

PROSPETTI DELLE COMPOSIZIONI E RENDICONTI RIEPILOGATIVI DELLE GESTIONI SEPARATE PER IL PERIODO DI OSSERVAZIONE DAL 1.11.2014 AL 31.10.2015 - IMPORTI IN EURO

GESTIONE FUTURO

Categoria di attività	CODICE GESTIONE: 00002	
	CODICE IMPRESA: 440	
	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2015)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2014)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	90.391.910	108.137.553
101 BTP	83.268.400	86.048.848
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	-	13.970.958
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	7.123.510	8.117.747
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	90.970.488	108.716.131

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 2015

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2015)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2014)
Riserve matematiche	87.591.124	104.489.663
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

Categoria di attività	CODICE GESTIONE: 00003	
	CODICE IMPRESA: 440	
	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2015)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2014)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	175.692	190.363
101 BTP	175.692	165.386
102 CCT	-	-
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:	10.000	-
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	-	-
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità	10.000	-
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	185.692	190.363

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 2015

	Alta chiusura del periodo di osservazione (31/10/2015)	Alta chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2014)
Riserve matematiche	179.088	166.712
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 3.399.126
101 Interessi su titoli di Stato in euro	3.216.751
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	169.215
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	13.160
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 110.561
201 Titoli di Stato in euro	111.114
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	-553
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 3.509.687
500 Spese di revisione contabile	D 1.538
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 7.898
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 3.500.251
800 Giacenza media delle attività investite	96.798.958
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,62%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/13 al 30/11/14	3,32%	dal 01/06/14 al 31/05/15	3,39%
dal 01/01/14 al 31/12/14	3,33%	dal 01/07/14 al 30/06/15	3,37%
dal 01/02/14 al 31/01/15	3,33%	dal 01/08/14 al 31/07/15	3,52%
dal 01/03/14 al 28/02/15	3,34%	dal 01/09/14 al 31/08/15	3,55%
dal 01/04/14 al 31/03/15	3,36%	dal 01/10/14 al 30/09/15	3,58%
dal 01/05/14 al 30/04/15	3,39%	dal 01/11/14 al 31/10/15	3,62%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 6.193
101 Interessi su titoli di Stato in euro	6.193
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 13
201 Titoli di Stato in euro	13
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 6.206
500 Spese di revisione contabile	D -
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 11
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 6.195
800 Giacenza media delle attività investite	172.798
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,59%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/13 al 30/11/14	3,82%	dal 01/06/14 al 31/05/15	3,47%
dal 01/01/14 al 31/12/14	3,38%	dal 01/07/14 al 30/06/15	3,50%
dal 01/02/14 al 31/01/15	3,40%	dal 01/08/14 al 31/07/15	3,52%
dal 01/03/14 al 28/02/15	3,41%	dal 01/09/14 al 31/08/15	3,55%
dal 01/04/14 al 31/03/15	3,42%	dal 01/10/14 al 30/09/15	3,58%
dal 01/05/14 al 30/04/15	3,44%	dal 01/11/14 al 31/10/15	3,59%

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