

Półroczne sprawozdanie Funduszu Strategia Dochodowa sporządzone na dzień 30-06-2009

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

| (w zł.) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|----------------|---|------------------------|----------------------|
| I. | Aktywa | 24 536 354,55 | 28 593 054,69 |
| 1. | Lokaty | 23 868 955,41 | 26 970 924,48 |
| 2. | Środki pieniężne | 667 399,14 | 1 499 837,25 |
| 3. | Należności, w tym | - | 122 292,96 |
| 3.1 | Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego | - | 60 675,71 |
| 3.2 | Pozostałe należności | - | 61 617,25 |
| 4. | Pozostałe aktywa | - | - |
| II. | Zobowiązania | 25 647,20 | 88 249,69 |
| 1 | Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego | - | - |
| 2 | Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | - | - |
| 3 | Pozostałe zobowiązania | 25 647,20 | 88 249,69 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 24 510 707,35 | 28 504 805,00 |

Półroczne sprawozdanie Funduszu Strategia Dochodowa sporządzone na dzień 30-06-2009

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) | 18 363 977,79 | - 839 366,30 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 18 953 800,00 | 3 282 050,68 |
| 1 | Tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 18 953 800,00 | 3 282 050,68 |
| 2 | Tytułem udzielonych gwarancji | - | - |
| 3 | Pozostałe zwiększenia | - | - |
| 3a | Przeniesienia z pozostałych funduszy | - | - |
| 3b | Inne (w tym przydział środków własnych) | - | - |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 589 822,21 | 4 121 416,98 |
| 1 | Tytułem wykupu | 500 000,00 | 3 940 256,61 |
| 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 | 89 822,21 | 181 160,37 |
| 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) | - 135 577,37 | 591 634,72 |
| 1 | z papierów wartościowych emitowanych, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 203 746,25 | - |
| 2 | z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związku jednostek samorządu terytorialnego | - | 256 702,65 |
| 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 | - 353 965,21 | 540 084,66 |
| 7 | z udziałów | - | - |
| 8 | z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych | - | - 203 622,56 |
| 9 | z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych | - | - 12 388,67 |
| 10 | z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu | - | - |
| 11 | z pożyczek | - | - |
| 12 | z nieruchomości | - | - |
| 13 | z depozytów bankowych | 14 641,59 | 10 858,64 |
| 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 | 24 510 707,35 | 28 504 805,00 |

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 | 89 822,21 | 181 160,37 |
| 6 | Pozostałe koszty | - | - |
| 7 | RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6) | 89 822,21 | 181 160,37 |

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 | 2 468 015,94290 | 3 186 345,84224 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej | | |
| 2.1 | Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 10,02747 | - |
| 2.2 | Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 9,88687 | 6,77773 |
| 2.3 | Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 10,23357 | 10,23366 |
| 2.4 | Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego | 9,93134 | 8,94592 |

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 | | |
| 1.1 | Obligacje | 23 882 870,46 | 83,79% |
| 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 | 2 889 318,85 | 10,14% |
| 6.1 | Dopuszczone do publicznego obrotu | 2 889 318,85 | 10,14% |
| 6.1.1 | Notowane na rynku regulowanym | 2 889 318,85 | 10,14% |
| 6.1.2 | Pozostałe | | |
| 6.2 | Nie dopuszczone do publicznego obrotu | | |
| 7. | Udziały | | |
| 8. | Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 148 255,97 | 0,52% |
| 8.1 | Jednostki uczestnictwa | 148 255,97 | 0,52% |
| 8.2 | Certyfikaty inwestycyjne | | |
| 8.2.1 | Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonyjących 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 | 50 479,20 | 0,18% |
| 9.1 | Opcje | | |
| 9.2 | Kontrakty terminowe | 50 479,20 | 0,18% |
| 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 | 26 970 924,48 | 94,62% |
| 15.1 | Ulokowane na terenie RP | 26 677 057,25 | 94,62% |
| 15.2 | Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE | - | 0,00% |
| 15.3 | Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD | 293 867,23 | |
| 15.4 | Ulokowane poza RP, UE i OECD | | |

Półroczne sprawozdanie Funduszu Strategia Dochodowa sporządzone na dzień 30-06-2009

Informacja dodatkowa

| l.p. | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|------|--|-----------------|---------------|
| 1. | składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy* | 55 888 434,75 | 28 816 310,08 |
| 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) | | |
| 5. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń | 55 888 434,75 | 28 816 310,08 |
| 6. | wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie | 18 953 800,00 | 3 282 050,68 |