

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	26,489,477.26	32,382,959.42
1.	Lokaty	25,522,489.68	32,382,959.42
2.	Środki pieniężne	966,987.58	0.00
3.	Należności, w tym	0.00	0.00
3.1.	Z tytułu zbycia składników portfela inwestycyjnego	0.00	0.00
3.2.	Pozostałe należności	0.00	0.00
4.	Pozostałe aktywa	0.00	0.00
II.	Zobowiązania	222,863.62	385,561.39
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	89,396.54	225,777.23
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0.00	0.00
3.	Pozostałe zobowiązania	133,467.08	159,784.16
III.	Aktywa netto (I - II)	26,266,613.64	31,997,398.03

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	0.00	26,266,419.39
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I -II)	2,586,154.45	2,310,984.55
I.	Zwiększenia funduszu	8,380,759.07	5,352,649.12
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	4,961,287.62	4,802,099.65
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
3.	Pozostałe zwiększenia	3,419,471.45	550,549.47
II.	Zmniejszenia funduszu	5,794,604.62	3,041,664.57
1.	Tytułem wykupu	601,726.34	768,364.93
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	995,625.56	0.00
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	13,452.06	17,224.24
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0.00	0.00
5.	Tytułem prowizji od składek	245,708.16	240,113.66
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0.00	0.00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	592,433.41	680,338.11
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
9.	Pozostałe zmniejszenia	3,345,659.09	1,335,623.63
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	3,321,750.44	4,132,505.89
1.	z papierów emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	1,312,814.94	1,425,415.26
2.	z obligacji emitowanych lub poręczonych przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego	0.00	0.00
3.	z listów zastawnych	0.00	0.00
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	140,829.56	27,693.65
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
6.	z akcji	1,845,042.24	2,640,329.36
7.	z udziałów	0.00	0.00
8.	z jednostek uczestnictwa lub certyfikatów inwestycyjnych w funduszach inwestycyjnych	0.00	0.00
9.	z innych pochodnych, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0.00	0.00
10.	z innych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
11.	z pożyczek	0.00	0.00
12.	z nieruchomości	0.00	0.00
13.	z depozytów bankowych	23,063.70	39,067.62
14.	z lokat dokonanych za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej	0.00	0.00
D.	Pozostałe zwiększenia	20,358,708.75	0.00
E.	Pozostałe zmniejszenia	0.00	712,511.80
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	26,266,613.64	31,997,398.03

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	0.00	0.00
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0.00	0.00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	1,664.29	7,221.56
4.	Koszty transakcyjne	511.89	0.00
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	589,643.03	673,116.55
6.	Pozostałe koszty	614.20	0.00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1 - 6):	592,433.41	680,338.11

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH TYPU A

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	0.000	508,776.926
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	508,776.926	184,225.802
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	0.0000	10.4172
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9.3784	10.9466
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10.4172	11.7479
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	10.4172	11.7165

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH TYPU B

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	0.000	1,804,519.920
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1,804,519.920	2,272,489.885
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	0.0000	11.6188
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	9.8335	12.2405
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	11.6188	13.1649
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	11.6188	13.1305

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

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:		21,603,310.50	66.71%
1.1	Obligacje		21,603,310.50	66.71%
1.1.1	DS0509	2,750	2,951,382.50	9.11%
1.1.2	DS1109	1,000	1,049,080.00	3.24%
1.1.3	DS1110	3,450	3,626,226.00	11.20%
1.1.4	PS0310	1,050	1,129,191.00	3.49%
1.1.5	PS0608	2,950	3,114,993.50	9.62%
1.1.6	OK0406	545	538,460.00	1.66%
1.1.7	OK0407	2,200	2,081,200.00	6.43%
1.1.8	OK0807	2,000	1,862,800.00	5.75%
1.1.9	OK1206	950	912,000.00	2.82%
1.1.10	OK1207	2,250	2,061,000.00	6.36%
1.1.11	WZ0911	2,250	2,276,977.50	7.03%
1.2	Bony skarbowe		0.00	0.00%
1.3	Inne		0.00	0.00%
2.	Obligacje emitowane lub poręczone przez jednostki samorządu terytorialnego lub związki jednostek samorządu terytorialnego		0.00	0.00%
3.	Listy zastawne		0.00	0.00%
3.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
3.1.2	Pozostałe		0.00	0.00%
3.2	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
4.	Inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu		0.00	0.00%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
4.2	Pozostałe		0.00	0.00%
5.	Inne dłużne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0.00	0.00%
5.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
5.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
5.1.2	Pozostałe		0.00	0.00%
5.2	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
6.	Akcje		9,829,735.89	30.35%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		9,829,735.89	30.35%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym		9,829,735.89	30.35%
6.1.1.1	AGORA	1,017	70,173.00	0.22%
6.1.1.2	BANKBPH	597	448,048.50	1.38%
6.1.1.3	BRE	852	143,988.00	0.44%
6.1.1.4	BUDIMEX	2,933	112,920.50	0.35%
6.1.1.5	CERSANIT	11,064	154,896.00	0.48%
6.1.1.6	ECHO	969	151,164.00	0.47%
6.1.1.7	ELDORADO	3,880	119,504.00	0.37%
6.1.1.8	ELBUDOWA	3,338	122,838.40	0.38%
6.1.1.9	GTC	1,520	262,960.00	0.81%
6.1.1.10	JCAUTO	3,525	132,540.00	0.41%
6.1.1.11	KETY	1,384	173,692.00	0.54%
6.1.1.12	KGHM	13,565	847,812.50	2.62%
6.1.1.13	KOELNER	6,024	186,744.00	0.58%
6.1.1.14	KROSNO	16,568	132,544.00	0.41%
6.1.1.15	KRUSZWICA	4,373	114,135.30	0.35%
6.1.1.16	LENTEX	4,116	55,566.00	0.17%
6.1.1.17	LOTOS	6,762	298,880.40	0.92%
6.1.1.18	LPP	396	300,960.00	0.93%

