

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) IntegrAzione Total Return
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2009

Allegato I

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2009		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	13.553,53	31,01	26.180,16	76,46
A1. Titoli di debito	12.519,08	28,64	21.897,30	63,95
A1.1. Titoli di Stato	12.519,08	28,64	21.897,30	63,95
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.	1.034,45	2,37	4.282,86	12,51
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	951,16	2,18		
B1. Titoli di debito				
B1.1. Titoli di Stato				
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili				
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
B2. Titoli azionari				
B3. Parti di O.I.C.R.	951,16	2,18		
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
C1.1. Opzioni negoziate				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
C2.1. Opzioni non negoziate				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	21.686,36	49,62	361,48	1,06
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	7.425,01	16,99	7.607,30	22,22
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	89,90	0,21	93,61	0,27
H1. Ratei attivi	89,90	0,21	93,61	0,27
H2. Altri attivi (da specificare)				
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni retrocesse				
H2.4. Insussistenza passiva				
H2.5. Vendite a termine divise				
TOTALE ATTIVITA'	43.705,96	100,00	34.242,55	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2009		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE				
M. ALTRE PASSIVITA'	-154,21	100,00	-105,16	100,00
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-154,21	100,00	-105,16	100,00
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'	-154,21	100,00	-105,16	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		43.551,75		34.137,39
Numero delle quote in circolazione		4.428,28300		3.523,96800
Valore unitario delle quote		9,835		9,687

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	21,60800	14,33300	14,55500	859,20400
Quote rimborsate		5,38500		

	Rendiconto al 31-12-2009	Rendiconto esercizio precedente	
A. STRUMENTI FINANZIARI			
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	1.191,28	649,45	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	1.191,28	631,20	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari		18,25	
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.			
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	-554,79	-259,24	
A2.1. Titoli di debito	-569,03	12,90	
A2.2. Titoli azionari		-147,61	
A2.3. Parti di O.I.C.R.	14,24	-124,53	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	533,43	137,94	
A3.1. Titoli di debito	160,18	50,70	
A3.2. Titoli di capitale			
A3.3. Parti di O.I.C.R.	373,25	87,24	
Risultato gestione strumenti finanziari	1.169,92		528,15
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI			
B1. RISULTATI REALIZZATI			
B1.1. Su strumenti negoziati			
B1.2. Su strumenti non negoziati			
B2. RISULTATI NON REALIZZATI			
B2.1. Su strumenti negoziati			
B2.2. Su strumenti non negoziati			
Risultato gestione strumenti finanziari derivati			
C. INTERESSI ATTIVI			
C1. SU DEPOSITI BANCARI	24,87	38,55	
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI	24,87	38,55	
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI			
D1. RISULTATI REALIZZATI	-34,54		
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-34,54		
E. PROVENTI SU CREDITI			
F. ALTRI PROVENTI			
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		4,43	
F2. PROVENTI DIVERSI		4,43	
Risultato lordo della gestione di portafoglio	1.160,25		571,13
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)			
G1. Bolli, spese e commissioni		-8,29	
		-8,29	
Risultato netto della gestione di portafoglio	1.160,25		562,84
H. ONERI DI GESTIONE			
H1. Commissione di gestione	-631,21	-432,92	
H2. Spese pubblicazione quota	-592,97	-404,24	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-38,24	-28,68	
H4. Altri oneri di gestione			
I. ALTRI RICAVI E ONERI			
I1. Altri ricavi			
I2. Altri costi			
Utile/perdita della gestione del Fondo	529,04		129,92

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
Rendimento del benchmark		Volatilità del benchmark **	
Differenza		Volatilità dichiarata ***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** Indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	1,53	Volatilità della gestione	Bassa
		Volatilità dichiarata	Medio / bassa

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark