



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

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupy Obligacji B

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	2.327.067,77	2.811.176,35
1.	lokaty	2.327.067,77	2.805.077,66
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	6.098,69
4.1.	z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym	0,00	0,00
4.2.	pozostałe	0,00	6.098,69
II.	Zobowiązania	26.998,23	7.724,98
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	26.998,23	7.724,98
III.	Aktywa netto (I-II)	2.300.069,54	2.803.451,37



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Grupowy Obligacji B

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	2.045.085,09	2.300.069,54
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I-II)	34.166,27	470.386,13
I.	Zwiększenia funduszu	452.653,95	600.061,99
1.	tytułem składek zwiększających wartość funduszu	452.653,95	598.874,12
2.	pozostałe przychody	0,00	0,00
3.	pozostałe zwiększenia	0,00	1.187,87
II.	Zmniejszenia funduszu	418.487,68	129.675,86
1.	tytułem wykupu	157.827,55	74.047,82
2.	tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	0,00	0,00
3.	tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych z funduszu	308,58	1.365,61
4.	tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0,00	0,00
5.	tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	24.219,64	27.284,93
6.	pozostałe koszty	0,00	0,00
7.	pozostałe zmniejszenia	236.131,91	26.977,50
C.	Wynik netto z działalności inwestycyjnej	220.818,18	32.995,70
D.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	2.300.069,54	2.803.451,37



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

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupowy Obligacji B

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	152.882,983	157.263,260
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	157.263,260	191.424,588
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	13,3768	14,6256
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	13,2335	14,2735
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	14,7000	14,9284
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	14,6256	14,6452



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2015

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Grupowy Obligacji B

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

		Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach netto funduszu (w %)
	1	2	3
I.	Lokaty (suma 1-12)	2.805.077,66	100,06%
1.	papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	2.666.623,72	95,12%
1.1.	obligacje	2.666.623,72	95,12%
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	72.294,73	2,58%
3.1.	notowane na rynku regulowanym	39.192,56	1,40%
3.2.	pozostałe	33.102,17	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	66.159,21	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	6.098,69	0,22%
V.	Zobowiązania	7.724,98	0,28%
VI.	Aktywa netto (w tym)	2.803.451,37	100,00%
1	krajowe	2.803.451,37	100,00%
2	zagraniczne - kraje UE	0,00	0,00%
3	zagraniczne - kraje poza UE	0,00	0,00%