

**I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU**

<b>(w zł.)</b>		<b>Okres poprzedni</b>	<b>Okres bieżący</b>
<b>I.</b>	<b>Aktywa</b>	34 706 865,22	41 860 161,98
1.	Lokaty	34 706 865,20	41 860 161,98
2.	Środki pieniężne	0,02	-
3.	Należności, w tym		
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego		
3.2	Pozostałe należności		
4.	Pozostałe aktywa		
<b>II.</b>	<b>Zobowiązania</b>	-	-
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego		
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3	Pozostałe zobowiązania		
<b>III.</b>	<b>Aktywa netto (I-II)</b>	34 706 865,22	41 860 161,98

## II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU ZRÓWNOWAŻONY

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
<b>A.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na początek okresu</b>	26 471 549,64	34 706 865,22
<b>B.</b>	<b>Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)</b>	3 341 680,76	1 528 312,83
<b>I.</b>	<b>Zwiększenia funduszu</b>	<b>10 488 953,69</b>	<b>9 555 244,72</b>
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	9 286 855,75	8 573 894,83
2	Tytułem udzielonych gwarancji		
3	Pozostałe zwiększenia	1 202 097,94	981 349,89
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	739 010,70	851 801,53
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	463 087,24	129 548,36
<b>II.</b>	<b>Zmniejszenia funduszu</b>	<b>7 147 272,93</b>	<b>8 026 931,89</b>
1	Tytułem wykupu	4 153 086,03	4 714 852,38
2	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	3 215,03	
3	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	2 056 401,02	1 882 854,21
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	757 813,55	959 890,70
8	Tytułem udzielonych gwarancji		
9	Pozostałe zmniejszenia	176 757,30	469 334,60
9a	Przeniesienia do pozostałych funduszy	157 787,90	82 400,83
9b	Inne (w tym wycofanie środków własnych)	18 969,40	386 933,77
<b>C.</b>	<b>Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)</b>	<b>4 893 634,82</b>	<b>5 624 983,93</b>
1	z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	1 333 484,34	844 185,07
2	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
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	3 398 058,17	4 573 114,14
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		
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu		6 685,14
11	z pożyczek		
12	z nieruchomości		
13	z depozytów bankowych	162 092,31	200 999,58
14	z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
<b>D.</b>	<b>Pozostałe zwiększenia</b>		
<b>E.</b>	<b>Pozostałe zmniejszenia</b>		
<b>F.</b>	<b>Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego</b>	<b>34 706 865,22</b>	<b>41 860 161,98</b>

**III. KOSZTY FUNDUSZU**

<b>(w zł.)</b>		<b>Okres poprzedni</b>	<b>Okres bieżący</b>
1	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	520,00	600,00
2	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych		
3	Koszty przechowywania aktywów funduszu		
4	Koszty transakcyjne		
5	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	757 813,55	140 429,79
6	Pozostałe koszty		
7	<b>RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)</b>	<b>758 333,55</b>	<b>141 029,79</b>

**IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH**

<b>Pozycja</b>		<b>Okres poprzedni</b>	<b>Okres bieżący</b>
<b>1.</b>	<b>Liczba jednostek rozrachunkowych</b>		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	1 552 935,52865	1 763 011,60739
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1 763 011,60739	1 886 935,56830
<b>2.</b>	<b>Wartość jednostki rozrachunkowej</b>		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	18,02	20,71
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	17,67	20,71
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	20,75	23,75
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	<b>20,71</b>	<b>23,43</b>

