



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON SENIOR E

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|-------------|---|------------------|-------------------|
| I. | Aktywa | 66 879,50 | 641 254,26 |
| 1. | lokaty | 66 879,50 | 641 254,26 |
| 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 | 12 177,65 | 10 490,89 |
| 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 | 12 177,65 | 10 490,89 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 54 701,85 | 630 763,37 |



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON SENIOR E

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| (w zł) | | Okres poprzedni | Okres bieżący |
|--------|--|-----------------|---------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 0,00 | 54 701,85 |
| B. | Stan netto z działalności operacyjnej (I-II) | 53 822,35 | 591 686,76 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 53 822,35 | 600 523,56 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 0,00 | 586 812,73 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 53 822,35 | 13 710,83 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 0,00 | 8 836,80 |
| 1. | tytułem wykupu | 0,00 | 8 836,80 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrącanych z funduszu | 0,00 | 0,00 |
| 4. | tytułem zwrotu składek ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 5. | tytułem opłat za zarządzanie funduszem oraz innych opłat tytułem administrowania funduszem | 0,00 | 0,00 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 0,00 | 0,00 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | 879,50 | -15 625,24 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 54 701,85 | 630 763,37 |



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON SENIOR E

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 | 0,000 | 195,797 |
| 1.2. | liczba jednostek rozrachunkowych na koniec okresu sprawozdawczego | 195,797 | 2 297,277 |
| 2. | Wartość jednostki rozrachunkowej (w zł): | | |
| 2.1. | wartość jednostki rozrachunkowej na początek okresu sprawozdawczego | 0,0000 | 279,3800 |
| 2.2. | minimalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 0,0000 | 270,0600 |
| 2.3. | maksymalna wartość jednostki rozrachunkowej w okresie sprawozdawczym | 279,8600 | 285,6700 |
| 2.4. | wartość jednostki rozrachunkowej na koniec okresu sprawozdawczego | 279,3800 | 274,5700 |



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2011

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - LEGG MASON SENIOR E

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 | 641 254,26 | 100,00% |
| 6.1. | jednostki uczestnictwa | 641 254,26 | 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 | 10 490,89 | 1,64% |
| VI. | Aktywa netto (w tym) | 630 763,37 | 98,36% |
| 1 | krajowe | 630 763,37 | 98,36% |
| 2 | zagraniczne - kraje UE | 0,00 | 0,00% |
| 3 | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |