

PROSPETTI DELLE COMPOSIZIONI E RENDICONTI RIEPILOGATIVI DELLE GESTIONI SEPARATE PER IL PERIODO DI OSSERVAZIONE DAL 1.11.2016 AL 31.10.2017 - IMPORTI IN EURO

GESTIONE FUTURO

CODICE IMPRESA: 440
CODICE GESTIONE: 00002

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2017)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2016)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	89.225.632	85.882.196
101 BTP	78.173.026	77.466.435
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	3.602.160	999.962
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	7.450.446	7.415.799
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	-	-
108 Obbligazioni non quotate in valuta	-	-
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	578.578	578.578
201 Azioni quotate in euro	578.578	578.578
202 Azioni non quotate in euro	-	-
203 Azioni quotate in valuta	-	-
204 Azioni non quotate in valuta	-	-
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	-	-
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	-	-
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità	-	-
350 Altre tipologie di attività	-	-
di cui: 351 Pronti contro Termine	-	-
352 Ratei Attivi	-	-
353 Retrocessione di commissioni	-	-
400 Passività patrimoniali:	-	-
401 Debiti per spese di revisione contabile	-	-
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività	-	-
1000 Saldo attività della gestione separata	89.804.210	86.460.774

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38/2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

INTEGRAZIONE FUTURO

CODICE IMPRESA: 440
CODICE GESTIONE: 00003

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2017)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2016)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	204.078	191.269
101 BTP	204.078	191.269
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	-	-
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	-	-
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	-	-
108 Obbligazioni non quotate in valuta	-	-
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	-	-
201 Azioni quotate in euro	-	-
202 Azioni non quotate in euro	-	-
203 Azioni quotate in valuta	-	-
204 Azioni non quotate in valuta	-	-
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	-	-
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	-	-
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità	-	-
350 Altre tipologie di attività	-	-
di cui: 351 Pronti contro Termine	-	-
352 Ratei Attivi	-	-
353 Retrocessione di commissioni	-	-
400 Passività patrimoniali:	-	-
401 Debiti per spese di revisione contabile	-	-
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività	-	-
1000 Saldo attività della gestione separata	204.078	191.269

Redatto il 10 novembre 2017

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2017)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2016)
Riserve matematiche	82.917.929	83.052.348
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*

(*) Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2017)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2016)
Riserve matematiche	139.640	192.109
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n 25/2008	*	*

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 3.239.710
101 Interessi su titoli di Stato in euro	3.061.749
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	161.041
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	16.920
106 Dividendi su azioni in valuta	-
107 Redditi degli investimenti immobiliari	-
150 Altre tipologie di proventi	-
di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività	-
200 Utili/perdite da realizza	B 59.439
201 Titoli di Stato in euro	834
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	58.605
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro	-
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta	-
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta	-
207 Titoli azionari quotati in euro	-
208 Titoli azionari non quotati in euro	-
209 Titoli azionari in valuta quotati	-
210 Titoli azionari in valuta non quotati	-
211 Immobili	-
212 Cambi	-
250 Altre tipologie di utili/perdite	-
di cui: 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie	-
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C -
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C 3.299.149
500 Spese di revisione contabile	D 1.449
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 2.502
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 3.295.198
800 Giacenza media delle attività investite	87.465.757
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,77%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/15 al 30/11/16	3,79%	dal 01/06/16 al 31/05/17	3,73%
dal 01/01/16 al 31/12/16	3,80%	dal 01/07/16 al 30/06/17	3,71%
dal 01/02/16 al 31/01/17	3,81%	dal 01/08/16 al 31/07/17	3,71%
dal 01/03/16 al 28/02/17	3,79%	dal 01/09/16 al 31/08/17	3,73%
dal 01/04/16 al 31/03/17	3,80%	dal 01/10/16 al 30/09/17	3,74%
dal 01/05/16 al 30/04/17	3,80%	dal 01/11/16 al 31/10/17	3,77%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 2.294
101 Interessi su titoli di Stato in euro	2.294
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	-
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	-
106 Dividendi su azioni in valuta	-
107 Redditi degli investimenti immobiliari	-
150 Altre tipologie di proventi	-
di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività	-
200 Utili/perdite da realizza	B 1.862
201 Titoli di Stato in euro	1.862
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	-
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro	-
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta	-
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta	-
207 Titoli azionari quotati in euro	-
208 Titoli azionari non quotati in euro	-
209 Titoli azionari in valuta quotati	-
210 Titoli azionari in valuta non quotati	-
211 Immobili	-
212 Cambi	-
250 Altre tipologie di utili/perdite	-
di cui: 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie	-
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C -
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C 4.156
500 Spese di revisione contabile	D -
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 30
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 4.126
800 Giacenza media delle attività investite	192.914
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	2,14%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/15 al 30/11/16	2,91%	dal 01/06/16 al 31/05/17	1,39%
dal 01/01/16 al 31/12/16	2,70%	dal 01/07/16 al 30/06/17	1,78%
dal 01/02/16 al 31/01/17	2,47%	dal 01/08/16 al 31/07/17	1,82%
dal 01/03/16 al 28/02/17	2,25%	dal 01/09/16 al 31/08/17	1,53%
dal 01/04/16 al 31/03/17	2,02%	dal 01/10/16 al 30/09/17	2,19%
dal 01/05/16 al 30/04/17	2,27%	dal 01/11/16 al 31/10/17	2,14%

Le attività sono iscritte al valore medio di carico risultante dalla contabilità - Ai sensi delle disposizioni IVASS vigenti