## VI. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

Lokaty	Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (%)
<b>Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska</b>	<b>17594</b>	<b>18 478 470,82</b>	<b>44,14%</b>
1. Obligacje	17594	18 478 470,82	44,14%
1.1. PS0310	500	538 400,00	1,28%
1.1.2. DS1110	124	129 651,92	0,31%
1.1.3. DS0509	5400	5 779 728,00	13,81%
1.1.4. OK0807	3200	3 124 860,00	7,46%
1.1.5. PS0606	4526	4 754 110,40	11,36%
1.1.6. PS0607	65	69 586,40	0,16%
1.1.7. DS1015	3700	4 003 992,00	9,57%
1.1.8. OK0407	79	78 202,10	0,19%
1.2. Bony skarbowe			
1.2.1.			
1.3. Inne			
1.3.1.			
<b>Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego</b>			
2.			
<b>3. Listy zastawne</b>			
3.1. Dopuszczone do publicznego obrotu			
3.1.1. Notowane na rynku regulowanym			
3.1.2. Pozostałe			
3.2. Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
<b>4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu</b>			
4.1. Notowane na rynku regulowanym			
4.2. Pozostałe			
<b>5. Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>			
5.1. Dopuszczone do publicznego obrotu			
5.1.1. Notowane na rynku regulowanym			
5.1.2. Pozostałe			
5.2. Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
<b>6. Akcje</b>			
6.1. Dopuszczone do publicznego obrotu			
6.1.1. Notowane na rynku regulowanym	435385	12 570 803,66	30,03%
6.1.1.1. Amica	1967	57 043,00	0,14%
6.1.1.2. Amrest (EAT)	815	60 391,50	0,14%
6.1.1.3. Asator	5060	111 724,80	0,27%
6.1.1.4. ATM	550	95 590,00	0,23%
6.1.1.5. Bank BPH	363	336 319,50	0,80%
6.1.1.6. Bioton	98482	214 690,76	0,51%
6.1.1.7. BRE	901	302 736,00	0,72%
6.1.1.8. Bioton	1443	29 148,60	0,07%
6.1.1.9. BZ-WBK	1355	304 875,00	0,73%
6.1.1.10. CCC	2105	105 250,00	0,25%
6.1.1.11. CEZ	2208	298 080,00	0,71%
6.1.1.12. Cech	2048	131 891,20	0,32%
6.1.1.13. CinemaCity	3263	74 252,92	0,18%
6.1.1.14. CompRzesz (Assecopol)	742	244 860,00	0,58%
6.1.1.15. Decora	402	20 280,90	0,05%
6.1.1.16. Dwory	3250	254 150,00	0,61%
6.1.1.17. Echo	2692	237 357,00	0,57%
6.1.1.18. Elistarol	17151	226 407,45	0,55%
6.1.1.19. EnergoPol	540	31 887,00	0,08%
6.1.1.20. Famur	346	139 195,80	0,33%
6.1.1.21. Grajewo	2077	116 312,00	0,28%
6.1.1.22. GTC	8931	359 026,20	0,86%
6.1.1.23. HILSTREFA	191	18 870,80	0,05%
6.1.1.24. Hydrobud	509	60 316,50	0,14%
6.1.1.25. Hydrotol	2669	124 108,50	0,30%
6.1.1.26. INGSBK	239	183 552,00	0,44%
6.1.1.27. Inleria	1409	98 471,50	0,21%
6.1.1.28. Kely	1094	216 800,00	0,52%
6.1.1.29. KGHM	9952	885 728,00	2,12%
6.1.1.30. Koelner S.A.	430	22 790,00	0,05%
6.1.1.31. Kogeneracja	1041	58 087,80	0,14%
6.1.1.32. Kuk	604	81 540,00	0,19%
6.1.1.33. Lena	1268	13 415,44	0,03%
6.1.1.34. Lotos	3586	176 789,80	0,42%
6.1.1.35. Microsoft	556	25 715,00	0,06%
6.1.1.36. Millennium	16801	133 567,95	0,32%
6.1.1.37. Nafita	1879	52 043,30	0,12%
6.1.1.38. Netia	13288	67 104,40	0,16%
6.1.1.39. Orbis	2114	133 393,40	0,32%
6.1.1.40. Pamapol B	3008	68 853,12	0,16%
6.1.1.41. PBG S.A.	108	27 745,20	0,07%
6.1.1.42. PolKAO	4114	933 466,50	2,23%
6.1.1.43. PEP	3137	47 539,25	0,11%
6.1.1.44. PGNiG	73064	263 030,40	0,63%
6.1.1.45. PKN ORLEN	19076	909 925,20	2,17%
6.1.1.46. PKO BP	25808	1 212 976,00	2,90%
6.1.1.47. Polimozem	1358	206 416,00	0,49%
6.1.1.48. Praterm	3414	156 702,80	0,37%
6.1.1.49. Projrzem	317	12 363,00	0,03%
6.1.1.50. Polnord	901	72 981,00	0,17%
6.1.1.51. Ropczyce	2856	96 475,68	0,23%
6.1.1.52. Sanoh	721	147 865,00	0,35%
6.1.1.53. Softbank	2250	112 950,00	0,27%
6.1.1.54. Šrubex	1004	38 654,00	0,09%
6.1.1.55. Swiecie (MPP)	1026	108 704,00	0,25%
6.1.1.56. TomFarm	1162	77 854,00	0,19%
6.1.1.57. TP S.A.	49973	1 226 837,15	2,93%
6.1.1.58. TVN	6435	160 231,50	0,38%
6.1.1.59. Vistula	758	68 220,00	0,16%
6.1.1.60. Wawel	1021	268 625,10	0,64%
6.1.1.61. WSIP	19247	221 725,44	0,53%
6.1.1.62. ZPUE	26	7 654,40	0,02%
6.2. Pozostałe			
6.2. Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
<b>7. Udziały</b>			
<b>8. Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych</b>			
8.1. Jednostki uczestnictwa			
8.2. Certyfikaty inwestycyjne			
8.2.1. Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonyjących lokat wyłącznie w nieruchomości			
8.2.2. Certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych			
<b>9. Instrumenty pochodne o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych</b>			
9.1. Opcje			
9.2. Kontrakty terminowe			
9.3. Swapy walutowe			
9.4. Swapy procentowe			
9.5. Prawa poboru			
9.6. Inne instrumenty pochodne			
<b>10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu</b>	<b>999</b>	<b>13 595,14</b>	<b>0,03%</b>
10.1. BytomPDA	682	13 435,40	0,03%
10.2. ProjrzemPP	317	69,74	0,00%
<b>11. Pożyczki</b>			
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			
<b>12. Nieruchomości</b>			
<b>13. Depozyty bankowe</b>	<b>1</b>	<b>10 797 382,36</b>	<b>25,79%</b>
13.1. Bank Handlowy w Warszawie	1	10 797 382,36	25,79%
<b>Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej</b>			
<b>14. Razem lokaty (suma 1-14), w tym</b>	<b>453979</b>	<b>41 860 161,98</b>	<b>100%</b>
15.1. Ulokowane na terenie RP	453979	41 860 161,98	100%
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			

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2006

Informacja dodatkowa

l.p.		stan na dzień 30.12.2005	stan na dzień 29.12.2006
1.	składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy*	18 735 427,86	16 384 160,63
2.	opłaty za ryzyko, potrącone ze składki przypisanej brutto, przed ich przekazaniem na wszystkie fundusze prowadzone przez zakład ubezpieczeń	-	
3.	prowizje, potrącenia ze składek przed ich przekazaniem na fundusz	-	
4.	inne koszty potrącone ze składek przed ich przekazaniem na fundusze (koszty wstępne, różnice w cenach)	1 602 745,83	1 296 051,08
5.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń	17 132 682,03	15 088 109,55
6.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie	9 286 855,75	8 573 894,83

\* składka, która wpłynęła do TU z tytułu umów ubezpieczeń w dziale I gr. 3