

RENDICONTO ANNUALE DI GESTIONE DEL FONDO INTERNO

VERA Vita

BANCO BPM
GRUPPO

PAGINA 1

Fondo interno: **POPOLARE VITA MULTISTRATEGY**

Situazione patrimoniale al **31 dicembre 2023**

Allegato 1

| ATTIVITÀ | Situazione al 31/12/2023 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 647.757,06 | 96,64 | 965.625,27 | 97,62 |
| A1. Titoli di debito | - | - | - | - |
| A1.1. Titoli di Stato | - | - | - | - |
| 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. | 647.757,06 | 96,64 | 965.625,27 | 97,62 |
| B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI | - | - | - | - |
| B1. Titoli di debito | - | - | - | - |
| B1.1. Titoli di Stato | - | - | - | - |
| B1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili | - | - | - | - |
| B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi | - | - | - | - |
| B2. Titoli azionari | - | - | - | - |
| B3. Parti di O.I.C.R. | - | - | - | - |
| C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | - | - | - | - |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | - | - | - | - |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | - | - | - | - |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE | 697,67 | 0,10 | 32,13 | - |
| E. DEPOSITI BANCARI | 21.886,47 | 3,26 | 23.563,19 | 2,38 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | - | - | - | - |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | - | - | - | - |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | - | - | - | - |
| H1. Ratei attivi | - | - | - | - |
| H2. Altri attivi (da specificare) | - | - | - | - |
| H2.1. Crediti d'imposta | - | - | - | - |
| H2.2. Crediti per ritenute | - | - | - | - |
| H2.3. Credito per retrocessione commissioni | - | - | - | - |
| H2.4. Credito per penali CSDR da rimborsare | - | - | - | - |
| TOTALE ATTIVITÀ | 670.341,20 | 100,00 | 989.220,59 | 100,00 |

| PASSIVITÀ E NETTO | Situazione al 31 dicembre 2023 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------------|------------------------|--|------------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale passività | Valore complessivo | % sul totale passività |
| I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | - | - | - | - |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | - | - | - | - |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | - | - | - | - |
| I2.1. CS - Forward in divisa | - | - | - | - |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE | -1.481,41 | 19,25 | -2.355,88 | 17,86 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -6.213,12 | 80,75 | -10.833,51 | 82,14 |
| M1. Ratei passivi | - | - | - | - |
| M2. Spese pubblicazione quota | - | - | - | - |
| M3. Spese revisione rendiconto | -3.618,01 | 47,02 | -6.814,41 | 51,67 |
| M4. Commissione di gestione | -2.595,11 | 33,73 | -4.019,10 | 30,47 |
| M5. Passività diverse | - | - | - | - |
| TOTALE PASSIVITÀ | -7.694,53 | 100,00 | -13.189,39 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | 662.646,67 | | 976.031,20 | |
| Numero delle quote in circolazione | 69.365,296 | | 106.344,650 | |
| Valore unitario delle quote | 9,553 | | 9,178 | |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 92.392,189 | - | - | 1.510,858 |
| Quote rimborsate | 12.484,587 | 22.162,885 | 90.449,436 | 5.785,493 |

Vera Vita S.p.A.
Sede legale: Via Massaua, 6 - 20146 Milano - tel. +39 045 8392777
Pec: comunicazioni@pec.veravitaassicurazioni.it - www.veravitaassicurazioni.it
Capitale sociale € 219.600.005,00 int. vers. - Società soggetta all'attività di direzione e coordinamento da parte di Banco BPM S.p.A.
N. di iscr. al Reg. delle Imprese di Milano, C.F. e Partita I.V.A. 03035950231

Impresa autorizzata all'esercizio delle assicurazioni con Provvedimento Isvap n. 1762 del 21/12/2000 pubblicato sulla Gazzetta Ufficiale n. 1 del 2/1/2001 - Iscritta all'Albo delle Imprese di Assicurazione e riassicurazione Sezione I al n. 01.00137
Società del Gruppo assicurativo Banco BPM VITA, iscritto all'Albo dei Gruppi assicurativi al n. 045

RENDICONTO ANNUALE DI GESTIONE DEL FONDO INTERNO

VERA Vita

BANCO BPM
GRUPPO

PAGINA 2

Fondo interno: **POPOLARE VITA MULTISTRATEGY**

Situazione reddituale al **31 dicembre 2023**

Allegato 2

| | Rendiconto al 31/12/2023 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | 56.940,29 | -113.275,22 |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | - | - |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito | - | - |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari | - | - |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R. | - | - |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 26.263,67 | -53.040,46 |
| A2.1. Titoli di debito | - | - |
| A2.2. Titoli azionari | - | - |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 26.263,67 | -53.040,46 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 30.676,62 | -60.234,76 |
| A3.1. Titoli di debito | - | - |
| A3.2. Titoli di capitale | - | - |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 30.676,62 | -60.234,76 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 56.940,29 | -113.275,22 |
| 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 | 0,26 | - |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 0,26 | - |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | - | - |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | -5,88 | 10,75 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | -0,06 | 0,53 |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | -5,82 | 10,22 |
| E. PROVENTI SU CREDITI | - | - |
| F. ALTRI PROVENTI | - | - |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | - | - |
| F2. PROVENTI DIVERSI | - | - |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | 56.934,67 | -113.264,47 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -320,86 | -296,54 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -320,86 | -296,54 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 56.613,81 | -113.561,01 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -20.956,58 | -23.277,52 |
| H1. Commissioni di gestione | -17.338,57 | -19.659,51 |
| H2. Spese di pubblicazione quota | - | - |
| H3. Spese di gestione, amministrazione custodia | -3.618,01 | -3.618,01 |
| H4. Altri oneri di gestione | - | - |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | -0,20 | -0,71 |
| I1. Altri ricavi | 0,97 | 0,44 |
| I2. Altri costi | -1,17 | -1,15 |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 35.657,03 | -136.839,24 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 4,09% | Volatilità della gestione | 3,14% |
| Rendimento del benchmark | 0,00% | Volatilità del benchmark ** | 0,00% |
| Differenza | 4,09% | Volatilità dichiarata *** | 0,00% |

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicare soltanto in caso di gestione passiva

*** indicare soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|---------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 0,00% | Volatilità della gestione | 0,00% |
| | | Volatilità dichiarata | 0,00% |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Redatto il 29/02/2024

Vera Vita S.p.A.

Sede legale: Via Massaua, 6 - 20146 Milano - tel. +39 045 8392777
Pec: comunicazioni@pec.veravitaassicurazioni.it - www.veravitaassicurazioni.it
Capitale sociale € 219.600.005,00 int. vers. - Società soggetta all'attività di direzione e coordinamento da parte di Banco BPM S.p.A.
N. di iscr. al Reg. delle Imprese di Milano, C.F. e Partita I.V.A. 03035950231

Impresa autorizzata all'esercizio delle assicurazioni con Provvedimento Isvap n. 1762 del 21/12/2000 pubblicato sulla Gazzetta Ufficiale n. 1 del 2/1/2001 - Iscritta all'Albo delle Imprese di Assicurazione e riassicurazione Sezione I al n. 01.00137
Società del Gruppo assicurativo Banco BPM VITA, iscritto all'Albo dei Gruppi assicurativi al n. 045