

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	0.00	2,544,021.17
1.	Lokaty	0.00	2,544,021.17
2.	Środki pieniężne	0.00	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	0.00	13,562.29
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	0.00	3,348.01
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0.00	0.00
3.	Pozostałe zobowiązania	0.00	10,214.28
III.	Aktywa netto (I - II)	0.00	2,530,458.88

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	0.00	0.00
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	0.00	2,318,107.06
I.	Zwiększenia funduszu	0.00	2,427,910.35
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	0.00	224,327.60
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
3.	Pozostałe zwiększenia	0.00	2,203,582.75
II.	Zmniejszenia funduszu	0.00	109,803.29
1.	Tytułem wykupu	0.00	88,203.99
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0.00	0.00
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	0.00	267.87
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0.00	0.00
5.	Tytułem prowizji od składek	0.00	0.00
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0.00	0.00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	0.00	21,331.43
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
9.	Pozostałe zmniejszenia	0.00	0.00
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	0.00	157,343.95
1.	z papierów emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0.00	18,267.29
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	855.11
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	0.00	14,594.12
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
6.	z akcji	0.00	121,585.03
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	0.00	2,042.40
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	0.00	55,007.87
E.	Pozostałe zmniejszenia	0.00	0.00
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	0.00	2,530,458.88

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	0.00	149.11
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0.00	0.00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	0.00	1,660.62
4.	Koszty transakcyjne	0.00	63.88
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	0.00	19,457.82
6.	Pozostałe koszty	0.00	0.00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1 - 6):	0.00	21,331.43

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany B

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	0.000	0.000
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	0.000	238,986.974
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	0.0000	0.0000
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	0.0000	9.9836
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	0.0000	10.5921
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	0.0000	10.5883

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU

(w zł)		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:		1,212,459.54	47.66%
1.1	Obligacje		1,095,655.47	43.07%
1.1.1	DS0509	20.29	21,772.38	0.86%
1.1.2	DS1013	129.80	130,995.55	5.15%
1.1.3	DS1015	278.72	308,168.26	12.11%
1.1.4	DS1109	5.32	5,579.17	0.22%
1.1.5	DS1110	32.43	34,084.12	1.34%
1.1.6	DZ0109	17.26	19,020.31	0.75%
1.1.7	DZ0110	22.17	24,599.00	0.97%
1.1.8	DZ0709	2.60	2,754.85	0.11%
1.1.9	DZ0811	49.44	50,085.30	1.97%
1.1.10	OK0406	32.75	32,358.96	1.27%
1.1.11	OK0806	100.68	98,066.96	3.85%
1.1.12	OK0807	89.24	83,002.14	3.26%
1.1.13	OK1207	12.97	11,881.51	0.47%
1.1.14	PS0206	15.94	17,216.62	0.68%
1.1.15	PS0310	16.21	17,436.70	0.69%
1.1.16	PS0506	48.38	51,730.72	2.03%
1.1.17	PS0507	53.95	59,740.10	2.35%
1.1.18	PS0608	6.97	7,361.90	0.29%
1.1.19	PS1106	76.08	79,566.57	3.13%
1.1.20	SP0308	194.57	20,439.18	0.80%
1.1.21	SP1207	194.57	19,795.17	0.78%
1.2	Bony skarbowe		116,804.07	4.59%
1.2.1	BS060315	0.82	8,167.95	0.32%
1.2.2	BS060329	1.46	14,502.64	0.57%
1.2.3	BS060412	2.75	27,138.35	1.07%
1.2.4	BS061220	3.24	31,100.57	1.22%
1.2.5	BS060315	3.62	35,894.55	1.41%
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		26,836.87	1.05%
3.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		26,836.87	1.05%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		26,836.87	1.05%
3.1.1.1	LZBREPA3100412	26.55	26,836.87	1.05%
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		631,903.63	24.84%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
4.2	Pozostałe		631,903.63	24.84%
4.2.1	KWIDZYN060116	9.51	94,930.92	3.73%
4.2.2	KWIDZYN060228	4.58	45,439.63	1.79%
4.2.3	RABOBANK060404	18.31	181,091.33	7.12%
4.2.4	SITECH060919	7.57	73,361.31	2.88%
4.2.5	TOYOTALS060306	9.15	90,843.38	3.57%
4.2.6	VWLEASING060306	14.74	146,237.06	5.75%
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%

