

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) A. BILANCIATO GLOBALE**  
**SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2022**

**Allegato 1**

| ATTIVITA'                                                   | Situazione al 31-12-2022 |                       | Situazione a fine esercizio precedente |                       |
|-------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------------|----------------------------------------|-----------------------|
|                                                             | Valore complessivo       | % sul totale attività | Valore complessivo                     | % sul totale attività |
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>                    | <b>63.556.406,60</b>     | <b>99,66</b>          | <b>64.847.690,37</b>                   | <b>99,75</b>          |
| A1. Titoli di debito                                        | 4.120.768,20             | 6,46                  | 10.861.078,80                          | 16,71                 |
| A1.1. Titoli di Stato                                       | 4.120.768,20             | 6,46                  | 10.861.078,80                          | 16,71                 |
| A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili             |                          |                       |                                        |                       |
| A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi          |                          |                       |                                        |                       |
| A2. Titoli azionari                                         |                          |                       |                                        |                       |
| A3. Parti di O.I.C.R.                                       | 59.435.638,40            | 93,20                 | 53.986.611,57                          | 83,04                 |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>                |                          |                       |                                        |                       |
| B1. Titoli di debito                                        |                          |                       |                                        |                       |
| B1.1. Titoli di Stato                                       |                          |                       |                                        |                       |
| B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili              |                          |                       |                                        |                       |
| B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi          |                          |                       |                                        |                       |
| B2. Titoli azionari                                         |                          |                       |                                        |                       |
| B3. Parti di O.I.C.R.                                       |                          |                       |                                        |                       |
| <b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                       |                                        |                       |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                |                          |                       |                                        |                       |
| C1.1. Interest Rate Swap attivi                             |                          |                       |                                        |                       |
| C1.2. Interest Rate Swap passivi                            |                          |                       |                                        |                       |
| C1.3. Opzioni                                               |                          |                       |                                        |                       |
| C1.4. Futures                                               |                          |                       |                                        |                       |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)            |                          |                       |                                        |                       |
| <b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b> |                          |                       |                                        |                       |
| <b>E. DEPOSITI BANCARI</b>                                  | <b>188.675,55</b>        | <b>0,30</b>           | <b>146.018,04</b>                      | <b>0,22</b>           |
| <b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b> |                          |                       |                                        |                       |
| <b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>                        |                          |                       |                                        |                       |
| <b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>                                   | <b>27.710,60</b>         | <b>0,04</b>           | <b>17.801,78</b>                       | <b>0,03</b>           |
| H1. Ratei attivi                                            | 4.827,53                 | 0,01                  |                                        |                       |
| H2. Altri attivi (da specificare)                           | 22.883,07                | 0,04                  | 17.801,78                              | 0,03                  |
| H2.1. Crediti d'imposta                                     |                          |                       |                                        |                       |
| H2.2. Crediti per ritenute                                  |                          |                       |                                        |                       |
| H2.3. Storno credito                                        |                          |                       |                                        |                       |
| H2.4. Altre attività per altri proventi                     | 22.883,07                | 0,04                  | 17.801,78                              | 0,03                  |
| H2.5. Commissioni da retrocessione                          |                          |                       |                                        |                       |
| <b>TOTALE ATTIVITA'</b>                                     | <b>63.772.792,75</b>     | <b>100,00</b>         | <b>65.011.510,19</b>                   | <b>100,00</b>         |

| PASSIVITA' E NETTO                                           | Situazione al 31-12-2022 |               | Situazione a fine esercizio precedente |               |
|--------------------------------------------------------------|--------------------------|---------------|----------------------------------------|---------------|
|                                                              | Valore complessivo       | % sul totale  | Valore                                 | % sul totale  |
| <b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                      |                          |               |                                        |               |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                 |                          |               |                                        |               |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)             |                          |               |                                        |               |
| <b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b> |                          |               |                                        |               |
| <b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>                                   | <b>-84.801,47</b>        | <b>100,00</b> | <b>-80.336,31</b>                      | <b>100,00</b> |
| M1. Ratei passivi                                            |                          |               |                                        |               |
| M2. Spese pubblicazione quota                                |                          |               |                                        |               |
| M3. Spese revisione rendiconto                               | -60,20                   | 0,07          | -60,20                                 | 0,07          |
| M4. Commissione di gestione                                  | -84.741,26               | 99,93         | -80.276,09                             | 99,93         |
| M5. Passività diverse                                        | -0,01                    |               | -0,02                                  |               |
| <b>TOTALE PASSIVITA'</b>                                     | <b>-84.801,47</b>        | <b>100,00</b> | <b>-80.336,31</b>                      | <b>100,00</b> |
| <b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>                    | <b>63.687.991,28</b>     |               | <b>64.931.173,88</b>                   |               |
| Numero delle quote in circolazione                           | 8.272.458,715            |               | 7.444.417,074                          |               |
| Valore unitario delle quote                                  | 7,699                    |               | 8,722                                  |               |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse                         | 791.675,056 | 338.321,748  | 106.782,118   | 41.682,357   |
| Quote rimborsate                     | 120.596,829 | 115.191,046  | 117.765,763   | 96.866,000   |

**Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi**
**Allegato 2**
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) A. BILANCIATO GLOBALE  
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2022**

|                                                               | Rendiconto al 31-12-2022 | Rendiconto esercizio precedente |
|---------------------------------------------------------------|--------------------------|---------------------------------|
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>                                |                          |                                 |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI                                  | 208.267,50               | 78.606,09                       |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito          | 19.556,25                | 56.811,28                       |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari           |                          |                                 |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.                           | 188.711,25               | 21.794,81                       |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI                                 | -918.481,15              | 1.296.204,51                    |
| A2.1. Titoli di debito                                        | -35.863,81               | -7.169,29                       |
| A2.2. Titoli azionari                                         |                          |                                 |
| A2.3. Parti di O.I.C.R.                                       | -882.617,34              | 1.303.373,80                    |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE                                  | -6.397.492,33            | 2.657.678,59                    |
| A3.1. Titoli di debito                                        | -151.125,54              | -6.554,60                       |
| A3.2. Titoli di capitale                                      |                          |                                 |
| A3.3. Parti di O.I.C.R.                                       | -6.246.366,79            | 2.664.233,19                    |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>                | <b>-7.107.705,98</b>     | <b>4.032.489,19</b>             |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                       |                          |                                 |
| B1. RISULTATI REALIZZATI                                      |                          |                                 |
| B1.1. Su strumenti negoziati                                  |                          |                                 |
| B1.2. Su strumenti non negoziati                              |                          |                                 |
| B2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  |                          |                                 |
| B2.1. Su strumenti negoziati                                  |                          |                                 |
| B2.2. Su strumenti non negoziati                              |                          |                                 |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>       |                          |                                 |
| <b>C. INTERESSI ATTIVI</b>                                    |                          |                                 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI                                       |                          |                                 |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI                             |                          |                                 |
| <b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>                      |                          |                                 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI                                      |                          |                                 |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  |                          |                                 |
| <b>E. PROVENTI SU CREDITI</b>                                 |                          |                                 |
| <b>F. ALTRI PROVENTI</b>                                      |                          |                                 |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI |                          |                                 |
| F2. PROVENTI DIVERSI                                          |                          |                                 |
| <b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>          | <b>-7.107.705,98</b>     | <b>4.032.489,19</b>             |
| <b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>     | <b>-7.107,49</b>         | <b>-12.780,67</b>               |
| G1. Bolli, spese e commissioni                                | -7.107,49                | -12.780,67                      |
| <b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>          | <b>-7.114.813,47</b>     | <b>4.019.708,52</b>             |
| <b>H. ONERI DI GESTIONE</b>                                   | <b>-1.127.231,91</b>     | <b>-768.164,16</b>              |
| H1. Commissione di gestione                                   | -1.126.431,16            | -767.399,57                     |
| H2. Spese pubblicazione quota                                 |                          |                                 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia             | -800,75                  | -764,59                         |
| H4. Altri oneri di gestione                                   |                          |                                 |
| <b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>                                | <b>266,09</b>            | <b>-0,14</b>                    |
| I1. Altri ricavi                                              | 266,09                   | 0,00                            |
| I2. Altri costi                                               | 0,00                     | -0,14                           |
| <b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>                 | <b>-8.241.779,29</b>     | <b>3.251.544,22</b>             |

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

|                           |         |                             |       |
|---------------------------|---------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | -11,73% | Volatilità della gestione   | 8,59% |
| Rendimento del benchmark  | -12,21% | Volatilità del benchmark ** | 9,81% |
| Differenza                | 0,48%   | Volatilità dichiarata ***   |       |

\* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

\*\* indicate soltanto in caso di gestione passiva

\*\*\* indicate soltanto in caso di gestione attiva

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

|                           |  |                           |  |
|---------------------------|--|---------------------------|--|
| Rendimento della gestione |  | Volatilità della gestione |  |
|                           |  | Volatilità dichiarata     |  |

\* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark