

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	6,783,722.10	4,262,529.87
1.	Lokaty	6,783,722.10	4,262,529.87
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	30,250.38	21,939.37
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	0.00	22.78
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0.00	0.00
3.	Pozostałe zobowiązania	30,250.38	21,916.59
III.	Aktywa netto (I - II)	6,753,471.72	4,240,590.50

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	33,140,382.88	6,753,416.99
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	-149,435.39	-1,775,563.45
I.	Zwiększenia funduszu	989,423.85	545,942.08
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	983,128.17	508,296.68
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
3.	Pozostałe zwiększenia	6,295.68	37,645.40
II.	Zmniejszenia funduszu	1,138,859.24	2,321,505.53
1.	Tytułem wykupu	913,090.86	1,815,959.83
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0.00	0.00
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	23,588.29	16,289.54
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0.00	0.00
5.	Tytułem prowizji od składek	58,087.22	27,910.81
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0.00	0.00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	129,935.38	98,302.59
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
9.	Pozostałe zmniejszenia	14,157.49	363,042.76
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	468,200.40	407,806.22
1.	z papierów emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	335,467.70	322,560.81
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	3,663.86
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	76,606.61	75,829.13
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
6.	z akcji	42,081.24	0.00
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	14,044.85	5,752.42
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	822,105.41	0.00
E.	Pozostałe zmniejszenia	27,527,781.58	1,145,069.26
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	6,753,471.72	4,240,590.50

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	57.58	389.52
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0.00	0.00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	11,406.66	7,058.05
4.	Koszty transakcyjne	916.47	173.33
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	117,551.37	90,681.69
6.	Pozostałe koszty	3.30	0.00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1 - 6):	129,935.38	98,302.59

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

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	3,134,786.310	965,004.333
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	965,004.333	568,510.167
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	6.6476	6.9983
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	0.0000	7.3507
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	6.9983	7.4632
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	6.9983	7.4591

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	1,196,987.301	0.000
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	0.000	0.000
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	10.2772	0.0000
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10.2211	0.0000
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	10.3549	0.0000
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	0.0000	0.0000

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

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:		3,144,257.62	73.77%
1.1	Obligacje		2,961,136.64	69.47%
1.1.1	DS0509	64.36	69,076.66	1.62%
1.1.2	DS1013	411.53	415,324.58	9.74%
1.1.3	DS1015	720.18	796,257.59	18.68%
1.1.4	DS1109	16.87	17,700.86	0.42%
1.1.5	DS1110	102.88	108,137.81	2.54%
1.1.6	DZ0109	54.77	60,345.26	1.42%
1.1.7	DZ0709	6.90	7,308.30	0.17%
1.1.8	DZ0811	155.54	157,573.86	3.70%
1.1.9	OK0406	103.91	102,664.46	2.41%
1.1.10	OK0806	61.73	60,106.05	1.41%
1.1.11	OK0807	283.13	263,338.82	6.18%
1.1.12	OK1207	41.15	37,696.17	0.88%
1.1.13	PS0206	50.58	54,622.73	1.28%
1.1.14	PS0310	51.44	55,320.99	1.30%
1.1.15	PS0506	153.13	163,720.91	3.84%
1.1.16	PS0507	171.01	189,354.09	4.44%
1.1.17	PS0608	22.12	23,356.91	0.55%
1.1.18	PS1106	240.56	251,580.08	5.90%
1.1.19	SP0308	617.30	64,846.88	1.52%
1.1.20	SP1207	617.30	62,803.63	1.47%
1.2	Bony skarbowe		183,120.98	4.30%
1.2.1	BS060315	1.40	13,848.42	0.32%
1.2.2	BS060329	2.48	24,588.63	0.58%
1.2.3	BS060412	4.66	46,011.94	1.08%
1.2.4	BS061220	10.29	98,672.00	2.31%
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		45,500.80	1.07%
3.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		45,500.80	1.07%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		45,500.80	1.07%
3.1.1.1	LZBREPA3100412	45.01	45,500.80	1.07%
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		1,071,366.27	25.13%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
4.2	Pozostałe		1,071,366.27	25.13%
4.2.1	KWIDZYN060116	16.13	160,951.41	3.78%
4.2.2	KWIDZYN060228	7.76	77,041.00	1.81%
4.2.3	RABOBANK060404	31.04	307,032.81	7.20%
4.2.4	SITECH060919	12.84	124,381.05	2.92%
4.2.5	TOYOTALS060306	15.52	154,021.16	3.61%
4.2.6	VWLEASING060306	24.99	247,938.84	5.82%
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		0.00	0.00%
6.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%

6.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
-------	-------------------------------	--	------	-------

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
6.1.2	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		1,405.18	0.03%
13.1	Depozyt O/N		1,405.18	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:		4,262,529.87	100.00%
15.1	Ulokowane na terenie RP		4,262,529.87	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%