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

(w zł)		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
6.	Akcje		671,988.04	26.41%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		671,988.04	26.41%
6.1.1	Notowane na rynku regulowanym		671,988.04	26.41%
6.1.1.1	08OCTAVA	1,996.76	18,769.54	0.74%
6.1.1.2	AGORA	64.65	4,460.64	0.18%
6.1.1.3	AMICA	517.30	10,708.10	0.42%
6.1.1.4	ASSECOPOL	72.06	10,556.76	0.41%
6.1.1.5	ASSECOPOLPDA	8.46	1,243.30	0.05%
6.1.1.6	ATLANTA	465.57	8,170.74	0.32%
6.1.1.7	ATM	403.45	27,434.39	1.08%
6.1.1.8	BARLINEK	751.15	6,497.49	0.26%
6.1.1.9	BCHEM	284.51	10,043.37	0.39%
6.1.1.10	BRE	0.76	127.64	0.01%
6.1.1.11	BZWBK	66.20	9,367.13	0.37%
6.1.1.12	COMPLAND	187.31	17,420.21	0.68%
6.1.1.13	CSS	528.97	8,199.03	0.32%
6.1.1.14	DEBICA	150.04	9,752.44	0.38%
6.1.1.15	DECORA	517.05	14,477.28	0.57%
6.1.1.16	DGA	412.88	11,354.12	0.45%
6.1.1.17	ELBUDOWA	363.72	13,384.83	0.53%
6.1.1.18	ELDORADO	288.74	8,893.06	0.35%
6.1.1.19	EMAX	157.24	15,535.14	0.61%
6.1.1.20	EMCINSMED	715.84	8,017.39	0.32%
6.1.1.21	FORTE	666.42	9,196.54	0.36%
6.1.1.22	GETIN	1,000.70	6,304.41	0.25%
6.1.1.23	GRAAL	244.34	5,570.86	0.22%
6.1.1.24	HANDLOWY	135.72	9,025.29	0.35%
6.1.1.25	INGBSK	18.72	10,558.68	0.42%
6.1.1.26	INTERCARS	31.04	738.70	0.03%
6.1.1.27	JCAUTO	236.22	8,881.85	0.35%
6.1.1.28	JELFA	5.17	390.04	0.02%
6.1.1.29	KABLE	101.70	1,983.17	0.08%
6.1.1.30	KETY	49.25	6,181.13	0.24%
6.1.1.31	KGHM	441.21	27,575.61	1.08%
6.1.1.32	KOELNER	155.19	4,810.88	0.19%
6.1.1.33	KOPEX	179.75	10,964.50	0.43%
6.1.1.34	KROSNO	3,022.68	24,181.47	0.95%
6.1.1.35	LENA	738.11	6,052.49	0.24%
6.1.1.36	LENTEX	594.34	8,023.60	0.32%
6.1.1.37	LOTOS	3.09	136.50	0.01%
6.1.1.38	MOL	8.26	2,445.34	0.10%
6.1.1.39	MOSTALWAR	726.28	6,500.19	0.26%
6.1.1.40	NOVITA	412.31	3,545.85	0.14%
6.1.1.41	OPOCZNO	108.30	3,942.00	0.15%
6.1.1.42	PEKAES	261.10	2,193.25	0.09%
6.1.1.43	PEKAO	238.42	41,604.86	1.64%
6.1.1.44	PGF	180.34	10,946.69	0.43%
6.1.1.45	PGNIG	11,163.32	38,736.72	1.52%
6.1.1.46	PKNORLEN	629.87	39,492.77	1.55%
6.1.1.47	PKOBP	1,136.53	32,959.29	1.30%
6.1.1.48	POLIMEXMS	120.04	7,478.77	0.29%
6.1.1.49	POLNORD	107.36	1,492.24	0.06%
6.1.1.50	PROKOM	0.34	47.12	0.00%

6.1.1.51	RAFAKO	362.05	7,186.74	0.28%
----------	--------	--------	----------	-------

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupy Mieszany B

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

(w zł)		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
6.1.1.52	REDAN	290.17	1,305.76	0.05%
6.1.1.53	RMFFM	53.72	6,097.39	0.24%
6.1.1.54	SFINKS	310.38	4,438.43	0.17%
6.1.1.55	SNIEZKA	315.70	8,523.83	0.34%
6.1.1.56	SOFTBANK	362.28	14,128.73	0.56%
6.1.1.57	SPIN	103.87	3,251.08	0.13%
6.1.1.58	SWIECIE	55.77	2,844.27	0.11%
6.1.1.59	TECHMEX	208.79	3,131.81	0.12%
6.1.1.60	TOORA	2,845.15	50,643.60	1.99%
6.1.1.61	TPSA	443.26	10,372.24	0.41%
6.1.1.62	UNIMIL	101.34	3,070.57	0.12%
6.1.1.63	ZREW	70.03	9,244.22	0.36%
6.1.1.64	ZYWIEC	2.84	1,375.97	0.05%
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		833.09	0.03%
13.1	Depozyt O/N		833.09	0.03%
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:		2,544,021.17	100.00%
15.1	Ulokowane na terenie RP		2,544,021.17	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 na terenie krajów członkowskich OECD		0.00	0.00%
15.4	Ulokowane poza terenem RP, UE i OECD		0.00	0.00%