



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

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupowy Mieszany

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	72.014.316,23	77.685.708,14
1.	lokaty	71.944.103,65	77.604.110,38
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	70.212,58	81.597,76
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
4.2.	pozostałe	70.212,58	81.597,76
II.	Zobowiązania	525.336,21	333.265,88
1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	95.108,69	0,00
2.	wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0,00	0,00
3.	pozostałe	430.227,52	333.265,88
III.	Aktywa netto (I-II)	71.488.980,02	77.352.442,26



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Mieszany

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	61.203.036,66	71.488.980,02
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	6.287.732,32	7.649.633,30
I.	Zwiększenia funduszu	10.697.293,23	11.490.768,28
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	10.183.951,05	11.396.631,24
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	513.342,18	94.137,04
II.	Zmniejszenia funduszu	4.409.560,91	3.841.134,98
1.	tytułem wykupu	3.113.275,72	2.759.759,52
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	0,00	22,08
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	1.128.012,08	854.408,62
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	168.273,11	226.944,76
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	3.998.211,04	-1.786.171,06
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	71.488.980,02	77.352.442,26



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

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupowy Mieszany

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	2.340.397,644	2.622.322,893
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	2.622.322,893	2.956.072,742
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	26,1507	27,2617
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	25,7979	25,4596
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	27,7380	28,2511
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	27,2617	26,1673



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupowy Mieszany

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	77.604.110,38	100,33%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	49.534.812,57	64,04%
1.1.	obligacje	49.534.812,57	64,04%
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	1.353.422,10	1,75%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	733.262,78	0,95%
3.2.	pozostałe	620.159,32	0,80%
4.	akcje	23.582.133,03	30,49%
4.1.	notowane na rynku regulowanym	23.582.133,03	30,49%
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	3.133.742,68	4,05%
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	81.597,76	0,11%
V.	Zobowiązania	333.265,88	0,43%
VI.	Aktywa netto (w tym)	77.352.442,26	100,00%
1	krajowe	75.798.980,92	97,99%
2	zagraniczne - kraje UE	1.208.561,93	1,56%
3	zagraniczne - kraje poza UE	344.899,41	0,45%