

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

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|----------------|---|------------------------|----------------------|
| I. | Aktywa | 11 041 952,05 | 16 104 354,70 |
| 1. | Lokaty | 10 965 542,14 | 13 557 082,76 |
| 2. | Środki pieniężne | 76 409,91 | 1 987 523,77 |
| 3. | Należności, w tym | - | 559 748,17 |
| 3.1 | Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego | - | 559 748,17 |
| 3.2 | Pozostałe należności | - | - |
| 4. | Pozostałe aktywa | - | - |
| II. | Zobowiązania | 24 425,97 | 187 796,21 |
| 1 | Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego | - | - |
| 2 | Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | - | - |
| 3 | Pozostałe zobowiązania | 24 425,97 | 187 796,21 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 11 017 526,08 | 15 916 558,49 |

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

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------------|---|-----------------------|----------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu | 10 230 027,93 | 11 017 526,08 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 3 233 267,87 | |
| I. | Zwiększenia funduszu | 10 848 885,14 | 4 690 136,99 |
| 1 | Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 10 848 885,14 | 4 690 136,99 |
| 2 | Tytułem udzielonych gwarancji | - | - |
| 3 | Pozostałe zwiększenia | - | - |
| 3a | Przeniesienia z pozostałych funduszy | - | - |
| 3b | Inne (w tym przydział środków własnych) | - | - |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 7 615 617,27 | 1 284 673,61 |
| 1 | Tytułem wykupu | 7 360 344,08 | 958 986,63 |
| 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 | 255 273,19 | 325 686,98 |
| 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) | - 2 445 769,72 | 1 493 569,03 |
| 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 | 295 532,83 | 213 121,27 |
| 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 | - 2 765 557,69 | 1 828 542,77 |
| 7 | z udziałów | - | - |
| 8 | z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych | - | - 315 987,00 |
| 9 | z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych | - | - 254 255,68 |
| 10 | z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | - | - |
| 11 | z pożyczek | - | - |
| 12 | z nieruchomości | - | - |
| 13 | z depozytów bankowych | 24 255,14 | 22 147,67 |
| 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 | 11 017 526,08 | 15 916 558,49 |

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 | 255 298,19 | 325 686,98 |
| 6 | Pozostałe koszty | - | - |
| 7 | RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6) | 255 298,19 | 325 686,98 |

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| Pozycja | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-----------|--|-----------------|-----------------|
| 1. | Liczba jednostek rozrachunkowych | | |
| 1.1 | Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego | 1 032 989,58788 | 1 297 808,67041 |
| 1.2 | Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 1 297 808,67041 | 1 637 821,92764 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej | | |
| 2.1 | Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 9,90332 | 8,48933 |
| 2.2 | Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 7,35370 | 7,21423 |
| 2.3 | Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 11,10608 | 11,79318 |
| 2.4 | Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 8,48933 | 9,71813 |

