

Roczne sprawozdanie Funduszu Wielu Klas Aktywów sporządzone na dzień 31-12-2009

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	115 337 499,15	103 308 030,42
1.	Lokaty	113 537 550,60	89 592 418,63
2.	Środki pieniężne	1 799 948,55	9 167 918,50
3.	Należności, w tym	-	4 547 693,29
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	-	4 547 693,29
3.2	Pozostałe należności	-	-
4.	Pozostałe aktywa	-	-
II.	Zobowiązania	203 163,38	1 235 223,85
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	-	-
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	-
3	Pozostałe zobowiązania	203 163,38	1 235 223,85
III.	Aktywa netto (I-II)	115 134 335,77	102 072 806,57

Roczne sprawozdanie Funduszu Wielu Klas Aktywów sporządzone na dzień 31-12-2009

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	150 856 460,21	115 134 335,70
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	- 24 264 097,55	
I.	Zwiększenia funduszu	16 058 464,43	-
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	16 058 464,43	-
2	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
3	Pozostałe zwiększenia	-	-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	-	-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	-	-
II.	Zmniejszenia funduszu	40 322 561,98	22 506 652,32
1	Tytułem wykupu	37 261 106,24	19 878 703,09
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	2 874 455,74	2 627 949,23
8	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
9	Pozostałe zmniejszenia	187 000,00	-
9a	Przeniesienia do pozostałych funduszy	-	-
9b	Inne (w tym wycofanie środków własnych)	-	-
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	- 11 458 026,89	9 445 123,19
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 związki jednostek samorządu terytorialnego	7 354 571,06	2 495 907,66
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	- 18 972 789,61	11 669 979,25
7	z udziałów	-	-
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	-	- 2 297 756,72
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innym aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno- ubezpieczeniowych	-	- 2 582 776,14
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek	-	-
12	z nieruchomości	-	-
13	z depozytów bankowych	160 191,66	159 769,14
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	115 134 335,77	102 072 806,57

Roczne sprawozdanie Funduszu Wielu Klas Aktywów sporządzone na dzień 31-12-2009

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	2 874 455,74	2 627 949,23
6	Pozostałe koszty	-	-
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	2 874 455,74	2 627 949,23

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	15 378 287,11804	12 902 287,39427
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	12 902 287,39427	10 526 511,53986
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	9,80971	8,92356
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	8,22850	4,50243
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	28,33130	10,86070
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	8,92356	9,69674

