

STRATEGIA WIELU KLAS AKTYWÓW BIS

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2011

Benefia Towarzystwo na Życie SA Vienna Insurance Group
Strategia Wielu Klas Aktywów Bis - Ubezpieczeniowy Fundusz Kapitałowy

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2010	XII/2011
	(w zł)	Koniec okresu poprzedniego	Koniec okresu bieżącego
I.	Aktywa	52 898 331,10	24 901 269,86
1.	Lokaty	51 162 961,78	18 456 421,85
2.	Środki pieniężne	1 715 051,71	4 884 060,21
3.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
4.	Należności	20 317,61	1 560 787,80
4.1.	<i>Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym</i>	20 317,61	1 560 787,80
4.2.	<i>Pozostałe należności</i>		0,00
II.	Zobowiązania	900 312,92	74 303,45
1.	Z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym		
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		
3.	Pozostałe zobowiązania	900 312,92	74 303,45
III.	Aktywa netto (I-II)	51 998 018,18	24 826 966,41

STRATEGIA WIELU KLAS AKTYWÓW BIS

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2011

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU		XII/2010	XII/2011
(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	102 072 806,50	51 998 018,13
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-55 820 313,41	-20 707 203,79
I.	Zwiększenia funduszu		
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu		
2.	Pozostałe przychody		
3.	Pozostałe zwiększenia		
II.	Zmniejszenia funduszu	55 820 313,41	20 707 203,79
1.	Tytułem wykupu	53 904 515,21	19 973 229,10
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 opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	1 805 682,90	631 802,80
6.	Pozostałe koszty		
7.	Pozostałe zmniejszenia	110 115,30	102 171,89
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	5 745 525,10	-6 463 847,94
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	51 998 018,19	24 826 966,40

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH		XII/2010	XII/2011
Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	10 526 511,53986	4 985 833,28301
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	4 985 833,28301	2 865 887,56422
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	9,69674	10,42915
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	6,67559	0,82118
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	13,58948	13,57894
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	10,42915	8,66292

STRATEGIA WIELU KLAS AKTYWÓW BIS

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2011

IV. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - półroczne

XII/2011

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	18 456 421,86	74,35%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	2 993 150,65	12,06%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	2 335 724,99	9,41%
4.	Akcje	10 773 030,01	43,39%
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	2 250 935,21	9,07%
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	103 581,00	0,42%
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
III.	Środki pieniężne	4 884 060,21	19,67%
IV.	Należności	1 560 787,80	6,29%
V.	Zobowiązania	74 303,45	0,30%
VI.	Aktywa netto (w tym)	24 826 966,41	100,00%
1	<i>krajowe</i>	17 698 837,74	71,29%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	757 584,12	3,05%

STRATEGIA WIELU KLAS AKTYWÓW BIS

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31-12-2011

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU - roczne

XII/2011

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	18 456 421,86	74,35%
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	2 993 150,65	12,06%
1.1	<i>Obligacje</i>	2 993 150,65	12,06%
1.2	<i>Bony skarbowe</i>		
1.3	<i>Inne</i>		
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		
3.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	2 335 724,99	9,41%
3.1	<i>Notowane na rynku regulowanym</i>	2 085 724,99	8,40%
3.2	<i>Pozostałe</i>	250 000,00	1,01%
4.	Akcje	10 773 030,01	43,39%
4.1	<i>Akcje notowane na rynku regulowanym</i>	10 773 030,01	43,39%
4.2	<i>Pozostałe akcje</i>		
5.	Udziały		
6.	Jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	2 250 935,21	9,07%
6.1	<i>Jednostki uczestnictwa</i>	2 250 935,21	9,07%
6.2	<i>Certyfikaty inwestycyjne</i>		
6.2.1	<i>Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości</i>		
6.2.2	<i>Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych</i>		
7.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	103 581,00	0,42%
7.1	<i>Opcje</i>		
7.2	<i>Kontrakty terminowe</i>	103 581,00	0,42%
7.3	<i>Swapy walutowe</i>		
7.4	<i>Swapy procentowe</i>		
7.5	<i>Inne instrumenty pochodne</i>		
8.	Inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu		
9.	Pożyczki		
9.1	<i>Zabezpieczone hipotecznie</i>		
9.2	<i>Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej</i>		
9.3	<i>Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie</i>		
9.4	<i>Inne pożyczki</i>		
10.	Nieruchomości		
11.	Depozyty bankowe		
12.	Pozostałe lokaty		
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		
III.	Środki pieniężne	4 884 060,21	19,67%
IV.	Należności	1 560 787,80	6,29%
V.	Zobowiązania	74 303,45	0,30%
VI.	Aktywa netto (w tym)	24 826 966,41	100,00%
1	<i>krajowe</i>	24 069 382,29	71,29%
2	<i>zagraniczne - kraje UE</i>		
3	<i>zagraniczne - kraje poza UE</i>	757 584,12	3,05%