

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO GENERTELLIFE SELECT DINAMICO

SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2023

| ATTIVITÀ  | Situazione al 31/12/2023 |                       | Situazione a fine esercizio precedente |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|   | Valore complessivo       | % sul totale attività | Valore complessivo                     | % sul totale attività |
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>                    | <b>10.017.984,00</b>     | <b>97,88</b>          | <b>12.011.950,98</b>                   | <b>77,23</b>          |
| 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   |                          |                       |  |                       |
| A3. Parti di O.I.C.R.                                       | 10.017.984,00            | 97,88                 | 12.011.950,98                          | 77,23                 |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>                |                          |                       | <b>2.290.829,51</b>                    | <b>14,73</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.                                       |                          |                       | 2.290.829,51                           | 14,73                 |
| <b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     | <b>7.689,36</b>          | <b>0,08</b>           |  |                       |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                | 7.689,36                 | 0,08                  |  |                       |
| C1.1. Future (negoziati)                                    | 7.689,36                 | 0,08                  |  |                       |
| C1.2. Warrants / Diritti                                    |                          |                       |  |                       |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)            |                          |                       |  |                       |
| C2.1. da definire   |                          |                       |  |                       |
| C2.2. da definire   |                          |                       |  |                       |
| C2.3. Opzioni (non negoziate)                               |                          |                       |  |                       |
| C2.4. DCS (non negoziate)                                   |                          |                       |  |                       |
| C2.5. da definire   |                          |                       |  |                       |
| C2.6. da definire   |                          |                       |  |                       |
| C2.7. Swap su valute (non negoziati)                        |                          |                       |  |                       |
| C2.8. Swap su tassi (non negoziati)                         |                          |                       |  |                       |
| C2.9. Strumenti finanziari derivati (Index)                 |                          |                       |  |                       |
| <b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE</b>  |                          |                       |  |                       |
| <b>E. DEPOSITI BANCARI</b>                                  | <b>206.066,59</b>        | <b>2,01</b>           | <b>1.252.869,48</b>                    | <b>8,06</b>           |
| <b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b> | <b>-2.353,25</b>         | <b>-0,02</b>          | <b>-3.603,12</b>                       | <b>-0,02</b>          |
| <b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>                        |                          |                       |  |                       |
| <b>H. ALTRE ATTIVITÀ</b>                                    | <b>5.860,33</b>          | <b>0,06</b>           | <b>1.558,29</b>                        | <b>0,01</b>           |
| H1. Ratei attivi  |                          |                       |  |                       |
| H2. Altri attivi (da specificare)                           | 5.860,33                 | 0,06                  | 1.558,29                               | 0,01                  |
| H2.1. Crediti d'imposta                                     |                          |                       |  |                       |
| H2.2. Crediti per ritenute                                  | 5.860,33                 | 0,06                  | 1.558,29                               | 0,01                  |
| H2.3. Retrocessione commissioni                             |                          |                       |  |                       |
| <b>TOTALE ATTIVITÀ</b>                                      | <b>10.235.247,03</b>     | <b>100,00</b>         | <b>15.553.605,14</b>                   | <b>100,00</b>         |

| PASSIVITÀ E NETTO   | Situazione al 31/12/2023 |                        | Situazione a fine esercizio precedente |                        |
|---|--------------------------|------------------------|--|------------------------|
|   | Valore complessivo       | % sul totale passività | Valore complessivo                     | % sul totale passività |
| <b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                        |  |                        |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                |                          |                        |  |                        |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)            |                          |                        |  |                        |
| <b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE</b> | <b>-3.352,62</b>         | <b>30,11</b>           | <b>0,00</b>                            |                        |
| <b>M. ALTRE PASSIVITÀ</b>                                   | <b>-7.782,37</b>         | <b>69,89</b>           | <b>-8.320,31</b>                       | <b>100,00</b>          |
| M1. Ratei passivi   |                          |                        | 0,00                                   |                        |
| M2. Spese pubblicazione quota                               |                          |                        |  |                        |
| M3. Spese revisione rendiconto                              | -5.764,50                | 51,77                  | -5.764,50                              | 69,28                  |
| M4. Commissione di gestione                                 | -2.017,87                | 18,12                  | -2.555,81                              | 30,72                  |
| M5. Passività diverse                                       |                          |                        |  |                        |
| <b>TOTALE PASSIVITÀ</b>                                     | <b>-11.134,99</b>        | <b>100,00</b>          | <b>-8.320,31</b>                       | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>                   |                          | <b>10.224.112,04</b>   |  | <b>15.545.284,83</b>   |
| Numero delle quote in circolazione                          |                          | 1.027.861,141          |  | 1.743.842,958          |
| Valore unitario delle quote                                 |                          | 9,948                  |  | 8,915                  |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse                         | 0,001       | 35.126,002   | 9.084,571     |              |
| Quote rimborsate                     | 217.265,376 | 65.157,267   | 160.021,707   | 317.748,041  |

