

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

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa		12 970 170,33
1.	Lokaty		12 968 662,10
2.	Środki pieniężne		1 508,23
3.	Należności, w tym		-
3.1	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego		-
3.2	Pozostałe należności		-
4.	Pozostałe aktywa		-
II.	Zobowiązania		7 118,32
1	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego		-
2	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia		-
3	Pozostałe zobowiązania		7 118,32
III.	Aktywa netto (I-II)		12 963 052,01

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

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł.)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu		-
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)		
I.	Zwiększenia funduszu		12 796 329,37
1	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu		12 796 329,37
2	Tytułem udzielonych gwarancji		-
3	Pozostałe zwiększenia		-
3a	Przeniesienia z pozostałych funduszy		-
3b	Inne (w tym przydział środków własnych)		-
II.	Zmniejszenia funduszu		21 980,65
1	Tytułem wykupu		-
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		21 980,65
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)		188 703,29
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		182 418,84
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		75,95
7	z udziałów		-
8	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych		-
9	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		-
10	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu		-
11	z pożyczek		-
12	z nieruchomości		-
13	z depozytów bankowych		6 208,50
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		12 963 052,01

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Skarbowa 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		21 980,65
6	Pozostałe koszty		
7	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6)		21 980,65

IV LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego		-
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego		1 338 428,48845
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego		-
2.2	Minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		8,68124
2.3	Maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym		10,16739
2.4	Wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego		9,68528

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	12 968 662,10	100,00%
1.1	Obligacje	12 968 662,10	100,00%
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	-	0,00%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu	-	0,00%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym	-	0,00%
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	12 968 662,10	100,00%
15.1	Ulokowane na terenie RP	12 968 662,10	100,00%
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		
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	12 711,00	12 968 662,10	100,00%
1.1	Obligacje	12 711,00	12 968 662,10	100,00%
1.1.1	PL0000101234	12,00	12 745,56	0,10%
1.1.2	PL0000101259	3 310,00	3 419 991,30	26,37%
1.1.3	PL0000101598	377,00	403 932,88	3,11%
1.1.4	PL0000102224	259,00	261 678,06	2,02%
1.1.5	PL0000103222	277,00	276 601,12	2,13%
1.1.6	PL0000103305	2 890,00	2 883 584,20	22,24%
1.1.7	PL0000103735	3 843,00	4 015 627,56	30,96%
1.1.8	PL0000104709	839,00	814 249,50	6,28%
1.1.9	PL0000104717	904,00	880 251,92	6,79%
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			
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu			
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym			
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	12 711,00	12 968 662,10	100,00%
15.1	Ulokowane na terenie RP	12 711,00	12 968 662,10	100,00%
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			
15.4	Ulokowane poza RP, UE i OECD			

Roczne sprawozdanie Funduszu Strategia Skarbowa 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		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		91 647 856,65
6.	wielkość składek netto po potrąceniu kosztów zwiększająca aktywa funduszu, dla którego jest sporządzane sprawozdanie		12 796 329,37