

PROSPETTI DELLE COMPOSIZIONI E RENDICONTI RIEPILOGATIVI DELLE GESTIONI SEPARATE PER IL PERIODO DI OSSERVAZIONE DAL 1.11.2015 AL 31.10.2016 - IMPORTI IN EURO

GESTIONE FUTURO

CODICE IMPRESA: 440
CODICE GESTIONE: 00002

Categoria di attività	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	85.882.196	90.391.910
101 BTP	77.466.435	83.268.400
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	999.962	-
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	7.415.799	7.123.510
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	86.460.774	90.970.488

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	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2016) ²	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2015)
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	191.269	175.692
101 BTP	191.269	175.692
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:	-	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	191.269	185.692

Redatto il 10 novembre 2016

² Gli attivi posti a copertura delle Riserve Matematiche ammontano a Euro 192.416 al 31 ottobre 2016

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2015)
Riserve matematiche	83.052.348	87.591.124
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

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/10/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione preced. (31/10/2015)
Riserve matematiche	192.109	179.088
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 3.296.792
101 Interessi su titoli di Stato in euro	3.113.280
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	168.472
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	-
105 Dividendi su azioni in euro	15.040
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 realizz	B 75.204
201 Titoli di Stato in euro	1.827
202 Titoli di Stato in valuta	-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	73.377
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 3.371.996
500 Spese di revisione contabile	D 1.362
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 4.164
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 3.366.470
800 Giacenza media delle attività investite	88.871.268
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,79%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/14 al 30/11/15	3,63%	dal 01/06/15 al 31/05/16	3,86%
dal 01/01/15 al 31/12/15	3,68%	dal 01/07/15 al 30/06/16	3,88%
dal 01/02/15 al 31/01/16	3,72%	dal 01/08/15 al 31/07/16	3,79%
dal 01/03/15 al 29/02/16	3,78%	dal 01/09/15 al 31/08/16	3,79%
dal 01/04/15 al 31/03/16	3,79%	dal 01/10/15 al 30/09/16	3,78%
dal 01/05/15 al 30/04/16	3,79%	dal 01/11/15 al 31/10/16	3,79%

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	Importi
100 Proventi da investimenti	A 5.795
101 Interessi su titoli di Stato in euro	5.795
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 realizz	B 234
201 Titoli di Stato in euro	234
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 6.029
500 Spese di revisione contabile	D -
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E 69
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E 5.960
800 Giacenza media delle attività investite	182.800
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione	3,26%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione			
Tasso realizzato		Tasso realizzato	
dal 01/12/14 al 30/11/15	3,59%	dal 01/06/15 al 31/05/16	4,41%
dal 01/01/15 al 31/12/15	3,60%	dal 01/07/15 al 30/06/16	4,32%
dal 01/02/15 al 31/01/16	3,62%	dal 01/08/15 al 31/07/16	4,24%
dal 01/03/15 al 29/02/16	3,66%	dal 01/09/15 al 31/08/16	4,31%
dal 01/04/15 al 31/03/16	3,69%	dal 01/10/15 al 30/09/16	3,44%
dal 01/05/15 al 30/04/16	3,72%	dal 01/11/15 al 31/10/16	3,26%

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