

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2007

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	41 860 161,98	45 601 808,88
1.	Lokaty	41 860 161,98	45 599 565,40
2.	Środki pieniężne	-	2 243,48
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)	41 860 161,98	45 601 808,88

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2007

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU ZRÓWNOWAŻONY

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	34 706 865,22	41 860 161,98
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	1 528 312,83	1 007 648,88
I.	Zwiększenia funduszu	9 555 244,72	9 877 110,40
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	8 573 894,83	8 874 808,51
2	Tytułem udzielonych gwarancji		
3	Pozostałe zwiększenia	981 349,89	1 002 301,89
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	851 801,53	1 002 301,89
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	129 548,36	
II.	Zmniejszenia funduszu	8 026 931,89	8 869 461,52
1	Tytułem wykupu	4 714 852,38	5 722 510,24
2	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych		
3	Tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	1 882 854,21	1 847 978,44
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	959 890,70	1 147 941,60
8	Tytułem udzielonych gwarancji		
9	Pozostałe zmniejszenia	469 334,60	151 031,24
9a	Przeniesienia do pozostałych funduszy	82 400,83	127 808,67
9b	Inne (w tym wycofanie środków własnych)	386 933,77	23 222,57
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	5 624 983,93	2 733 998,02
1	z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	844 185,07	329 199,61
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	4 573 114,14	1 929 201,40
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	200 999,58	475 597,01
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	41 860 161,98	45 601 808,88

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2007

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	600,00	520,00
2	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych		
3	Koszty przechowywania aktywów funduszu		
4	Koszty transakcyjne		
5	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	140 429,79	161 923,22
6	Pozostałe koszty		
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	141 029,79	162 443,22

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	1 763 011,60739	1 886 935,56830
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1 886 935,56830	1 980 989,00062
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	20,71	23,43
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	20,71	23,30
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	23,75	25,87
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	23,43	24,35

Sprawozdanie okresowe Funduszu Zrównoważonego za rok 2007

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	10 637 820,10	23,33%
1.1	Obligacje	10 637 820,10	23,33%
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	13 911 827,94	30,51%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	13 911 827,94	30,51%
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 w funduszach 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	21 049 917,36	46,16%
13.1	Bank Handlowy w Warszawie	21 049 917,36	46,16%
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	45 599 565,40	100,00%
15.1	Ulokowane na terenie RP	45 599 565,40	100,00%
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.	Papier wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	10 624	10 637 820,10	23,33%
1.1	Obligacje	10 624	10 637 820,10	23,33%
1.1.1	DS1015	3 700	3 805 265,00	8,34%
1.1.2	DS0509	2 400	2 485 344,00	5,45%
1.1.3	PS0412	293	287 989,70	0,63%
1.1.4	DS1017	4 231	4 059 221,40	8,90%
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	487 469	13 911 827,94	30,51%
6.1.1.1	Amrest	914	122 476,00	0,27%
6.1.1.2	ASSECOPOL	3 598	264 453,00	0,58%
6.1.1.3	BankBPH	482	50 128,00	0,11%
6.1.1.4	Barinek	5 212	66 182,40	0,15%
6.1.1.5	BRE	941	475 205,00	1,04%
6.1.1.6	BZ-WBK	1 999	501 749,00	1,10%
6.1.1.7	CCC	1 712	77 040,00	0,17%
6.1.1.8	Cersanit	2 943	98 590,50	0,22%
6.1.1.9	CEZ	1 513	276 879,00	0,61%
6.1.1.10	Ciech	3 778	457 138,00	1,00%
6.1.1.11	Cinema City	1 904	66 640,00	0,15%
6.1.1.12	COMARCH	322	58 604,00	0,13%
6.1.1.13	DomDev	533	52 767,00	0,12%
6.1.1.14	Echo	1 252	99 784,40	0,22%
6.1.1.15	Elastoil	13 392	100 440,00	0,22%
6.1.1.16	ERBUD S.A.	1 929	174 767,40	0,38%
6.1.1.17	ES System S.A.	14 295	111 501,00	0,24%
6.1.1.18	Famur	42 574	186 474,12	0,41%
6.1.1.19	GANT	811	50 200,90	0,11%
6.1.1.20	Grajewo	1 669	88 457,00	0,19%
6.1.1.21	Getin	10 462	153 791,40	0,34%
6.1.1.22	GTC	9 039	402 235,50	0,88%
6.1.1.23	HBWLOCLAW	162	71 280,00	0,16%
6.1.1.24	Hydrotor	2 864	137 128,32	0,30%
6.1.1.25	Impexmetal	6 527	60 048,40	0,13%
6.1.1.26	INGBSK	282	204 450,00	0,45%
6.1.1.27	Key	805	128 800,00	0,28%
6.1.1.28	KCHM	6 746	713 728,80	1,57%
6.1.1.29	Lotos	3 388	150 786,00	0,33%
6.1.1.30	LPP	46	122 751,00	0,27%
6.1.1.31	Millennium	25 017	290 947,71	0,64%
6.1.1.32	Mispol	5 426	83 777,44	0,18%
6.1.1.33	MOL	616	221 760,00	0,49%
6.1.1.34	Nafta	2 215	139 545,00	0,31%
6.1.1.35	Orbis	1 273	88 473,50	0,19%
6.1.1.36	Parnopol	4 172	97 624,80	0,21%
6.1.1.37	PBG S.A.	366	112 398,60	0,25%
6.1.1.38	POLAQUA	2 253	175 734,00	0,39%
6.1.1.39	PeKaO	5 521	1 253 267,00	2,75%
6.1.1.40	PGNiG	52 622	268 372,20	0,59%
6.1.1.41	PKNORLEN	22 619	1 173 926,10	2,57%
6.1.1.42	PKO BP	30 665	1 612 879,00	3,54%
6.1.1.43	Polimexm	21 436	183 492,16	0,40%
6.1.1.44	Popczyk	2 595	158 295,00	0,35%
6.1.1.45	RUCH	8 829	203 044,00	0,45%
6.1.1.46	Sanok	603	111 555,00	0,24%
6.1.1.47	Stalprodukt	172	129 000,00	0,28%
6.1.1.48	SYNTHOS	79 916	103 890,80	0,23%
6.1.1.49	TIM	3 927	98 175,00	0,22%
6.1.1.50	TPSA	40 705	916 269,55	2,01%
6.1.1.51	TVN	8 741	218 525,00	0,48%
6.1.1.52	Urima	10 781	79 240,35	0,17%
6.1.1.53	Wawel	1 052	290 352,00	0,64%
6.1.1.54	WSiP	13 429	210 969,59	0,46%
6.1.1.55	ZPIUE	425	165 750,00	0,36%
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	1	21 049 917,36	46,16%
13.1.	Bank Handlowy w Warszawie	1	21 049 917,36	46,16%
14.	Inne lokaty za zgodnieniem organu nadzoru, zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej			
15.	Razem lokaty (suma 1-14), w tym	498 094	45 599 565,40	100%
15.1	Ulokowane na terenie RP	498 094	45 599 565,40	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 2007

Informacja dodatkowa

l.p.		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy	15 537 466,19	14 891 712,49
2.	opłaty za ryzyko, potrącane 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 potrącane ze składek przed ich przekazaniem na fundusze (koszty wstępne, różnice w cenach)	1 296 051,08	1 695 260,34
5.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń	14 241 415,11	13 196 452,15
6.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie	8 573 894,83	8 874 808,51