

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 Comparto Obbligazionario Europeo**  
 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
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>3.442.758,39</b>	<b>94,78</b>	<b>3.614.915,56</b>	<b>98,38</b>
A1. Titoli di debito	722.542,34	19,89	181.168,85	4,93
A1.1. Titoli di Stato	101.850,00	2,80		
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	620.692,34	17,09	181.168,85	4,93
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.	2.720.216,05	74,89	3.433.746,71	93,45
<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)				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
C2.2. Strumenti finanziari derivati				
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA'</b>				
<b>E. DEPOSITI BANCARI</b>	<b>147.373,11</b>	<b>4,06</b>	<b>27.579,18</b>	<b>0,75</b>
<b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b>	<b>39.724,80</b>	<b>1,09</b>	<b>30.299,79</b>	<b>0,82</b>
<b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>				
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>	<b>2.379,41</b>	<b>0,07</b>	<b>1.664,73</b>	<b>0,05</b>
H1. Ratei attivi	1.269,97	0,03	446,54	0,01
H2. Altri attivi (da specificare)	1.109,44	0,03	1.218,19	0,03
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni di Retrocessione	1.109,44	0,03	1.218,19	0,03
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>3.632.235,71</b>	<b>100,00</b>	<b>3.674.459,26</b>	<b>100,00</b>

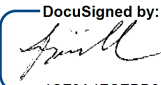
PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2020		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
<b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
<b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b>	<b>-11.873,00</b>	<b>34,59</b>	<b>-25.984,00</b>	<b>53,18</b>
<b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>-22.451,73</b>	<b>65,41</b>	<b>-22.880,19</b>	<b>46,82</b>
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-18.096,33	52,72	-18.524,79	37,91
M5. Passività diverse	-4.355,40	12,69	-4.355,40	8,91
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>-34.324,73</b>	<b>100,00</b>	<b>-48.864,19</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>3.597.910,98</b>		<b>3.625.595,07</b>
<b>Numero delle quote in circolazione</b>		267.828,076		279.050,502
<b>Valore unitario delle quote</b>		13,433		12,992

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	16.658,798	5.093,036	2.645,224	5.804,312
Quote rimborsate	13.459,812	16.650,913	3.618,262	7.694,809

Data : 26-02-2021

Firma :

DocuSigned by:



4CF0A4FCEBB642A...

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

Allegato 2

	Rendiconto al 31-12-2020	Rendiconto esercizio precedente
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	10.896,53	17.029,22
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	9.802,16	10.134,45
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari		
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	1.094,37	6.894,77
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	74.345,54	128.417,56
A2.1. Titoli di debito	63.774,48	3.075,90
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.	10.571,06	125.341,66
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	106.171,44	91.994,58
A3.1. Titoli di debito	7.946,23	391,67
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.	98.225,21	91.602,91
<b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>	<b>191.413,51</b>	<b>237.441,36</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		
F2. PROVENTI DIVERSI		
<b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>	<b>191.413,51</b>	<b>237.441,36</b>
<b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO</b>		
G1. Bolli, spese e commissioni		
<b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>	<b>191.413,51</b>	<b>237.441,36</b>
<b>H. ONERI DI GESTIONE</b>	<b>-77.281,87</b>	<b>-80.272,16</b>
H1. Commissione di gestione	-72.771,53	-75.751,87
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-13,66	-13,04
H4. Altri oneri di gestione	-4.496,68	-4.507,25
<b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>	<b>4.513,98</b>	<b>5.206,97</b>
I1. Altri ricavi	4.513,98	5.206,97
I2. Altri costi		
<b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>	<b>118.645,62</b>	<b>162.376,17</b>

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

Rendimento della gestione	3,39	Volatilità della gestione	5,25
Rendimento del benchmark	5,15	Volatilità del benchmark **	5,20
Differenza	-1,76	Volatilità dichiarata ***	

\* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

\*\* indicate soltanto in caso di gestione passiva

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

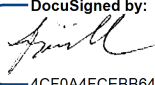
**SEZIONE DI CONFRONTO \***

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
		Volatilità dichiarata	

\* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Data : 26-02-2021

Firma :

 DocuSigned by:  
  
 4CF0A4FCEBB642A...