

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

I. AKTYWA NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
I.	Aktywa	52,067,369.46	57,425,891.12
1.	Lokaty	52,067,369.46	57,425,891.12
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	173,352.38	192,052.76
1.	Z tytułu nabytych składników portfela inwestycyjnego	0.00	427.68
2.	Zobowiązania wobec ubezpieczających lub uprawnionych z umów ubezpieczenia	0.00	0.00
3.	Pozostałe zobowiązania	173,352.38	191,625.08
III.	Aktywa netto (I - II)	51,894,017.08	57,233,838.36

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
A.	Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego	47,097,690.22	51,893,824.05
B.	Stan netto z działalności operacyjnej (I -II)	1,551,146.35	2,298,349.64
I.	Zwiększenia funduszu	16,725,603.87	15,540,618.00
1.	Tytułem składek zwiększających wartość funduszu	16,265,075.61	13,636,810.67
2.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
3.	Pozostałe zwiększenia	460,528.26	1,903,807.33
II.	Zmniejszenia funduszu	15,174,457.52	13,242,268.36
1.	Tytułem wykupu	7,999,057.58	6,623,028.52
2.	Tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych	54,991.82	55,608.13
3.	Tytułem opłaty za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu	3,128,683.57	2,883,884.15
4.	Tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych	0.00	0.00
5.	Tytułem prowizji od składek	860,790.69	717,318.99
6.	Tytułem pozostałych prowizji	0.00	0.00
7.	Tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem	829,011.01	822,519.47
8.	Tytułem udzielonych gwarancji	0.00	0.00
9.	Pozostałe zmniejszenia	2,301,922.85	2,139,909.10
C.	Przychody netto z działalności inwestycyjnej (po potrąceniu kosztów)	3,682,160.42	4,870,885.68
1.	z papierów emitowanych, poręczonych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska	3,228,691.58	4,497,351.25
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	0.00
4.	z innych dłużnych papierów wartościowych o stałej stopie dochodu	351,910.79	322,939.02
5.	z innych dłużnych papierów wartościowych o zmiennej stopie dochodu	0.00	0.00
6.	z akcji	0.00	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	101,558.05	50,595.41
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	0.00	0.00
E.	Pozostałe zmniejszenia	436,979.91	1,829,221.01
F.	Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego	51,894,017.08	57,233,838.36

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

III. KOSZTY FUNDUSZU

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Koszty prowadzenia i obsługi rachunków bankowych	83.33	2,453.38
2.	Koszty nabycia jednostek rozrachunkowych	0.00	0.00
3.	Koszty przechowywania aktywów funduszu	93,327.43	92,134.81
4.	Koszty transakcyjne	3,036.48	1,800.60
5.	Koszty zarządzania i administrowania funduszem	731,663.77	726,130.68
6.	Pozostałe koszty	900.00	0.00
7.	RAZEM koszty funduszu (suma poz. 1 - 6):	829,011.01	822,519.47

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na
dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

IV. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

(w zł)		Okres poprzedni	Okres bieżący
1.	Liczba jednostek rozrachunkowych:		
1.1.	liczba jednostek rozrachunkowych na początek okresu sprawozdawczego	8,547,382.714	8,896,623.030
1.2.	liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego	8,896,623.030	9,124,904.051
2.	Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł):		
2.1.	wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego	5.5102	5.8330
2.2.	minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	5.4665	6.1506
2.3.	maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym	5.8330	6.2866
2.4.	wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego	5.8330	6.2722

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

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:		57,425,750.69	100.00%
1.1	Obligacje		55,572,903.24	96.77%
1.1.1	DS0509	1,208.60	1,297,110.84	2.26%
1.1.2	DS1013	7,727.65	7,798,900.62	13.58%
1.1.3	DS1015	13,523.39	14,952,001.52	26.04%
1.1.4	DS1109	316.83	332,383.92	0.58%
1.1.5	DS1110	1,931.91	2,030,595.03	3.54%
1.1.6	DZ0109	1,028.55	1,133,154.02	1.97%
1.1.7	DZ0709	100.46	106,372.52	0.19%
1.1.8	DZ0811	2,920.67	2,958,897.46	5.15%
1.1.9	OK0406	1,951.23	1,927,817.26	3.36%
1.1.10	OK0806	1,159.15	1,128,662.16	1.97%
1.1.11	OK0807	5,316.62	4,944,935.55	8.61%
1.1.12	OK1207	772.77	707,852.89	1.23%
1.1.13	PS0206	949.73	1,025,697.16	1.79%
1.1.14	PS0310	965.96	1,038,808.89	1.81%
1.1.15	PS0506	2,875.46	3,074,325.94	5.35%
1.1.16	PS0507	3,211.23	3,555,661.71	6.19%
1.1.17	PS0608	415.36	438,592.43	0.76%
1.1.18	PS1106	4,517.20	4,724,131.66	8.23%
1.1.19	SP0308	11,591.48	1,217,684.71	2.12%
1.1.20	SP1207	11,591.48	1,179,316.92	2.05%
1.2	Bony skarbowe		1,852,847.45	3.23%
1.2.1	BS061220	193.19	1,852,847.45	3.23%
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		0.00	0.00%
3.1	Dopuszczone do publicznego obrotu		0.00	0.00%
3.1.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
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		0.00	0.00%
4.1	Notowane na rynku regulowanym		0.00	0.00%
4.2	Pozostałe		0.00	0.00%
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%
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%
----	--	--	------	-------

Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2005

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Obligacji

V. ZESTAWIENIE LOKAT FUNDUSZU - CIĄG DALSZY

Lokaty		Ilość (w szt.)	Wartość bilansowa (w zł)	Udział w aktywach funduszu (w %)
1		2	3	4
9.1	Opcje		0.00	0.00%
9.2	Kontrakty terminowe		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		140.43	0.00%
13.1	Depozyt O/N		140.43	0.00%
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:		57,425,891.12	100.00%
15.1	Ulokowane na terenie RP		57,425,891.12	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%