

PROSPETTI DELLE COMPOSIZIONI DELLE ATTIVITÀ E RENDICONTI ANNUALI DELLE GESTIONI SEPARATE VITA AL 31.10.2014 – IMPORTI IN EURO

GESTIONE FUTURO

CODICE IMPRESA: 440
CODICE GESTIONE: 00002

Categoria di attività	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2014)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2013)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	108.137.553	124.073.259
101 BTP	86.048.848	87.338.860
102 CCT	-	11.661.839
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	13.970.958	22.668.865
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	8.117.747	2.403.695
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	2.475.526
201 Azioni quotate in euro	578.578	2.475.526
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	108.716.131	126.548.785

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.

Redatto il 12 novembre 2014

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2014)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2013)
Riserve matematiche	104.489.663	116.218.930
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

INTEGRAZIONE FUTURO

CODICE IMPRESA: 440
CODICE GESTIONE: 00003

Categoria di attività	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2014)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2013)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	190.363	308.214
101 BTP	165.386	193.310
102 CCT	-	114.904
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	24.977	-
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	190.363	308.214

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.

Redatto il 12 novembre 2014

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2014)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2013)
Riserve matematiche	166.712	172.720
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 3.670.925
101 Interessi su titoli di Stato in euro	3.495.094
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	98.790
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	77.027
106 Dividendi su azioni in valuta	-
107 Redditi degli investimenti immobiliari	-
150 Altre tipologie di proventi	14
di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività	14
200 Utili/perdite da realizzi	B 16.095
201 Titoli di Stato in euro	268.278
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	65.999
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	-318.182
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 3.687.020
500 Spese di revisione contabile	D 1.884
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 18.309
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 3.666.827
800 Giacenza media delle attività investite	111.464.828
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,29%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/12 al 30/11/13	3,21%	dal 01/06/13 al 31/05/14	2,52%
dal 01/01/13 al 31/12/13	3,28%	dal 01/07/13 al 30/06/14	2,65%
dal 01/02/13 al 31/01/14	3,35%	dal 01/08/13 al 31/07/14	2,76%
dal 01/03/13 al 28/02/14	3,36%	dal 01/09/13 al 31/08/14	2,87%
dal 01/04/13 al 31/03/14	3,34%	dal 01/10/13 al 30/09/14	2,88%
dal 01/05/13 al 30/04/14	3,35%	dal 01/11/13 al 31/10/14	3,29%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 6.640
101 Interessi su titoli di Stato in euro	6.640
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 realizzi	B 1.020
201 Titoli di Stato in euro	1.020
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+B 7.660
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C 7.660
500 Spese di revisione contabile	D -
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 77
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 7.583
800 Giacenza media delle attività investite	202.734
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,74%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/12 al 30/11/13	3,25%	dal 01/06/13 al 31/05/14	3,38%
dal 01/01/13 al 31/12/13	3,55%	dal 01/07/13 al 30/06/14	3,55%
dal 01/02/13 al 31/01/14	3,60%	dal 01/08/13 al 31/07/14	3,59%
dal 01/03/13 al 28/02/14	3,26%	dal 01/09/13 al 31/08/14	3,63%
dal 01/04/13 al 31/03/14	3,32%	dal 01/10/13 al 30/09/14	3,68%
dal 01/05/13 al 30/04/14	3,35%	dal 01/11/13 al 31/10/14	3,74%

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