



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2017

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - JPMorgan Global Macro Opportunities Fund (EUR)

I. WARTOŚĆ AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Koniec analogicznego okresu sprawozdawczego poprzedniego roku obrotowego | Koniec bieżącego okresu sprawozdawczego |
|-------------|---|--|---|
| I. | Aktywa | 203 159,48 | 357 772,19 |
| 1. | lokaty | 203 159,48 | 357 772,19 |
| 2. | środki pieniężne | 0,00 | 0,00 |
| 3. | należności | 0,00 | 0,00 |
| 3.1. | z tytułu transakcji zawartych na rynku finansowym | 0,00 | 0,00 |
| 3.2. | pozostałe | 0,00 | 0,00 |
| II. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00 |
| 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 | 0,00 | 0,00 |
| III. | Aktywa netto (I-II) | 203 159,48 | 357 772,19 |



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2017

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

Fundusz Generali - JPMorgan Global Macro Opportunities Fund (EUR)

II. ZMIANY WARTOŚCI AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | (w zł) | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|--|---|--------------------------------|
| A. | Aktywa netto funduszu na początek okresu sprawozdawczego | 0,00 | 203 159,48 |
| B. | Wynik netto z działalności operacyjnej (I-II) | 223 602,06 | 138 477,93 |
| I. | Zwiększenia funduszu | 382 231,35 | 225 052,73 |
| 1. | tytułem składek zwiększających wartość funduszu | 137 010,90 | 188 600,00 |
| 2. | pozostałe przychody | 0,00 | 0,00 |
| 3. | pozostałe zwiększenia | 245 220,45 | 36 452,73 |
| II. | Zmniejszenia funduszu | 158 629,29 | 86 574,80 |
| 1. | tytułem wykupu | 68 779,71 | 6 257,68 |
| 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 | 2 734,48 | 2 635,28 |
| 6. | pozostałe koszty | 0,00 | 0,00 |
| 7. | pozostałe zmniejszenia | 87 115,10 | 77 681,84 |
| C. | Wynik netto z działalności inwestycyjnej | -20 442,58 | 16 134,78 |
| D. | Aktywa netto funduszu na koniec okresu sprawozdawczego | 203 159,48 | 357 772,19 |



**Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego
sporządzone na dzień 31.12.2017**

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Generali - JPMorgan Global Macro Opportunities Fund (EUR)

III. LICZBA I WARTOŚĆ JEDNOSTEK UCZESTNICTWA FUNDUSZU

| | Pozycja | Analogiczny okres sprawozdawczy poprzedniego roku obrotowego | Bieżący okres sprawozdawczy |
|------------|---|---|--------------------------------|
| I | Liczba jednostek uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 0,000 | 347,211 |
| 2. | na koniec okresu sprawozdawczego | 347,211 | 570,941 |
| II. | Wartość jednostki uczestnictwa funduszu: | | |
| 1. | na początek okresu sprawozdawczego | 607,6161 | 585,1182 |
| 2. | minimalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 569,2658 | 541,5415 |
| 3. | maksymalna wartość jednostki uczestnictwa funduszu w okresie sprawozdawczym | 647,4979 | 659,3100 |
| 4. | na koniec okresu sprawozdawczego | 585,1182 | 626,6360 |



Roczne sprawozdanie ubezpieczeniowego funduszu kapitałowego sporządzone na dzień 31.12.2017

Generali Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.
Fundusz Generali - JPMorgan Global Macro Opportunities Fund (EUR)

V. ZESTAWIENIE AKTYWÓW NETTO FUNDUSZU

| | | Wartość bilansowa (w zł) | Udział w aktywach netto funduszu (w %) |
|-------------|---|-----------------------------|---|
| | 1 | 2 | 3 |
| I. | Lokaty (suma 1-12) | 357 772,19 | 100,00% |
| 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 | 357 772,19 | 100,00% |
| 6.1. | jednostki uczestnictwa | 357 772,19 | 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 | 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. | Środki pieniężne | 0,00 | 0,00% |
| III. | Należności | 0,00 | 0,00% |
| IV. | Zobowiązania | 0,00 | 0,00% |
| V. | Aktywa netto (w tym) | 357 772,19 | 100,00% |
| 1 | krajowe | 0,00 | 0,00% |
| 2 | zagraniczne - kraje UE | 357 772,19 | 100,00% |
| 3 | zagraniczne - kraje poza UE | 0,00 | 0,00% |