

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
 ENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 Comparto Obbligazionario Europeo
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2021

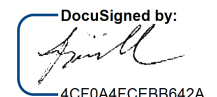
ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2021		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	3.449.413,89	94,78	3.442.758,39	94,78
A1. Titoli di debito	2.846.876,39	78,22	722.542,34	19,89
A1.1. Titoli di Stato	1.993.732,60	54,78	101.850,00	2,80
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	853.143,79	23,44	620.692,34	17,09
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.	602.537,50	16,56	2.720.216,05	74,89
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI				
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.				
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' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	158.987,64	4,37	147.373,11	4,06
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	12.684,99	0,35	39.724,80	1,09
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	18.400,69	0,51	2.379,41	0,07
H1. Ratei attivi	18.155,73	0,50	1.269,97	0,03
H2. Altri attivi (da specificare)	244,96	0,01	1.109,44	0,03
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni di Retrocessione	244,96	0,01	1.109,44	0,03
TOTALE ATTIVITA'	3.639.487,21	100,00	3.632.235,71	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2021		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	-52.818,47	74,49	-16.228,41	47,28
M. ALTRE PASSIVITA'	-18.083,71	25,51	-18.096,32	52,72
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-18.083,71	25,51	-18.096,32	52,72
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'	-70.902,18	100,00	-34.324,73	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		3.568.585,03		3.597.910,98
Numero delle quote in circolazione		276.558,409		267.828,076
Valore unitario delle quote		12,903		13,433

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	8.575,695	10.195,564	4.767,376	10.670,431
Quote rimborsate	7.994,288	1.501,904	4.970,917	11.011,624

Data : 28-02-2022

Firma :

 DocuSigned by:

 4CF0A4FCEBB642A...

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
 ENDICONTO DEL FONDO INTERNO MULTISTRATEGY 2007 Comparto Obbligazionario Europeo
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2021

Allegato 2

	Rendiconto al 31-12-2021	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	36.393,72	10.896,53
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	36.393,72	9.802,16
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari		
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.		1.094,37
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	-31.587,65	74.345,54
A2.1. Titoli di debito	-18.265,35	63.774,48
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-13.322,30	10.571,06
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	-73.213,12	106.171,44
A3.1. Titoli di debito	-49.133,12	7.946,23
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.	-24.080,00	98.225,21
Risultato gestione strumenti finanziari	-68.407,05	191.413,51
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		
D1. RISULTATI REALIZZATI		
D2. RISULTATI NON REALIZZATI		
E. PROVENTI SU CREDITI		
F. ALTRI PROVENTI		
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI		
Risultato lordo della gestione di portafoglio	-68.407,05	191.413,51
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-840,09	
G1. Bolli, spese e commissioni	-840,09	
Risultato netto della gestione di portafoglio	-69.247,14	191.413,51
H. ONERI DI GESTIONE	-76.263,03	-77.281,87
H1. Commissione di gestione	-71.695,34	-72.771,53
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-14,16	-13,66
H4. Altri oneri di gestione	-4.553,53	-4.496,68
I. ALTRI RICAVI E ONERI	1.151,35	4.513,98
I1. Altri ricavi	1.151,35	4.513,98
I2. Altri costi		
Utile/perdita della gestione del Fondo	-144.358,82	118.645,62

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	-3,95	Volatilità della gestione	2,96
Rendimento del benchmark	-3,54	Volatilità del benchmark **	3,46
Differenza	-0,41	Volatilità dichiarata ***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

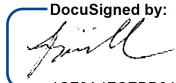
SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
		Volatilità dichiarata	

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Data : 28-02-2022

Firma :

 DocuSigned by:

 4CF0A4FCEBB642A...