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Korporacyjny Mieszany

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
6.1.1.19	MOL	661	195,656.00	0.60%
6.1.1.20	NETIA	8,525	48,592.50	0.15%
6.1.1.21	ORBIS	3,379	111,507.00	0.34%
6.1.1.22	PEKAO	5,933	1,035,308.50	3.20%
6.1.1.23	PKOBP	25,857	749,853.00	2.32%
6.1.1.24	PGF	3,201	194,300.70	0.60%
6.1.1.25	PGNIG	121,042	420,015.74	1.30%
6.1.1.26	PKNORLEN	14,525	910,717.50	2.81%
6.1.1.27	POLIMEXMS	5,954	370,934.20	1.15%
6.1.1.28	PROKOM	1,584	218,592.00	0.68%
6.1.1.29	RAFAKO	12,835	254,774.75	0.79%
6.1.1.30	SOFTBANK	2,270	88,530.00	0.27%
6.1.1.31	TPSA	39,001	912,623.40	2.82%
6.1.1.32	TVN	3,226	251,628.00	0.78%
6.1.1.33	ZREW	1,798	237,336.00	0.73%
6.1.2	Pozostałe		0.00	0.00%
6.2	Niedopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
7.	Udziały		0.00	0.00%
8.	Jednostki uczestnictwa lub certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych		0.00	0.00%
8.1	Jednostki uczestnictwa		0.00	0.00%
8.2	Certyfikaty inwestycyjne		0.00	0.00%
8.2.1	Certyfikaty inwestycyjne funduszu inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości		0.00	0.00%
8.2.2	Certyfikaty inwestycyjne innych funduszy inwestycyjnych		0.00	0.00%
9.	Instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych		0.00	0.00%
9.1	Opcje		0.00	0.00%
9.2	Kontrakty terminowe		0.00	0.00%
9.3	Swapy walutowe		0.00	0.00%
9.4	Swapy procentowe		0.00	0.00%
9.5	Prawa poboru		0.00	0.00%
9.6	Inne instrumenty pochodne		0.00	0.00%
10.	Inne papiery wartościowe o zmiennej stopie dochodu		0.00	0.00%
11.	Pożyczki		0.00	0.00%
11.1	Zabezpieczone hipotecznie		0.00	0.00%
11.2	Zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej		0.00	0.00%
11.3	Pożyczki pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie		0.00	0.00%
11.4	Inne pożyczki		0.00	0.00%
12.	Nieruchomości		0.00	0.00%
13.	Depozyty bankowe		949,913.03	2.93%
13.1	Depozyt O/N		949,913.03	2.93%
14.	Inne lokaty za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy o działalności ubezpieczeniowej		0.00	0.00%
15.	RAZEM LOKATY (SUMA 1-14), W TYM:		32,382,959.42	100.00%
15.1	Ulokowane na terenie RP		32,382,959.42	100.00%
15.2	Ulokowane poza terenem RP, ale na terenie krajów członkowskich UE		0.00	0.00%
15.3	Ulokowane poza terenem RP i UE, ale terenie krajów członkowskich OECD		0.00	0.00%
15.4	Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD		0.00	0.00%