

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

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-------------|---|-----------------|---------------|
| I. | Aktywa | 12 970 170,33 | 3 316 288,10 |
| 1. | Lokaty | 12 968 662,10 | 3 316 016,47 |
| 2. | Środki pieniężne | 1 508,23 | 271,63 |
| 3. | Należności, w tym | - | - |
| 3.1 | Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego | - | - |
| 3.2 | Pozostałe należności | - | - |
| 4. | Pozostałe aktywa | - | - |
| II. | Zobowiązania | 7 118,32 | 1 827,55 |
| 1 | Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego | - | - |
| 2 | Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | - | - |
| 3 | Pozostałe zobowiązania | 7 118,32 | 1 827,55 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 12 963 052,01 | 3 314 460,55 |

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

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------|---|----------------------|----------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu | - | 12 963 052,01 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | | |
| I. | Zwiększenia funduszu | 12 796 329,37 | - |
| 1 | Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 12 796 329,37 | - |
| 2 | Tytułem udzielonych gwarancji | - | - |
| 3 | Pozostałe zwiększenia | - | - |
| 3a | Przeniesienia z pozostałych funduszy | - | - |
| 3b | Inne (w tym przydział środków własnych) | - | - |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 21 980,65 | 10 186 049,44 |
| 1 | Tytułem wykupu | - | 10 121 792,65 |
| 2 | Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | - | - |
| 3 | Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych 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 | 21 980,65 | 64 256,79 |
| 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) | 188 703,29 | 537 457,98 |
| 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 | 182 418,84 | 601 815,36 |
| 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 | 75,95 | 10 744,49 |
| 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 | - | 56 828,08 |
| 10 | z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | - | - |
| 11 | z pożyczek | - | - |
| 12 | z nieruchomości | - | - |
| 13 | z depozytów bankowych | 6 208,50 | 3 215,19 |
| 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 | 12 963 052,01 | 3 314 460,55 |

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

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 | 21 980,65 | 64 256,79 |
| 6 | Pozostałe koszty | | - |
| 7 | RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6) | 21 980,65 | 64 256,79 |

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|----------------|--|------------------------|----------------------|
| 1. | Liczba jednostek rozrachunkowych | | |
| 1.1 | Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | - | 1 338 428,48845 |
| 1.2 | Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 1 338 428,48845 | 328 892,36631 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej | | |
| 2.1 | Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | - | 9,68528 |
| 2.2 | Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 8,68124 | 6,33024 |
| 2.3 | Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 10,16739 | 10,78656 |
| 2.4 | Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 9,68528 | 10,07765 |

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 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 1.1 | Obligacje | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 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 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 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 | 3 281 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 1.1 | Obligacje | 3 281 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 1.1.1 | PL0000101598 | 21 | 22 507,38 | 0,68% |
| 1.1.2 | PL0000101937 | 1 037 | 1 060 519,16 | 31,98% |
| 1.1.3 | PL0000102224 | 129 | 130 470,60 | 3,93% |
| 1.1.4 | PL0000103222 | 213 | 212 256,63 | 6,40% |
| 1.1.5 | PL0000103305 | 1 003 | 1 012 378,05 | 30,53% |
| 1.1.6 | PL0000104287 | 429 | 438 751,17 | 13,23% |
| 1.1.7 | PL0000104717 | 448 | 438 148,48 | 13,21% |
| 1.1.8 | PL0000105078 | 1 | 985,00 | 0,03% |
| 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 | | | |
| 9.3 | 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 | 3 281 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 3 281 | 3 316 016,47 | 99,99% |
| 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 | | | |

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Skarbowa 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 | 35 215 810,93 |
| 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 | 1 269 230,60 |
| 5. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń | 91 647 856,65 | 33 946 580,33 |
| 6. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie | 12 796 329,37 | - |