

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2009 roku**

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA

Mocna Przyszłość - Fundusz Dłużnych Papierów Wartościowych

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	11 544 192	11 985 666
1.	Lokaty	11 544 192	11 985 666
2.	Środki pieniężne	0	0
3.	Należności, w tym	0	0
3.1.	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	0	0
3.2.	Pozostałe należności	0	0
4.	Pozostałe aktywa	0	0
II.	Zobowiązania	0	0
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	0	0
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0	0
3.	Pozostałe zobowiązania	0	0
III.	Aktywa netto (I-II)	11 544 192	11 985 666

Warszawa, 28 kwietnia 2010 roku

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2009 roku**

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
Mocna Przyszłość - Fundusz Dłużnych Papierów Wartościowych

II. ZMIANA AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	10 862 113	11 544 192
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-161 745	-20 528
I.	Zwiększenia funduszu	2 851 991	2 504 484
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 750 541	2 411 121
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0	0
3.	Pozostałe zwiększenia	101 451	93 363
II.	Zmniejszenia funduszu	3 013 736	2 525 012
1.	Tytułem wykupu	1 802 812	1 327 149
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	15 610	12 880
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	973 282	956 505
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0	0
5.	Tytułem prowizji od składek	0	0
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0	0
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	167 242	175 482
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0	0
9.	Pozostałe zmniejszenia	54 790	52 996
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	843 824	462 002
1.	z papierów wartościowych emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	793 076	417 299
2.	z obligacji emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0	
3.	z listów zastawnych	0	
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej kwocie dochodu	7 108	3 947
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej kwocie dochodu	0	
6.	z akcji	0	
7.	z udziałów	0	
8.	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	0	
9.	z instrumentów pochodnych, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0	
10.	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0	
11.	z pożyczek	0	
12.	z nieruchomości	0	
13.	z depozytów bankowych	43 640	40 755
14.	z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0	0
D.	Pozostałe zwiększenia	0	0
E.	Pozostałe zmniejszenia	0	0
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu	11 544 192	11 985 666

Warszawa, 28 kwietnia 2010 roku

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2009 roku**

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA

Mocna Przyszłość - Fundusz Dłużnych Papierów Wartościowych

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	0	0
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0	0
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	11 376	12 885
4.	Koszty transakcyjne	0	0
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	167 242	175 482
6.	Pozostałe koszty	0	0
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6):	178 618	188 368

Warszawa, 28 kwietnia 2010 roku

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2009 roku**

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
Mocna Przyszłość - Fundusz Dłużnych Papierów Wartościowych

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	Liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	634 396,414113	634 148,185475
1.2	Liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	634 148,185475	641 769,109285
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1	Wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	17,119151	18,197517
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	17,121082	17,983583
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	18,197517	18,675849
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	18,197517	18,672139

Warszawa, 28 kwietnia 2010 roku

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31 grudnia 2009 roku

Powszechny Zakład Ubezpieczeń na Życie SA
Mocna Przyszłość - Fundusz Dłużnych Papierów Wartościowych

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

LOKATY	Ilość w sztukach	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje			
1. międzynarodowe	9933	9 775 956	81,56%
1.1 Obligacje	9933	9 775 956	81,56%
1.1.1 DS1013	279	277 192	2,31%
1.1.2 DS1015	500	513 020	4,28%
1.1.3 DS1017	500	478 820	3,99%
1.1.4 DS1110	460	470 433	3,92%
1.1.5 OK0112	343	310 346	2,59%
1.1.6 OK0712	2385	2 097 608	17,50%
1.1.7 PS0310	1898	1 989 901	16,60%
1.1.8 PS0413	673	696 393	5,81%
1.1.9 PS0414	1500	1 562 370	13,04%
1.1.10 PS0511	495	506 152	4,22%
1.1.11 WS0922	900	873 720	7,29%
1.2 Bony skarbowe	0	0	0,00%
1.3 Inne	0	0	0,00%
Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0	0	0,00%
2. Listy zastawne	0	0	0,00%
3.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
3.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0	0	0,00%
3.1.2 Pozostałe	0	0	0,00%
3.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
4. Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	1	98 731	0,82%
4.1 Notowane na rynku regulowanym	0	0	0,00%
4.2 Pozostałe	1	98 731	0,82%
4.2.1 PKO301017	1	98 731	0,82%
Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0	0	0,00%
5.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
5.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0	0	0,00%
5.1.2 Pozostałe	0	0	0,00%
5.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
6. Akcje	0	0	0,00%
6.1 Dopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
6.1.1 Notowane na rynku regulowanym	0	0	0,00%
6.1.2 Pozostałe	0	0	0,00%
6.2 Niedopuszczone do publicznego obrotu	0	0	0,00%
7. Udziały	0	0	0,00%
Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	0	0	0,00%
8.1 Jednostki uczestnictwa	0	0	0,00%
8.2 Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0,00%
8.2.1 Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0	0	0,00%
8.2.2 Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych	0	0	0,00%
Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno - ubezpieczeniowych	0	0	0,00%
9.1 Opcje	0	0	0,00%
9.2 Kontrakty terminowe	0	0	0,00%
9.3 Swapy walutowe	0	0	0,00%
9.4 Swapy procentowe	0	0	0,00%
9.5 Prawa poboru	0	0	0,00%
9.6 Inne instrumenty pochodne	0	0	0,00%
10. Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu	0	0	0,00%
11. Pożyczki	0	0	0,00%
11.1 Zabezpieczone hipotecznie	0	0	0,00%
11.2 Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej	0	0	0,00%
11.3 Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0	0	0,00%
11.4 Inne pożyczki	0	0	0,00%
12. Nieruchomości	0	0	0,00%
13. Depozyty bankowe		2 110 980	17,61%
13.1 Bank Millenium		2 110 980	17,61%
Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru zgodnie z art.154 ust.9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0	0	0,00%
15. RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:	9 934	11 985 666	100,00%
15.1 Ulokowane na terenie RP	9 934	11 985 666	100,00%
15.2 Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE	0	0	0,00%
15.3 Ulokowane poza terenem RP UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD	0	0	0,00%
15.4 Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD	0	0	0,00%