	11 292 658,95	7 059 330,94

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	8 327 706,30	11 292 658,95
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	3 766 561,09	
I.	Zwiększenia funduszu	7 016 551,08	-
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	7 016 551,08	-
2	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
3	Pozostałe zwiększenia	-	-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	-	-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	-	-
II.	Zmniejszenia funduszu	3 249 989,99	4 684 182,69
1	Tytułem wykupu	3 050 939,20	4 493 118,77
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	199 050,79	191 063,92
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)	- 801 608,44	450 854,68
1	z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	-	-
2	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związku jednostek samorządu terytorialnego	291 861,84	333 322,77
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	- 1 108 839,49	355 949,35
7	z udziałów	-	-
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	-	- 134 156,27
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych	-	- 113 043,68
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek	-	-
12	z nieruchomości	-	-
13	z depozytów bankowych	15 369,21	8 782,51
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	11 292 658,95	7 059 330,94

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	199 050,79	191 063,92
6	Pozostałe koszty	-	-
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	199 050,79	191 063,92

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	857 915,80840	1 204 762,32617
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1 204 762,32617	690 722,85623
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	9,70690	9,70690
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	8,54299	8,23437
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10,10157	10,82316
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	9,70690	10,22021

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	4 227 884,03	59,19%
1.1	Obligacje	4 227 884,03	59,19%
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	2 397 331,59	33,56%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	2 397 331,59	33,56%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	2 397 331,59	33,56%
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	9 494,24	0,13%
9.1	Opcje		
9.2	Kontrakty terminowe	9 494,24	0,13%
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	6 634 709,86	92,88%
15.1	Ulokowane na terenie RP	6 426 113,05	89,96%
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	208 596,81	2,92%
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	4 317	4 227 884,03	59,19%
1.1	Obligacje	4 317	4 227 884,03	59,19%
1.1.1	PL0000101598	15	16 076,70	0,23%
1.1.2	PL0000101937	12	12 272,16	0,17%
1.1.3	PL0000102224	125	126 425,00	1,77%
1.1.4	PL0000102646	414	403 070,40	5,64%
1.1.5	PL0000103222	98	97 657,98	1,37%
1.1.6	PL0000103305	1 009	1 018 434,15	14,26%
1.1.7	PL0000104717	1 026	1 003 438,26	14,05%
1.1.8	PL0000105078	135	132 975,00	1,86%
1.1.9	PL0000105433	266	277 725,28	3,89%
1.1.10	PL0000105441	440	422 664,00	5,92%
1.1.11	PL0000105524	536	499 016,00	6,99%
1.1.12	PL0000105730	241	218 129,10	3,05%
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	182 293	2 397 331,59	33,56%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	182 293	2 397 331,59	33,56%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	182 293	2 397 331,59	33,56%
6.1.1.1	NL0000474351	430	35 260,00	0,49%
6.1.1.2	PLAGORA00067	1 956	43 892,64	0,61%
6.1.1.3	PLATREM00017	7 966	123 473,00	1,73%
6.1.1.4	PLBIG0000016	13 128	63 014,40	0,88%
6.1.1.5	PLBRLNK00017	4 431	15 818,67	0,22%
6.1.1.6	PLBZ00000044	115	21 850,00	0,31%
6.1.1.7	PLCELZA00018	814	62 067,50	0,87%
6.1.1.8	PLCNKLM00016	2 333	26 596,20	0,37%
6.1.1.9	PLERBUD00012	1 222	58 350,50	0,82%
6.1.1.10	PLESSYS00030	7 810	34 442,10	0,48%
6.1.1.11	PLGTC0000037	2 015	51 684,75	0,72%
6.1.1.12	PLIDMSA00044	15 327	36 631,53	0,51%
6.1.1.13	PLKETY000011	1 270	153 797,00	2,15%
6.1.1.14	PLKGHM000017	1 089	115 434,00	1,62%
6.1.1.15	PLKLNK000017	3 386	48 589,10	0,68%
6.1.1.16	PLLOTOS00025	1 885	59 943,00	0,84%
6.1.1.17	PLMSTSD00019	11 351	45 063,47	0,63%
6.1.1.18	PLMSTWS00019	1 284	78 195,60	1,09%
6.1.1.19	PLNPNTS00012	961	24 025,00	0,34%
6.1.1.20	PLPEKA000016	340	54 978,00	0,77%
6.1.1.21	PLPGER000010	8 383	205 383,50	2,88%
6.1.1.22	PLPGNIG00014	59 829	226 751,91	3,17%
6.1.1.23	PLPKN0000018	4 021	136 512,95	1,91%
6.1.1.24	PLPKO0000016	3 471	131 898,00	1,85%
6.1.1.25	PLPOLND00019	630	21 892,50	0,31%
6.1.1.26	PLPZBDT00013	9 866	49 231,34	0,69%
6.1.1.27	PLSOFTB00016	916	57 662,20	0,81%
6.1.1.28	PLTLKPL00017	5 444	86 396,28	1,21%

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2009

6.1.1.29	PLTRFRM00018	713	52 405,50	0,73%
6.1.1.30	PLTRKPL00014	5 494	22 855,04	0,32%
6.1.1.31	SK1120009230	1 837	44 639,10	0,62%
6.1.1.32	US1534351028	2 576	208 596,81	2,92%
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	7	9 494,24	0,13%
9.1	Opcje			
9.2	Kontrakty terminowe	7	9 494,24	0,13%
9.2.1	PL0GF0000398	7	9 494,24	0,13%
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	186 617	6 634 709,86	92,88%
15.1	Ulokowane na terenie RP	184 041	6 426 113,05	89,96%
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	2 576	208 596,81	2,92%
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD			

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2009

Informacja dodatkowa

l.p.		okres poprzedni	okres bieżący
1.	składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy	93 114 999,95	93 114 999,95
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)	1 467 143,30	1 467 143,30
5.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń	91 647 856,65	91 647 856,65
6.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie	9 111 063,70	7 016 551,08