29/02/2024



Genertel life S.p.A.

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO GENERTELLIFE SELECT DINAMICO

SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2023

|   | Rendiconto al 31/12/2023 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>                                |                          |                                 |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI                                  | 80.544,26                | 49.971,23                       |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito          |                          |                                 |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari           |                          |                                 |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.                           | 80.544,26                | 49.971,23                       |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI                                 | 509.564,68               | -387.113,33                     |
| A2.1. Titoli di debito  |                          |                                 |
| A2.2. Titoli azionari   |                          |                                 |
| A2.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 509.564,68               | -387.113,33                     |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE                                  | 1.066.063,66             | -1.777.670,90                   |
| A3.1. Titoli di debito  |                          |                                 |
| A3.2. Titoli di capitale                                      |                          |                                 |
| A3.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 1.066.063,66             | -1.777.670,90                   |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>                | <b>1.656.172,60</b>      | <b>-2.114.813,00</b>            |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                       |                          |                                 |
| B1. RISULTATI REALIZZATI                                      | -1.527,27                |                                 |
| B1.1. Su strumenti negoziati                                  | -1.527,27                |                                 |
| B1.2. Su strumenti non negoziati                              |                          |                                 |
| B2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  | 7.689,36                 |                                 |
| B2.1. Su strumenti negoziati                                  | 7.689,36                 |                                 |
| B2.2. Su strumenti non negoziati                              |                          |                                 |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>       | <b>6.162,09</b>          |                                 |
| <b>C. INTERESSI ATTIVI</b>                                    | <b>16.614,05</b>         | <b>5.925,89</b>                 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI                                       | 16.614,05                | 5.925,89                        |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI                             |                          |                                 |
| <b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>                      | <b>-70.775,97</b>        | <b>208.346,87</b>               |
| D1. RISULTATI REALIZZATI                                      |                          |                                 |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  | -70.775,97               | 208.346,87                      |
| <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>1.608.172,77</b>      | <b>-1.900.540,24</b>            |
| <b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>     | <b>-2.032,77</b>         | <b>-2.044,18</b>                |
| G1. Bolli, spese e commissioni                                | -2.032,77                | -2.044,18                       |
| <b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>          | <b>1.606.140,00</b>      | <b>-1.902.584,42</b>            |
| <b>H. ONERI DI GESTIONE</b>                                   | <b>-171.014,53</b>       | <b>-179.207,86</b>              |
| H1. Commissione di gestione                                   | -164.078,86              | -167.854,49                     |
| H2. Spese pubblicazione quota                                 |                          |                                 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia             | -6.924,98                | -6.901,41                       |
| H4. Altri oneri di gestione                                   | -10,69                   | -4.451,96                       |
| <b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>                                | <b>61,28</b>             | <b>-1.911,35</b>                |
| I1. Altri ricavi  | 61,83                    | 13,99                           |
| I2. Altri costi   | -0,55                    | -1.925,34                       |
| <b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>                 | <b>1.435.186,75</b>      | <b>-2.083.703,63</b>            |

SEZIONE DI CONFRONTO \*

|                           |       |                             |       |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 11,59 | Volatilità della gestione   | 6,08  |
| Rendimento del benchmark  | 13,19 | Volatilità del benchmark ** | 6,19  |
| Differenza                | -1,60 | Volatilità dichiarata ***   | -0,11 |

\* Per le imprese che hanno adottato un benchmark \*\* indicare soltanto in caso di gestione passiva

\*\*\* indicare 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

29/02/2024



Genertel life S.p.A.