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	36 769 221,16	35,59%
1.1	Obligacje	36 769 221,16	35,59%
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	252 905,55	0,24%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		
4.2	Pozostałe	252 905,55	0,24%
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	42 993 309,10	41,62%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	42 993 309,10	41,62%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	42 993 309,10	41,62%
6.1.2	Pozostałe		
6.2	Nie dopuszczone do publicznego obrotu		
7.	Udziały		
8.	Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	9 439 994,50	9,14%
8.1	Jednostki uczestnictwa	9 439 994,50	9,14%
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	136 988,32	0,13%
9.1	Opcje		
9.2	Kontrakty terminowe	136 988,32	0,13%
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	89 592 418,63	86,72%
15.1	Ulokowane na terenie RP	75 937 248,20	73,51%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	809 525,15	0,78%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD	12 845 645,28	12,43%
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	37 486	36 769 221,16	35,59%
1.1	Obligacje	37 486	36 769 221,16	35,59%
1.1.1	PL0000101598	421	451 219,38	0,44%
1.1.2	PL0000101937	73	74 655,64	0,07%
1.1.3	PL0000102224	1 445	1 461 473,00	1,41%
1.1.4	PL0000102646	3 843	3 741 544,80	3,62%
1.1.5	PL0000103222	817	814 148,67	0,79%
1.1.6	PL0000103305	6 158	6 215 577,30	6,02%
1.1.7	PL0000104717	12 750	12 469 627,41	12,07%
1.1.8	PL0000105037	39	40 324,44	0,04%
1.1.9	PL0000105078	926	912 110,00	0,88%
1.1.10	PL0000105433	2 464	2 572 613,12	2,49%
1.1.11	PL0000105441	4 133	3 970 159,80	3,84%
1.1.12	PL0000105524	1 851	1 723 281,00	1,67%
1.1.13	PL0000105730	2 566	2 322 486,60	2,25%
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	Dopuszczalne 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	1	252 905,55	0,24%
4.1	Notowane na rynku regulowanym			
4.2	Pozostałe			
4.2.1	PLPOLND00084	1	252 905,55	0,24%
5.	Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu			
5.1	Dopuszczalne do publicznego obrotu			
5.1.1	Notowane na rynku regulowanym			
5.1.2	Pozostałe			
5.2	Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
6.	Akcje	2 963 960	42 993 309,10	41,62%
6.1	Dopuszczalne do publicznego obrotu	2 963 960	42 993 309,10	41,62%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	2 963 960	42 993 309,10	41,62%
6.1.1.1	HU0000061726	9 782	809 525,15	0,78%
6.1.1.2	NL0000474351	5 923	485 686,00	0,47%
6.1.1.3	PLAGORA00067	34 737	779 498,28	0,75%
6.1.1.4	PLATREM00017	146 507	2 270 858,50	2,20%
6.1.1.5	PLBIG0000016	198 555	953 064,00	0,92%
6.1.1.6	PLBRLNK00017	81 810	292 061,70	0,28%
6.1.1.7	PLBZ00000044	3 581	680 390,00	0,66%
6.1.1.8	PLCELZA00018	14 672	1 118 740,00	1,08%
6.1.1.9	PLCNKLM00016	53 655	611 667,00	0,59%
6.1.1.10	PLERBUD00012	25 216	1 204 064,00	1,17%
6.1.1.11	PLESSYS00030	121 220	534 580,20	0,52%
6.1.1.12	PLGTC0000037	28 196	723 227,40	0,70%
6.1.1.13	PLIDMSA00044	272 602	651 518,78	0,63%
6.1.1.14	PLKETY000011	23 686	2 868 374,60	2,78%
6.1.1.15	PLKGHM000017	28 194	2 988 564,00	2,89%
6.1.1.16	PLKLNRO00017	69 430	996 320,50	0,96%
6.1.1.17	PLLOTOS00025	29 661	943 219,80	0,91%
6.1.1.18	PLMSTSD00019	209 001	829 733,97	0,80%
6.1.1.19	PLMSTWS00019	18 266	1 112 399,40	1,08%
6.1.1.20	PLNPNTS00012	13 400	335 000,00	0,32%
6.1.1.21	PLPEKAO00016	8 677	1 403 070,90	1,36%
6.1.1.22	PLPGER000010	131 013	3 209 818,50	3,11%
6.1.1.23	PLPGNIG00014	844 334	3 200 025,86	3,10%
6.1.1.24	PLPKN0000018	66 006	2 240 903,70	2,17%
6.1.1.25	PLPKO0000016	61 995	2 355 810,00	2,28%
6.1.1.26	PLPOLND00019	12 449	432 602,75	0,42%
6.1.1.27	PLPZBDT00013	134 763	672 467,37	0,65%
6.1.1.28	PLSOFTB00016	13 648	859 141,60	0,83%
6.1.1.29	PLTLKPL00017	141 524	2 245 985,88	2,17%
6.1.1.30	PLTRFRM00018	10 264	754 404,00	0,73%
6.1.1.31	PLTRKPL00014	80 788	336 078,08	0,33%

Roczne sprawozdanie Funduszu Wielu Klas Aktywów sporządzone na dzień 31-12-2009

6.1.1.32	SK1120009230	28 348	688 856,40	0,67%
6.1.1.33	US1534351028	42 057	3 405 650,78	3,30%
6.1.2	Pozostałe			
6.2	Nie dopuszczone do publicznego obrotu			
7.	Udziały			
8.	Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	66 756	9 439 994,50	9,14%
8.1	Jednostki uczestnictwa	66 756	9 439 994,50	9,14%
8.1.1	US06739F2911	981	178 617,71	0,17%
8.1.2	US4642864007	2 747	583 553,06	0,56%
8.1.3	US4642871846	4 118	496 028,25	0,48%
8.1.4	US46428Q1094	36 213	1 707 121,07	1,65%
8.1.5	US57060U5065	2 155	191 581,37	0,19%
8.1.6	US78463V1070	20 542	6 283 093,04	6,08%
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	101	136 988,32	0,13%
9.1	Opcje			
9.2	Kontrakty terminowe	101	136 988,32	0,13%
9.2.1	PL0GF0000398	101	136 988,32	0,13%
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	3 068 304	89 592 418,63	86,72%
15.1	Ulokowane na terenie RP	3 016 465	85 377 242,70	82,64%
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	51 839	4 215 175,93	4,08%
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD			

Roczne sprawozdanie Funduszu Wielu Klas Aktywów 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	16 058 464,43	-