



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2015**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupy Obligacji

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	28.169.646,19	34.234.889,60
1.	lokaty	28.169.646,19	34.142.097,25
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	92.792,35
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
4.2.	pozostałe	0,00	92.792,35
II.	Zobowiązania	137.570,22	92.949,72
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	137.570,22	92.949,72
III.	Aktywa netto (I-II)	28.032.075,97	34.141.939,88



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupy Obligacji

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	22.863.320,39	28.032.075,97
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	2.630.589,29	5.727.608,37
I.	Zwiększenia funduszu	4.523.887,41	7.448.705,38
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	4.306.977,21	6.634.820,79
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	216.910,20	813.884,59
II.	Zmniejszenia funduszu	1.893.298,12	1.721.097,01
1.	tytułem wykupu	1.491.848,65	1.295.738,32
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	0,00	30,51
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	278.177,32	220.087,22
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	123.272,15	205.240,96
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	2.538.166,29	382.255,54
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	28.032.075,97	34.141.939,88



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2015**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupy Obligacji

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	1.140.423,301	1.278.876,423
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	1.278.876,423	1.555.533,580
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	20,0481	21,9193
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	19,8332	21,3915
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	22,0309	22,3731
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	21,9193	21,9487



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupy Obligacji

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	34.142.097,25	100,00%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	32.456.900,56	95,06%
1.1.	obligacje	32.456.900,56	95,06%
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	879.937,66	2,58%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	477.033,49	1,40%
3.2.	pozostałe	402.904,17	1,18%
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	0,00	0,00%
6.1.	jednostki uczestnictwa	0,00	0,00%
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	805.259,03	2,36%
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	92.792,35	0,27%
V.	Zobowiązania	92.949,72	0,27%
VI.	Aktywa netto (w tym)	34.141.939,88	100,00%
1	krajowe	34.141.939,88	100,00%
2	zagraniczne - kraje UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%