



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON STRATEG

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	4 528 450,49	5 672 647,66
1.	lokaty	4 528 450,49	5 672 647,66
2.	środki pieniężne	0,00	0,00
3.	aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00
4.	należności	0,00	0,00
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
4.2.	pozostałe	0,00	0,00
II.	Zobowiązania	114 196,60	9 633,08
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	114 196,60	9 633,08
III.	Aktywa netto (I-II)	4 414 253,89	5 663 014,58



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON STRATEG

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	2 935 762,50	4 414 253,89
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	1 203 164,60	1 824 563,46
I.	Zwiększenia funduszu	2 304 757,07	3 566 730,24
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	2 083 992,82	2 505 921,43
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	220 764,25	1 060 808,81
II.	Zmniejszenia funduszu	1 101 592,47	1 742 166,79
1.	tytułem wykupu	333 997,62	320 089,88
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	3 664,22
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	54 308,97	58 853,68
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	46 438,51	62 918,81
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	666 847,37	1 296 640,20
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	275 326,79	-575 802,77
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	4 414 253,89	5 663 014,58



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON STRATEG

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	12 820,483	17 929,545
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	17 929,545	25 503,331
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	228,9900	246,2000
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	226,8000	215,8300
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	247,1400	255,4700
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	246,2000	222,0500



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON STRATEG

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)		
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	0,00	0,00%
1.1.	obligacje	0,00	0,00%
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.	inne dłużne papiery wartościowe o stałej stopie dochodu	0,00	0,00%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
3.2.	pozostałe	0,00	0,00%
4.	akcje	0,00	0,00%
4.1.	notowane na rynku regulowanym	0,00	0,00%
4.2.	pozostałe	0,00	0,00%
5.	udziały	0,00	0,00%
6.	jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych	5 672 647,66	100,00%
6.1.	jednostki uczestnictwa	5 672 647,66	100,00%
6.2.	certyfikaty inwestycyjne	0,00	0,00%
6.2.1.	funduszy inwestycyjnych dokonujących lokat wyłącznie w nieruchomości	0,00	0,00%
6.2.2.	innych funduszy inwestycyjnych	0,00	0,00%
7.	instrumenty pochodne, o ile służą zmniejszeniu ryzyka związanego z innymi aktywami stanowiącymi pokrycie rezerw techniczno-ubezpieczeniowych	0,00	0,00%
7.1.	opcje	0,00	0,00%
7.2.	kontrakty terminowe	0,00	0,00%
7.3.	swapy walutowe	0,00	0,00%
7.4.	swapy procentowe	0,00	0,00%
7.5.	inne instrumenty pochodne	0,00	0,00%
8.	inne papiery wartościowe o zmiennej kwocie dochodu	0,00	0,00%
9.	pożyczki	0,00	0,00%
9.1.	zabezpieczone hipotecznie	0,00	0,00%
9.2.	zabezpieczone gwarancjami instytucji finansowej	0,00	0,00%
9.3.	pod zastaw praw wynikających z umów ubezpieczenia na życie	0,00	0,00%
9.4.	inne pożyczki	0,00	0,00%
10.	nieruchomości	0,00	0,00%
11.	depozyty bankowe	0,00	0,00%
12.	pozostałe lokaty	0,00	0,00%
II.	Aktywa za zezwoleniem organu nadzoru, zgodnie z art. 154 ust. 9 ustawy z dnia 22 maja 2003 r. o działalności ubezpieczeniowej	0,00	0,00%
III.	Środki pieniężne	0,00	0,00%
IV.	Należności	0,00	0,00%
V.	Zobowiązania	9 633,08	0,17%
VI.	Aktywa netto (w tym)	5 663 014,58	99,83%
1	krajowe	5 663 014,58	99,83%
2	zagraniczne - kraje UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%