



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu
kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Strategia Mieszana

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|---|--|---|
| I. | Aktywa | 14.183.989,31 | 8.110.090,44 |
| 1. | lokaty | 14.183.953,67 | 8.109.968,95 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 35,64 | 121,49 |
| 3.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2. | pozostałe | 35,64 | 121,49 |
| II. | Zobowiązania | 57.028,69 | 40.543,87 |
| 1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 1.217,21 |
| 2. | wobec ubezpieczających, ubezpieczonych, uposażonych lub uprawnionych z umów ubezpieczenia | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe | 57.028,69 | 39.326,66 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 14.126.960,62 | 8.069.546,57 |



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu
kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Strategia Mieszana

II. ZMIANY AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|--|---|--------------------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 15.193.036,48 | 14.126.960,62 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | -889.059,82 | -6.805.666,01 |
| I. | Zwiększenia funduszu | -563,56 | -2.699,95 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | -563,56 | -5.380,79 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 0,00 | 2.680,84 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 888.496,26 | 6.802.966,06 |
| 1. | tytułem wykupu | 643.934,22 | 6.595.540,18 |
| 2. | tytułem wypłat pozostałych świadczeń ubezpieczeniowych | 0,00 | 0,00 |
| 3. | tytułem opłat za ryzyko ubezpieczeniowe oraz innych opłat potrąconych 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 | 231.476,99 | 204.133,20 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 13.085,05 | 3.292,68 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | -177.016,04 | 748.251,96 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 14.126.960,62 | 8.069.546,57 |



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu
kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Strategia Mieszana

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK ROZRACHUNKOWYCH

| | Pozycja | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|---|---|--------------------------------|
| I. | Liczba jednostek uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 909.751,768 | 871.894,672 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 871.894,672 | 474.358,321 |
| II. | Wartość jednostki uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 16,7002 | 16,2026 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 15,6702 | 15,3337 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 17,8085 | 17,0143 |
| 4. | na koniec okresu sprawozdawczego | 16,2026 | 17,0115 |



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu
kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2016**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Strategia Mieszana

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|---|-----------------------------|---|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 8.109.968,95 | 100,50% |
| 1. | papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub organizacje międzynarodowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska | 3.013.673,64 | 37,35% |
| 1.1. | obligacje | 3.013.673,64 | 37,35% |
| 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 | 35.414,61 | 0,44% |
| 3.1. | notowane na rynku regulowanym | 0,00 | 0,00% |
| 3.2. | pozostałe | 35.414,61 | 0,44% |
| 4. | akcje | 448.799,05 | 5,56% |
| 4.1. | notowane na rynku regulowanym | 448.799,05 | 5,56% |
| 4.2. | pozostałe | 0,00 | 0,00% |
| 5. | udziały | 0,00 | 0,00% |
| 6. | jednostki uczestnictwa i certyfikaty inwestycyjne w funduszach inwestycyjnych | 4.475.619,99 | 55,46% |
| 6.1. | jednostki uczestnictwa | 4.475.619,99 | 55,46% |
| 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 | 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 | 136.461,66 | 1,69% |
| 12. | pozostałe lokaty | 0,00 | 0,00% |
| II. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 121,49 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 40.543,87 | 0,50% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 8.069.546,57 | 100,00% |
| 1 | krajowe | 8.036.922,91 | 99,60% |
| 2 | zagraniczne - kraje UE | 23.124,21 | 0,29% |
| 3 | zagraniczne - kraje poza UE | 9.499,45 | 0,12% |