



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2009

Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Fundusz Zrównoważony PPE

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni 31/12/2008	Okres bieżący 31/12/2009
I.	Aktywa	42 483 561	68 014 632
1.	Lokaty	42 483 561	68 014 632
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)	42 483 561	68 014 632

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2009**

**Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Fundusz Zrównoważony PPE**

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni 31/12/2008	Okres bieżący 31/12/2009
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu	42 954 607	42 483 561
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	12 338 055	12 795 157
I.	Zwiększenia funduszu	22 461 861	15 735 676
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	14 642 790	15 348 691
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0	0
3.	Pozostałe zwiększenia	7 819 071	386 985
II.	Zmniejszenia funduszu	10 123 806	2 940 519
1.	Tytułem wykupu	1 561 990	1 720 252
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	163 294	50 436
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	26 977	0
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	836 792	925 511
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0	0
9.	Pozostałe zmniejszenia	7 534 753	244 320
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	-12 524 720	12 609 472
1.	z papierów wartościowych emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	1 186 545	2 020
2.	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0	0
3.	z listów zastawnych	0	0
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	0	0
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0	0
6.	z akcji	-14 708 886	52
7.	z udziałów	0	0
8.	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	988 287	12 607 145
9.	z instrumentów pochodnych o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0	0
10.	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0	0
11.	z pożyczek	8 779	89
12.	z nieruchomości	0	0
13.	z depozytów bankowych	555	166
14.	z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0	0
D.	Pozostałe zwiększenia	0	126 442
E.	Pozostałe zmniejszenia	284 381	0
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	42 483 561	68 014 632

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2009**

**Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Fundusz Zrównoważony PPE**

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni 31/12/2008	Okres bieżący 31/12/2009
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	0	0
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0	0
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	0	0
4.	Koszty transakcyjne	33 403	0
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	836 792	925 511
6.	Pozostałe koszty	0	0
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1-6):	870 195	925 511

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

Pozycja		Okres poprzedni 31/12/2008	Okres bieżący 31/12/2009
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	29 150 000	39 500 000
1.2	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	39 500 000	51 400 000
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej:		
2.1	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	1.4756	1.0768
2.2	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	0.9879	0.9367
2.3	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	1.4756	1.3377
2.4	wartość jednostki rozliczeniowej na koniec okresu sprawozdawczego	1.0768	1.3247

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2009**

Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Fundusz Zrównoważony PPE

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
1.	Papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska:		319 251	0.47%
1.1.	Obligacje		240 311	0.35%
1.1.1	DZ0110	31	33 225	0.05%
1.1.2	PP1013	3	2 904	0.00%
1.1.3	WZ0118	135	131 991	0.19%
1.1.4	WZ0911	72	72 191	0.11%
1.2.	Bony skarbowe		78 940	0.12%
1.2.1	BS20100224	2	19 892	0.04%
1.2.2	BS20100414	1	9 898	0.01%
1.2.3	BS20100512	2	19 739	0.04%
1.2.4	BS20100526	1	9 855	0.01%
1.2.5	BS20100616	1	9 834	0.01%
1.2.6	BS20100929	1	9 722	0.01%
1.3.	Inne		0	0.00%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0	0.00%
3.	Listy zastawne		0	0.00%
3.1.	Dopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0	0.00%
3.1.2	Pozostałe		0	0.00%
3.2.	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
4.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		0	0.00%
4.1.	Notowane na rynku regulowanym		0	0.00%
4.2.	Pozostałe		0	0.00%
5.	Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0	0.00%
5.1.	Dopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
5.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0	0.00%
5.1.2	Pozostałe		0	0.00%
5.2.	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
6.	Akcje		0	0.00%
6.1.	Dopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0	0.00%
6.1.2	Pozostałe		0	0.00%
6.2.	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0	0.00%
7.	Udziały		0	0.00%
8.	Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		67 651 820	99.46%
8.1.	Jednostki uczestnictwa		67 651 820	99.46%
8.1.1	AI SFIO AKCYJNY	22 462	32 977 838	48.48%
8.1.2	AI SFIO DLUZNY	27 738	30 340 489	44.61%
8.1.3	AI SFIO PIENIEZNY	3 964	4 333 493	6.37%
8.2.	Certyfikaty inwestycyjne		0	0.00%
8.2.1	Certyfikaty inwestycyjne funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0	0.00%
8.2.2	Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych		0	0.00%

**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31/12/2009**

Aviva Towarzystwo Ubezpieczeń na Życie S.A.
Fundusz Zrównoważony PPE

9.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		0	0.00%
9.1.	Opcje		0	0.00%
9.2.	Kontrakty terminowe		0	0.00%
9.3.	Swapy walutowe		0	0.00%
9.4.	Swapy procentowe		0	0.00%
9.5.	Prawa poboru		0	0.00%
9.6.	Inne instrumenty pochodne		0	0.00%
10.	Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0	0.00%
11.	Pożyczki		11 237	0.02%
11.1.	Zabezpieczone hipotecznie		0	0.00%
11.2.	Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		11 237	0.02%
11.2.1	Transakcja kupna z przyrzeczeniem odsprzedaży (tzw. buy-sell-back) na obligacjach DS1110	11	11 237	0.02%
11.3.	Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0	0.00%
11.4.	Inne pożyczki		0	0.00%
12.	Nieruchomości		0	0.00%
13.	Depozyty bankowe		32 324	0.05%
13.1.	Depozyt w Banku Pekao S.A. na kwotę 100 151 370 zł	0.000200131	20 044	0.03%
13.2.	Depozyt w Banku Handlowym na kwotę 26 704 000 zł	0.000453837	12 119	0.02%
13.3.	Depozyt w Banku Handlowym na kwotę 805 000 zł	0.000200131	161	0.00%
14.	Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		0	0.00%
15.	RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:		68 014 632	100.00%
15.1.	Ulokowane na terenie RP		68 014 632	100.00%
15.2.	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE		0	0.00%
15.3.	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale na terenie krajów członkowskich OECD		0	0.00%
15.4.	Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD		0	0.00%

INFORMACJA DODATKOWA

(w zł)	Okres poprzedni 31/12/2008	Okres bieżący 31/12/2009	
1	Wysokość składki przypisanej brutto w dziale I grupa 3	1 434 816 418	1 359 235 250
2	Kwota składek z działu I grupa 5 załącznika do ustawy oraz korekta o składki niewpłacone	97 095 652	98 379 173
3	Opłaty za ryzyko potrącane ze składek przed ich przekazaniem na fundusze	59 811 799	64 302 555
4	Prowizje potrącane ze składek przed ich przekazaniem na fundusze	122 463 554	90 536 040
5	Inne koszty potrącane ze składek przed ich przekazaniem na fundusze	9 903 856	8 053 632
6	Wielkość składek po potrąceniu kosztów zwiększających wartość wszystkich funduszy	1 339 732 861	1 294 722 196
7	Wielkość składek po potrąceniu kosztów zwiększających wartość funduszu dla którego robione jest sprawozdanie	14 642 791	15 348 690