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 | 5 102 520,67 | 31,68% |
| 1.1 | Obligacje | 5 102 520,67 | 31,68% |
| 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 | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 6.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 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 | 16 275,84 | 0,10% |
| 9.1 | Opcje | | |
| 9.2 | Kontrakty terminowe | 16 275,84 | 0,10% |
| 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 | 13 557 082,76 | 84,18% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 12 869 182,94 | 79,91% |
| 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 | 687 899,82 | 4,27% |
| 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 | 5 262 | 5 102 520,67 | 31,68% |
| 1.1 | Obligacje | 5 262 | 5 102 520,67 | 31,68% |
| 1.1.1 | PL0000101598 | 7 | 7 502,46 | 0,05% |
| 1.1.2 | PL0000101937 | 7 | 7 158,76 | 0,04% |
| 1.1.3 | PL0000102224 | 85 | 85 969,00 | 0,53% |
| 1.1.4 | PL0000102646 | 49 | 47 706,40 | 0,30% |
| 1.1.5 | PL0000103222 | 160 | 159 441,60 | 0,99% |
| 1.1.6 | PL0000103305 | 819 | 826 657,65 | 5,13% |
| 1.1.7 | PL0000104717 | 1 300 | 1 271 413,00 | 7,89% |
| 1.1.8 | PL0000105078 | 1 125 | 1 108 125,00 | 6,88% |
| 1.1.9 | PL0000105441 | 9 | 8 645,40 | 0,05% |
| 1.1.10 | PL0000105524 | 1 557 | 1 449 567,00 | 9,00% |
| 1.1.11 | PL0000105730 | 144 | 130 334,40 | 0,81% |
| 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 | 593 011 | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 6.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | 593 011 | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | 593 011 | 8 438 286,25 | 52,40% |
| 6.1.1.1 | NL0000474351 | 1 858 | 152 356,00 | 0,95% |
| 6.1.1.2 | PLAGORA00067 | 6 133 | 137 624,52 | 0,85% |
| 6.1.1.3 | PLATREM00017 | 22 342 | 346 301,00 | 2,15% |
| 6.1.1.4 | PLBIG0000016 | 42 880 | 205 824,00 | 1,28% |
| 6.1.1.5 | PLBRLNK00017 | 12 176 | 43 468,32 | 0,27% |
| 6.1.1.6 | PLBZ00000044 | 846 | 160 740,00 | 1,00% |
| 6.1.1.7 | PLCELZA00018 | 2 095 | 159 743,75 | 0,99% |
| 6.1.1.8 | PLCNKLM00016 | 9 631 | 109 793,40 | 0,68% |
| 6.1.1.9 | PLERBUD00012 | 4 731 | 225 905,25 | 1,40% |
| 6.1.1.10 | PLESSYS00030 | 26 447 | 116 631,27 | 0,72% |
| 6.1.1.11 | PLGTC0000037 | 5 886 | 150 975,90 | 0,94% |
| 6.1.1.12 | PLIDMSA00044 | 52 456 | 125 369,84 | 0,78% |
| 6.1.1.13 | PLKETY000011 | 3 474 | 420 701,40 | 2,61% |
| 6.1.1.14 | PLKGHM000017 | 5 298 | 561 588,00 | 3,49% |
| 6.1.1.15 | PLKLNRO00017 | 13 630 | 195 590,50 | 1,21% |
| 6.1.1.16 | PLLOTOS00025 | 6 176 | 196 396,80 | 1,22% |
| 6.1.1.17 | PLMSTSD00019 | 31 124 | 123 562,28 | 0,77% |
| 6.1.1.18 | PLMSTWS00019 | 4 162 | 253 465,80 | 1,57% |
| 6.1.1.19 | PLNPNTS00012 | 3 106 | 77 650,00 | 0,48% |
| 6.1.1.20 | PLPEKAO00016 | 2 287 | 369 807,90 | 2,30% |
| 6.1.1.21 | PLPGERO00010 | 24 249 | 594 100,50 | 3,69% |
| 6.1.1.22 | PLPGNIG00014 | 179 918 | 681 889,22 | 4,23% |
| 6.1.1.23 | PLPKN0000018 | 18 775 | 637 411,25 | 3,96% |
| 6.1.1.24 | PLPKO0000016 | 14 690 | 558 220,00 | 3,47% |
| 6.1.1.25 | PLPOLND00019 | 1 851 | 64 322,25 | 0,40% |
| 6.1.1.26 | PLPZBDT00013 | 39 902 | 199 110,98 | 1,24% |
| 6.1.1.27 | PLSOFTB00016 | 2 672 | 168 202,40 | 1,04% |
| 6.1.1.28 | PLTLKPL00017 | 21 792 | 345 839,04 | 2,15% |
| 6.1.1.29 | PLTRFRM00018 | 2 123 | 156 040,50 | 0,97% |
| 6.1.1.30 | PLTRKPL00014 | 15 796 | 65 711,36 | 0,41% |
| 6.1.1.31 | SK1120009230 | 6 010 | 146 043,00 | 0,91% |
| 6.1.1.32 | US1534351028 | 8 495 | 687 899,82 | 4,27% |
| 6.1.2 | Pozostałe | | | |
| 6.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | | |

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

| | | | | |
|------------|--|----------------|----------------------|---------------|
| 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 | 12 | 16 275,84 | 0,10% |
| 9.1 | Opcje | | | |
| 9.2 | Kontrakty terminowe | 12 | 16 275,84 | 0,10% |
| 9.2.1 | PL0GF0000398 | 12 | 16 275,84 | 0,10% |
| 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 | 598 285 | 13 557 082,76 | 84,18% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 589 790 | 12 869 182,94 | 79,91% |
| 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 | 8 495 | 687 899,82 | 4,27% |
| 15.4 | Ulokowane poza RP, UE i OECD | | | |

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Agresywna 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 | 10 848 885,14 | 4 690 136,99 |