

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	8 377 533,40	11 313 901,29
1.	Lokaty	7 435 723,54	11 255 939,89
2.	Środki pieniężne	941 809,86	57 961,40
3.	Należności, w tym	-	-
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	-	-
3.2	Pozostałe należności	-	-
4.	Pozostałe aktywa	-	-
II.	Zobowiązania	49 827,10	21 242,34
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	36 721,45	-
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	-	-
3	Pozostałe zobowiązania	13 105,65	21 242,34
III.	Aktywa netto (I-II)	8 327 706,30	11 292 658,95

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	-	8 327 706,30
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		3 766 561,09
I.	Zwiększenia funduszu	9 111 063,70	7 016 551,08
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	9 111 063,70	7 016 551,08
2	Tytułem udzielonych gwarancji	-	-
3	Pozostałe zwiększenia	-	-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy	-	-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)	-	-
II.	Zmniejszenia funduszu	692 598,17	3 249 989,99
1	Tytułem wykupu	652 518,03	3 050 939,20
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	40 080,14	199 050,79
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)	- 90 759,23	- 801 608,44
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	70 037,08	291 861,84
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	- 84 031,16	- 1 108 839,49
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	- 82 262,00	-
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	-	-
11	z pożyczek	-	-
12	z nieruchomości	-	-
13	z depozytów bankowych	5 496,85	15 369,21
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	8 327 706,30	11 292 658,95

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

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	40 080,14	199 050,79
6	Pozostałe koszty	-	-
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)	40 080,14	199 050,79

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	846 106,37000	857 915,80840
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	857 915,80840	1 204 762,32617
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	10,00000	9,70690
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9,51272	8,54299
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10,10568	10,10157
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	9,70690	9,37335

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	7 364 168,02	65,42%
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	3 891 771,87	34,58%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	3 891 771,87	34,58%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	3 891 771,87	34,58%
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		
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	11 255 939,89	100,00%
15.1	Ulokowane na terenie RP	10 829 755,04	96,21%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	426 184,85	3,79%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD		
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD		

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

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	7 359	7 364 168,02	65,42%
1.1	Obligacje	7 359	7 364 168,02	65,42%
1.1.1	PL0000101234	23	24 428,99	0,22%
1.1.2	PL0000101259	579	598 240,17	5,31%
1.1.3	PL0000101598	64	68 572,16	0,61%
1.1.4	PL0000102224	165	166 706,10	1,48%
1.1.5	PL0000102646	399	415 199,40	3,69%
1.1.6	PL0000103222	194	193 720,64	1,72%
1.1.7	PL0000103305	2 221	2 216 069,38	19,69%
1.1.8	PL0000103735	670	700 096,40	6,22%
1.1.9	PL0000104543	707	706 745,48	6,28%
1.1.10	PL0000104709	377	365 878,50	3,25%
1.1.11	PL0000104717	1 960	1 908 510,80	16,96%
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	255 388	3 891 771,87	34,58%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	255 388	3 891 771,87	34,58%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	255 388	3 891 771,87	34,58%
6.1.1.1	CZ0005112300	2 196	272 304,00	2,42%
6.1.1.2	NL0000474351	901	43 248,00	0,38%
6.1.1.3	PLAGORA00067	242	3 920,40	0,03%
6.1.1.4	PLATREM00025	13 521	97 215,98	0,86%
6.1.1.5	PLBH0000012	3 006	144 288,00	1,28%
6.1.1.6	PLBIG0000016	9 143	26 331,84	0,23%
6.1.1.7	PLBSK0000017	257	110 510,00	0,98%
6.1.1.8	PLBZ00000044	2 696	298 716,80	2,65%
6.1.1.9	PLESSYS00030	12 283	60 923,68	0,54%
6.1.1.10	PLGTC0000037	1 576	23 923,68	0,21%
6.1.1.11	PLHTLST00010	14 028	104 508,60	0,93%
6.1.1.12	PLKETY000011	2 334	140 040,00	1,24%
6.1.1.13	PLKMPTR00012	607	6 434,20	0,06%
6.1.1.14	PLKRDTB00011	2 631	29 809,23	0,26%
6.1.1.15	PLMEDCS00015	1 465	40 038,45	0,36%
6.1.1.16	PLMSTSD00019	36 632	111 727,60	0,99%
6.1.1.17	PLMSTWS00019	2 760	135 792,00	1,21%
6.1.1.18	PLNFTBD00010	4 957	121 446,50	1,08%
6.1.1.19	PLNOBLE00017	6 424	20 492,56	0,18%
6.1.1.20	PLNPNTS00012	3 216	47 275,20	0,42%
6.1.1.21	PLOPLTC00026	3 345	49 673,25	0,44%
6.1.1.22	PLOPNPL00013	8 826	65 665,44	0,58%
6.1.1.23	PLPEKAO00016	2 040	257 448,00	2,29%
6.1.1.24	PLPGNIG00014	17 814	64 130,40	0,57%
6.1.1.25	PLPKN0000018	10 903	280 534,19	2,49%
6.1.1.26	PLPKO0000016	19 358	687 209,00	6,11%
6.1.1.27	PLPMWVRM00012	13 943	13 385,28	0,12%
6.1.1.28	PLPOLND00019	1 061	31 076,69	0,28%
6.1.1.29	PLPZBDT00013	18 700	37 961,00	0,34%

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

6.1.1.30	PLSELNA00010	1 606	12 012,88	0,11%
6.1.1.31	PLSKLNW00011	4 371	22 510,65	0,20%
6.1.1.32	PLSOFTB00016	2 122	100 582,80	0,89%
6.1.1.33	PLTLKPL00017	6 579	126 316,80	1,12%
6.1.1.34	PLTRKPL00014	7 682	31 035,28	0,28%
6.1.1.35	PLTVN0000017	12 084	162 650,64	1,45%
6.1.1.36	SK1120009230	2 818	37 056,70	0,33%
6.1.1.37	US1534351028	1 261	73 576,15	0,65%
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			
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	262 747	11 255 939,89	100,00%
15.1	Ulokowane na terenie RP	255 571	10 829 755,04	96,21%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	7 176	426 184,85	3,79%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD			
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD			

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Konserwatywna sporządzone na dzień 31-12-2008

Informacja dodatkowa

l.p.		okres poprzedni	okres bieżący
1.	składka przypisana brutto w dziale I grupa 3 załącznika do ustawy	185 058 398,39	93 114 999,95
2.	opłaty za ryzyko, potrącane ze składki przypisanej brutto, przed ich przekazaniem na wszystkie fundusze prowadzone przez zakład ubezpieczeń		
3.	prowinie, 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
5.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów wskazanych w punktach 3-5, zwiększająca wartość wszystkich funduszy prowadzonych przez zakład ubezpieczeń	185 058 398,39	91 647 856,65
6.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie	9 111 063,70	7 016 551,08