

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 comparto Obbligazionario Europeo**  
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2018

Allegato 1

| ATTIVITA'   | Situazione al 31-12-2018 |                       | Situazione a fine esercizio precedente |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|   | Valore complessivo       | % sul totale attività | Valore complessivo                     | % sul totale attività |
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>                    | <b>3.425.424,26</b>      | <b>92,69</b>          | <b>3.389.853,14</b>                    | <b>90,67</b>          |
| <b>A1. Titoli di debito</b>                                 | 83.484,00                | 2,26                  |  |                       |
| <b>A1.1. Titoli di Stato</b>                                |                          |                       |  |                       |
| <b>A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili</b>      | 83.484,00                | 2,26                  |  |                       |
| <b>A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi</b>   |                          |                       |  |                       |
| <b>A2. Titoli azionari</b>                                  |                          |                       |  |                       |
| <b>A3. Parti di O.I.C.R.</b>                                | 3.341.940,26             | 90,43                 | 3.389.853,14                           | 90,67                 |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>                |                          |                       |  |                       |
| <b>B1. Titoli di debito</b>                                 |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.1. Titoli di Stato</b>                                |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili</b>       |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi</b>   |                          |                       |  |                       |
| <b>B2. Titoli azionari</b>                                  |                          |                       |  |                       |
| <b>B3. Parti di O.I.C.R.</b>                                |                          |                       |  |                       |
| <b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                       |  |                       |
| <b>C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)</b>         |                          |                       |  |                       |
| <b>C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)</b>     |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.2. Strumenti finanziari derivati</b>                  |                          |                       |  |                       |
| <b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b> |                          |                       |  |                       |
| <b>E. DEPOSITI BANCARI</b>                                  | <b>209.522,23</b>        | <b>5,67</b>           | <b>337.984,34</b>                      | <b>9,04</b>           |
| <b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b> | <b>59.168,87</b>         | <b>1,60</b>           | <b>9.698,67</b>                        | <b>0,26</b>           |
| <b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>                        |                          |                       |  |                       |
| <b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>                                   | <b>1.396,62</b>          | <b>0,04</b>           | <b>1.311,29</b>                        | <b>0,04</b>           |
| <b>H1. Ratei attivi</b>                                     | 349,28                   | 0,01                  |  |                       |
| <b>H2. Altri attivi (da specificare)</b>                    | 1.047,34                 | 0,03                  | 1.311,29                               | 0,04                  |
| <b>H2.1. Crediti d'imposta</b>                              |                          |                       |  |                       |
| <b>H2.2. Crediti per ritenute</b>                           |                          |                       |  |                       |
| <b>H2.3. Commissioni di Retrocessione</b>                   | 1.047,34                 | 0,03                  | 1.311,29                               | 0,04                  |
| <b>TOTALE ATTIVITA'</b>                                     | <b>3.695.511,98</b>      | <b>100,00</b>         | <b>3.738.847,44</b>                    | <b>100,00</b>         |

| PASSIVITA' E NETTO   | Situazione al 31-12-2018 |                     | Situazione a fine esercizio precedente |                     |
|--|--------------------------|---------------------|--|---------------------|
|  | Valore complessivo       | % sul totale        | Valore complessivo                     | % sul totale        |
| <b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                      |                          |                     |  |                     |
| <b>II. Negoziati (da specificare ulteriormente)</b>          |                          |                     |  |                     |
| <b>I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)</b>      |                          |                     |  |                     |
| <b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b> | <b>-1.203,66</b>         | <b>5,11</b>         | <b>-67.130,82</b>                      | <b>78,46</b>        |
| <b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>                                   | <b>-22.348,23</b>        | <b>94,89</b>        | <b>-18.431,09</b>                      | <b>21,54</b>        |
| <b>M1. Ratei passivi</b>                                     |                          |                     |  |                     |
| <b>M2. Spese pubblicazione quota</b>                         |                          |                     |  |                     |
| <b>M3. Spese revisione rendiconto</b>                        |                          |                     |  |                     |
| <b>M4. Commissione di gestione</b>                           | -17.992,83               | 76,40               | -18.431,09                             | 21,54               |
| <b>M5. Passività diverse</b>                                 | -4.355,40                | 18,49               |  |                     |
| <b>TOTALE PASSIVITA'</b>                                     | <b>-23.551,89</b>        | <b>100,00</b>       | <b>-85.561,91</b>                      | <b>100,00</b>       |
| <b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>                    |                          | <b>3.671.960,09</b> |  | <b>3.653.285,53</b> |
| <b>Numero delle quote in circolazione</b>                    |                          | 294.695,634         |  | 287.429,861         |
| <b>Valore unitario delle quote</b>                           |                          | 12,460              |  | 12,710              |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| <b>Quote emesse</b>                  | 10.230,268  | 4.888,956    | 3.737,185     | 7.883,269    |
| <b>Quote rimborsate</b>              | 3.517,965   | 9.978,649    | 4.825,539     | 1.151,752    |

Data: 20-02-2019

Firma:

Sara Vita Spa  
 Presidente  
 Ing. Angelo Sticchi Damiani

Sm

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
 RENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 comparto Obbligazionario Europeo  
 SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2018

Allegato 2

|   | Rendiconto al 31-12-2018 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>                                |                          |                                 |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI                                  | 2.250,11                 |                                 |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito          | 2.250,11                 |                                 |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari           |                          |                                 |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.                           |                          |                                 |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI                                 | -12.510,99               | -13.241,20                      |
| A2.1. Titoli di debito  | -5.321,99                |                                 |
| A2.2. Titoli azionari   |                          |                                 |
| A2.3. Parti di O.I.C.R.                                       | -7.189,00                | -13.241,20                      |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE                                  | 10.924,33                | 19.598,12                       |
| A3.1. Titoli di debito  | 1.134,00                 |                                 |
| A3.2. Titoli di capitale                                      |                          |                                 |
| A3.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 9.790,33                 | 19.598,12                       |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>                | <b>663,45</b>            | <b>6.356,92</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>                                    |                          | <b>252,17</b>                   |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI                                       |                          | 252,17                          |
| 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>663,45</b>            | <b>6.609,09</b>                 |
| <b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>     |                          |                                 |
| G1. Bolli, spese e commissioni                                |                          |                                 |
| <b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>          | <b>663,45</b>            | <b>6.609,09</b>                 |
| <b>H. ONERI DI GESTIONE</b>                                   |                          |                                 |
| H1. Commissione di gestione                                   | -77.365,67               | -77.993,43                      |
| H2. Spese pubblicazione quota                                 | -72.782,45               | -73.250,46                      |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia             | -45,46                   | -225,64                         |
| H4. Altri oneri di gestione                                   | -4.537,76                | -4.517,33                       |
| <b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>                                |                          |                                 |
| I1. Altri ricavi  | 4.470,55                 | 5.204,84                        |
| I2. Altri costi   | -0,15                    | 5.204,84                        |
| <b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>                 | <b>-72.231,67</b>        | <b>-66.179,50</b>               |

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

|                           |       |                             |      |
|---------------------------|-------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | -1,97 | Volatilità della gestione   | 2,87 |
| Rendimento del benchmark  | 1,00  | Volatilità del benchmark ** | 2,89 |
| Differenza                | -2,97 | 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

Data: 20-02-2019

Firma:

Sara Vita Spa  
 Presidente  
 Ing. Angelo Sticchi Damiani

