

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 potrąconych 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, potrącane 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 potrącane 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