

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

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	28 784 485,58	19 537 649,63
1.	Lokaty	28 779 782,69	18 491 071,84
2.	Środki pieniężne	4 702,89	596 433,00
3.	Należności, w tym	-	450 144,79
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	-	450 144,79
3.2	Pozostałe należności	-	-
4.	Pozostałe aktywa	-	-
II.	Zobowiązania	31 949,00	126 334,32
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	-	-
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	-
3	Pozostałe zobowiązania	31 949,00	126 334,32
III.	Aktywa netto (I-II)	28 752 536,58	19 411 315,31

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

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	6 282 306,93	28 752 536,58
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	23 211 362,53	
I.	Zwiększenia funduszu	26 471 045,31	5 172 557,39
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	26 471 045,31	5 172 557,39
2	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
3	Pozostałe zwiększenia	-	-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	-	-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	-	-
II.	Zmniejszenia funduszu	3 259 682,79	16 270 954,30
1	Tytułem wykupu	3 000 000,00	15 907 574,50
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	259 682,79	363 379,80
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)	- 741 132,88	1 757 175,64
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	721 196,99	1 116 506,68
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	- 1 487 950,80	1 158 648,75
7	z udziałów	-	-
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	-	- 251 539,70
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych	-	- 286 362,97
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek	-	-
12	z nieruchomości	-	-
13	z depozytów bankowych	19 922,89	19 922,89
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	28 752 536,58	19 411 315,31

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Dochodowa 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	259 682,79	363 379,80
6	Pozostałe koszty	-	-
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	259 682,79	363 379,80

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	626 509,46276	2 962 398,53573
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	2 962 398,53573	1 866 280,79497
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	10,02747	9,70583
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9,45131	6,24380
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9,45131	11,30579
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	9,70583	10,40107

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	15 409 679,23	78,87%
1.1	Obligacje	15 409 679,23	78,87%
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	3 071 898,37	15,72%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	3 071 898,37	15,72%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	3 071 898,37	15,72%
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	0,05%
9.1	Opcje		
9.2	Kontrakty terminowe	9 494,24	0,05%
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	18 491 071,84	94,64%
15.1	Ulokowane na terenie RP	18 177 852,71	93,04%
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	313 219,13	1,60%
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	15 655	15 409 679,23	78,87%
1.1	Obligacje	15 655	15 409 679,23	78,87%
1.1.1	PL0000101598	30	32 153,40	0,16%
1.1.2	PL0000101937	797	815 075,95	4,17%
1.1.3	PL0000102224	363	367 138,20	1,88%
1.1.4	PL0000102646	1 493	1 453 584,80	7,44%
1.1.5	PL0000103222	323	321 872,73	1,65%
1.1.6	PL0000103305	3 400	3 431 790,00	17,57%
1.1.7	PL0000104717	3 423	3 347 728,23	17,13%
1.1.8	PL0000105078	1 283	1 263 755,00	6,47%
1.1.9	PL0000105433	944	985 611,52	5,04%
1.1.10	PL0000105441	1 561	1 499 496,60	7,67%
1.1.11	PL0000105524	1 810	1 685 110,00	8,62%
1.1.12	PL0000105730	228	206 362,80	1,06%
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	248 832	3 071 898,37	15,72%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	248 832	3 071 898,37	15,72%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	248 832	3 071 898,37	15,83%
6.1.1.1	NL0000474351	579	47478,00	0,24%
6.1.1.2	PLAGORA00067	2 430	54529,20	0,28%
6.1.1.3	PLATREM00017	10 547	163478,50	0,84%
6.1.1.4	PLBIG0000016	14 252	68409,60	0,35%
6.1.1.5	PLBRLNK00017	5 434	19399,38	0,10%
6.1.1.6	PLBZ00000044	241	45790,00	0,23%
6.1.1.7	PLCELZA00018	1 303	99353,75	0,51%
6.1.1.8	PLCNKLM00016	3 835	43719,00	0,22%
6.1.1.9	PLERBUD00012	1 713	81795,75	0,42%
6.1.1.10	PLESSYS00030	10 005	44122,05	0,23%
6.1.1.11	PLGTC0000037	2 840	72846,00	0,37%
6.1.1.12	PLIDMSA00044	20 044	47905,16	0,25%
6.1.1.13	PLKETY000011	1 293	156582,30	0,80%
6.1.1.14	PLKGHM000017	510	54060,00	0,28%
6.1.1.15	PLKLNK000017	4 439	63699,65	0,33%
6.1.1.16	PLLOTOS00025	2 223	70691,40	0,36%
6.1.1.17	PLMSTSD00019	14 645	58140,65	0,30%
6.1.1.18	PLMSTWS00019	1 611	98109,90	0,50%
6.1.1.19	PLNPNTS00012	1 551	38775,00	0,20%
6.1.1.20	PLPEKA000016	297	48024,90	0,25%
6.1.1.21	PLPGER000010	14 391	352579,50	1,80%
6.1.1.22	PLPGNIG00014	97 538	369669,02	1,89%
6.1.1.23	PLPKN0000018	3 968	134713,60	0,69%
6.1.1.24	PLPKO0000016	4 845	184110,00	0,94%
6.1.1.25	PLPOLND00019	788	27383,00	0,14%
6.1.1.26	PLPZBDT00013	11 659	58178,41	0,30%
6.1.1.27	PLSOFTB00016	986	62068,70	0,32%
6.1.1.28	PLTLKPL00017	1 934	30692,58	0,16%

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

6.1.1.29	PLTRFRM00018	1 116	82026,00	0,42%
6.1.1.30	PLTRKPL00014	5 599	23291,84	0,12%
6.1.1.31	SK1120009230	2 348	57056,40	0,29%
6.1.1.32	US1534351028	3 868	313219,13	1,60%
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	0,05%
9.1	Opcje			
9.2	Kontrakty terminowe	7	9 494,24	0,05%
9.2.1	PL0GF0000398	7	9 494,24	0,05%
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	264 494	18 491 071,84	94,64%
15.1	Ulokowane na terenie RP	260 626	18 177 852,71	93,04%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	0	0,00	0,00%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD	3 868	313 219,13	1,60%
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD			

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Dochodowa 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	26 471 045,31	5 172 557,39