

“ORIZZONTE”

CODICE IMPRESA: 440 CODICE GESTIONE: 00012

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	2.562.956.212	2.527.142.219
101 BTP	1.720.059.697	1.767.547.228
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	199.462.740	199.592.202
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	643.433.775	560.002.789
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:	1.473.738	15.473.967
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	1.473.738	1.473.738
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità	-	14.000.229
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	2.564.429.950	2.542.616.186

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n.38 del 3 giugno 2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

“PRES NOVARA EURO 1”

CODICE IMPRESA: 440 CODICE GESTIONE: 00008

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	81.730.362	90.125.749
101 BTP	44.819.269	52.609.581
102 CCT	7.545.802	2.005.818
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	13.048.241	17.685.774
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	16.317.050	17.824.576
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:	4.346.274	4.346.272
201 Azioni quotate in euro	4.346.274	4.346.272
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	86.076.636	94.472.021

“PRES NOVARA EURO 2002”

CODICE IMPRESA: 440 CODICE GESTIONE: 00010

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	20.976.887	22.156.383
101 BTP	8.866.624	13.319.703
102 CCT	3.013.376	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	6.049.430	5.496.067
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	3.047.457	3.340.613
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	20.976.887	22.156.383

“PRES EURO 2004”

CODICE IMPRESA: 440 CODICE GESTIONE: 00011

Categoria di attività	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	19.151.965	25.322.882
101 BTP	7.524.774	8.907.518
102 CCT	4.040.968	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	5.649.625	14.486.488
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	1.936.598	1.928.876
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:	-	301.142
201 Azioni quotate in euro	-	301.142
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	19.151.965	25.624.024

Redatto l'11 gennaio 2017

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
Riserve matematiche	2.548.483.188	2.564.925.134
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	*	*

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
Riserve matematiche	74.342.463	82.320.578
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	*	*

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
Riserve matematiche	15.195.803	21.442.041
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	*	*

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/12/2015)
Riserve matematiche	4.123.395	4.682.329
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

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 70.749.443
101 Interessi su titoli di Stato in euro	56.672.318
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	13.965.885
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	111.240
200 Utili/perdite da realizzi	B 286.803
201 Titoli di Stato in euro	-539.788
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	747.591
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	79.000
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C -
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C 71.036.246
500 Spese di revisione contabile	D 40.309
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 291.262
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 70.704.675
800 Giacenza media delle attività investite	2.582.529.151

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione 2,74%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/02/15 al 31/01/16	3,28%	dal 01/08/15 al 31/07/16	2,81%
dal 01/03/15 al 29/02/16	3,21%	dal 01/09/15 al 31/08/16	2,78%
dal 01/04/15 al 31/03/16	3,11%	dal 01/10/15 al 30/09/16	2,73%
dal 01/05/15 al 30/04/16	3,08%	dal 01/11/15 al 31/10/16	2,72%
dal 01/06/15 al 31/05/16	2,86%	dal 01/12/15 al 30/11/16	2,72%
dal 01/07/15 al 30/06/16	2,78%	dal 01/01/16 al 31/12/16	2,74%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 2.060.638
101 Interessi su titoli di Stato in euro	1.514.078
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	507.575
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	38.985
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 realizzi	B 80.584
201 Titoli di Stato in euro	59.964
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	20.620
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 2.141.222
500 Spese di revisione contabile	D 1.339
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 14.367
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 2.125.516
800 Giacenza media delle attività investite	87.769.872

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione 2,42%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/02/15 al 31/01/16	2,95%	dal 01/08/15 al 31/07/16	2,69%
dal 01/03/15 al 29/02/16	2,83%	dal 01/09/15 al 31/08/16	2,61%
dal 01/04/15 al 31/03/16	2,90%	dal 01/10/15 al 30/09/16	2,59%
dal 01/05/15 al 30/04/16	2,88%	dal 01/11/15 al 31/10/16	2,53%
dal 01/06/15 al 31/05/16	2,87%	dal 01/12/15 al 30/11/16	2,44%
dal 01/07/15 al 30/06/16	2,83%	dal 01/01/16 al 31/12/16	2,42%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 596.782
101 Interessi su titoli di Stato in euro	446.302
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	150.470
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	10
200 Utili/perdite da realizzi	B 67.811
201 Titoli di Stato in euro	35.968
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	31.843
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	-