

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2009

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	39 115 565,63	44 998 771,61
1.	Lokaty	39 115 565,63	42 247 042,96
2.	Środki pieniężne		2 751 728,65
3.	Należności, w tym		
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego		
3.2	Pozostałe należności		
4.	Pozostałe aktywa		
II.	Zobowiązania	-	-
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego		
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3	Pozostałe zobowiązania		
III.	Aktywa netto (I-II)	39 115 565,63	44 998 771,61

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2009

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU ZRÓWNOWAŻONY

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	45 601 808,88	39 115 565,63
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	326 055,09	- 870 273,47
I.	Zwiększenia funduszu	8 847 434,79	7 778 060,83
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	8 391 838,03	7 727 642,96
2	Tytułem udzielonych gwarancji		
3	Pozostałe zwiększenia	455 596,76	50 417,87
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	332 849,91	50 417,87
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	122 746,85	
II.	Zmniejszenia funduszu	8 521 379,70	8 648 334,30
1	Tytułem wykupu	5 302 294,52	5 406 082,12
2	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	1 768 831,44	1 580 971,78
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	1 068 921,19	1 046 846,92
8	Tytułem udzielonych gwarancji		
9	Pozostałe zmniejszenia	381 332,55	614 433,48
9a	Przeniesienia do pozostałych funduszy	381 332,55	245 963,46
9b	Inne (w tym wycofanie środków własnych)		368 470,02
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	- 6 812 298,34	6 753 479,45
1	z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	1 233 397,46	1 522 140,64
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	- 8 542 958,06	5 156 778,32
7	z udziałów		
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych		
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych		
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek		
12	z nieruchomości		
13	z depozytów bankowych	497 262,26	74 560,49
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	39 115 565,63	44 998 771,61

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2009

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	60,00	65,00
2	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych		
3	Koszty przechowywania aktywów funduszu		
4	Koszty transakcyjne		
5	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	1 068 921,19	1 046 846,92
6	Pozostałe koszty		
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	1 068 981,19	1 046 911,92

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	1 980 989,00062	2 021 797,03085
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	2 021 797,03085	2 023 732,81002
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	23,14078	19,34693
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	18,87083	18,09118
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	23,14078	22,28505
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	19,34693	22,23553

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2009

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	28 846 931,40	64,11%
1.1	Obligacje	28 846 931,40	64,11%
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	13 400 111,56	29,78%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	13 400 111,56	29,78%
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		
13.1	Bank Handlowy w Warszawie		
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	42 247 042,96	93,88%
15.1	Ulokowane na terenie RP	42 247 042,96	93,88%
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 2009

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	31 242	28 846 931,40	64,11%
1.1	Obligacje	31 242	28 846 931,40	64,11%
1.1.1	DS1019	2 400	2 305 440,00	5,12%
1.1.2	DS1110	1 500	1 534 020,00	3,41%
1.1.3	OK0112	232	209 983,20	0,47%
1.1.4	OK0711	9 500	8 844 500,00	19,65%
	OK0712	13 100	11 546 340,00	25,66%
1.2	PS0310	210	220 168,20	0,49%
1.2.1	WS0922	4 300	4 186 480,00	9,30%
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	820 120	13 400 111,56	29,78%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	820 120	13 400 111,56	29,78%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	820 120	13 400 111,56	29,78%
6.1.1.1	Apator	14 747	234 624,77	0,52%
6.1.1.2	BBIDEVNFI(12PIAST)	159 169	62 075,91	0,14%
6.1.1.3	BOGDANKA	9 712	689 552,00	1,53%
6.1.1.4	Bomi	17 731	219 864,40	0,49%
6.1.1.5	BRE	667	173 420,00	0,39%
6.1.1.6	BUDIMEX	4 634	338 282,00	0,75%
6.1.1.7	BZ-WBK	3 387	643 530,00	1,43%
6.1.1.8	Cersanit	19 511	320 955,95	0,71%
6.1.1.9	CEZ	1 088	145 792,00	0,32%
6.1.1.10	Ciech	1 509	56 134,80	0,12%
6.1.1.11	Cyfrowy Polsat	11 645	158 372,00	0,35%
6.1.1.12	ACP(SOFTBANK)	4 405	277 294,75	0,62%
6.1.1.13	Dwory(SYNTHOS)	46 338	53 752,08	0,12%
6.1.1.14	Echo	18 871	78 692,07	0,17%
6.1.1.15	ERBUD S.A.	11 295	539 336,25	1,20%
6.1.1.16	ES System S.A.	26 403	116 437,23	0,26%
6.1.1.17	Famur	12 063	25 935,45	0,06%
6.1.1.18	GTC	5 578	143 075,70	0,32%
6.1.1.19	HANDLOWY	1 640	114 800,00	0,26%
6.1.1.20	Hydrotor	9 523	311 402,10	0,69%
6.1.1.21	IMMOEAST	5 848	93 568,00	0,21%
6.1.1.22	INGBSK	369	287 820,00	0,64%
6.1.1.23	InstalKRK	7 431	124 097,70	0,28%
6.1.1.24	J.W. CONSTRUCTION	24 467	286 263,90	0,64%
6.1.1.25	Kęty	841	101 845,10	0,23%
6.1.1.26	KGHM	6 956	737 336,00	1,64%
6.1.1.27	LPP	29	46 110,00	0,10%
6.1.1.28	Millennium	3 124	14 995,20	0,03%
6.1.1.29	NEW WORLD RESOURCES	8 745	221 248,50	0,49%
6.1.1.30	Orbis	705	31 273,80	0,07%
6.1.1.31	PBG S.A.	360	73 152,00	0,16%
6.1.1.32	POL-AQUA	1 510	26 274,00	0,06%
6.1.1.33	PEKAO	7 666	1 239 592,20	2,75%
6.1.1.34	PEP	11 132	367 356,00	0,82%

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2009

6.1.1.35	PGNiG	112 288	425 571,52	0,95%
6.1.1.36	PKNORLEN	26 777	909 079,15	2,02%
6.1.1.37	PKO BP	27 664	1 051 232,00	2,34%
6.1.1.38	Polimexms	33 098	131 399,06	0,29%
6.1.1.39	RUCH	25 700	200 203,00	0,44%
6.1.1.40	Sanok	18 407	189 592,10	0,42%
6.1.1.41	Stalprodukt	176	104 544,00	0,23%
6.1.1.42	SWIECIE	2 683	204 578,75	0,45%
6.1.1.43	TPSA	35 822	568 495,14	1,26%
6.1.1.44	TVN	50 032	714 957,28	1,59%
6.1.1.45	WSIP	27 741	463 274,70	1,03%
6.1.1.46	ZPUE	633	82 923,00	0,18%
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			
13.1.	Bank Handlowy w Warszawie			
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	851 362	42 247 042,96	93,88%
15.1	Ulokowane na terenie RP	851 362	42 247 042,96	93,88%
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 2009

Informacja dodatkowa

I.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.	provizje, 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	8 391 838,03	7 727 642,96