

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
 RENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 Comparto Azionario Internazionale
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2020

Allegato 1

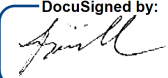
ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2020		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	5.011.918,93	97,03	5.356.127,09	97,88
A1. Titoli di debito				
A1.1. Titoli di Stato				
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari	543.742,80	10,53	102.554,25	1,87
A3. Parti di O.I.C.R.	4.468.176,13	86,51	5.253.572,84	96,01
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI			39.631,20	0,72
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			39.631,20	0,72
B3. Parti di O.I.C.R.				
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
C2.2. Strumenti finanziari derivati				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA'				
E. DEPOSITI BANCARI	129.653,00	2,51	35.698,52	0,65
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	21.640,14	0,42	37.769,68	0,69
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	2.009,71	0,04	2.723,60	0,05
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	2.009,71	0,04	2.723,60	0,05
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni di Retrocessione	2.009,71	0,04	2.723,60	0,05
TOTALE ATTIVITA'	5.165.221,78	100,00	5.471.950,09	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2020		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	-52.002,33	55,21	-19.923,00	38,56
M. ALTRE PASSIVITA'	-42.181,30	44,79	-31.749,61	61,44
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-37.825,90	40,16	-27.394,21	53,01
M5. Passività diverse	-4.355,40	4,62	-4.355,40	8,43
TOTALE PASSIVITA'	-94.183,63	100,00	-51.672,61	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		5.071.038,15		5.420.277,48
Numero delle quote in circolazione		237.628.705		272.059.880
Valore unitario delle quote		21,340		19,923


Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	4.001.141	1.871.355	1.439.543	2.535.453
Quote rimborsate	18.951.024	11.740.327	3.648.509	9.938.807

Data : 26-02-2021

Firma :

 DocuSigned by:

 4CF0A4FCEBB642A...

 DS


 DS


Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 Comparto Azionario Internazionale
 SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2020

Allegato 2

	Rendiconto al 31-12-2020	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	11.028,83	24.217,16
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito		
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	6.546,29	3.243,26
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	4.482,54	20.973,90
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	107.827,85	737.768,99
A2.1. Titoli di debito		
A2.2. Titoli azionari	105.721,17	49.527,07
A2.3. Parti di O.I.C.R.	2.106,68	688.241,92
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	316.316,28	543.404,52
A3.1. Titoli di debito		
A3.2. Titoli di capitale	21.185,67	-481,17
A3.3. Parti di O.I.C.R.	295.130,61	543.885,69
Risultato gestione strumenti finanziari	435.172,96	1.305.390,67
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		
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		
Risultato gestione strumenti finanziari derivati		
C. INTERESSI ATTIVI		
C1. SU DEPOSITI BANCARI		
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	-5.574,96	12.869,96
D1. RISULTATI REALIZZATI	-5.574,96	12.869,96
D2. RISULTATI NON REALIZZATI		
E. PROVENTI SU CREDITI		
F. ALTRI PROVENTI		
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE		
F2. PROVENTI DIVERSI		
Risultato lordo della gestione di portafoglio	429.598,00	1.318.260,63
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO		
G1. Bolli, spese e commissioni		
Risultato netto della gestione di portafoglio	429.598,00	1.318.260,63
H. ONERI DI GESTIONE	-114.509,16	-112.041,86
H1. Commissione di gestione	-109.894,68	-107.547,58
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-20,03	-6,87
H4. Altri oneri di gestione	-4.594,45	-4.487,41
I. ALTRI RICAVI E ONERI	8.872,74	13.800,96
I1. Altri ricavi	8.872,74	13.800,96
I2. Altri costi		
Utile/perdita della gestione del Fondo	323.961,58	1.220.019,73

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	7,11	Volatilità della gestione	25,98
Rendimento del benchmark	4,64	Volatilità del benchmark **	
Differenza	2,47	Volatilità dichiarata ***	25,00

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

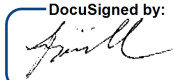
SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
		Volatilità dichiarata	

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Data : 26-02-2021

Firma :

 DocuSigned by:

 4CF0A4FCEBB642A...