

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO STRATEGIC MODEL PORTFOLIO

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 |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 90.466.524,05 | 68,23 | 112.044.660,28 | 82,78 |
| 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. | 90.466.524,05 | 68,23 | 112.044.660,28 | 82,78 |
| B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI | 41.259.322,43 | 31,12 | 22.343.158,38 | 16,51 |
| 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. | 41.259.322,43 | 31,12 | 22.343.158,38 | 16,51 |
| C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| C1.1. Future (negoziati) | | | | |
| 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) | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 764.007,27 | 0,58 | 333.005,02 | 0,25 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 77.470,50 | 0,06 | 630.600,15 | 0,47 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | 16.877,98 | 0,01 | 7.147,78 | 0,01 |
| H1. Ratei attivi | 0,00 | | 0,00 | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 16.877,98 | 0,01 | 7.147,78 | 0,01 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | 16.877,98 | 0,01 | 7.147,78 | 0,01 |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 132.584.202,23 | 100,00 | 135.358.571,61 | 100,00 |

| PASSIVITÀ E NETTO | Situazione al 31/12/2023 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|------------------------|--|------------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale passività | Valore complessivo | % sul totale passività |
| I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE | -1.214.644,05 | 95,79 | -791.899,94 | 94,37 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -53.442,93 | 4,21 | -47.255,85 | 5,63 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | -33.947,00 | 2,68 | -33.947,00 | 4,05 |
| M4. Commissione di gestione | -19.495,93 | 1,54 | -13.308,85 | 1,59 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -1.268.086,98 | 100,00 | -839.155,79 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 131.316.115,25 | | 134.519.415,82 |
| Numero delle quote in circolazione | | 9.966.640,954 | | 11.266.719,973 |
| Valore unitario delle quote | | 13,176 | | 11,940 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 138.823,236 | 51.169,595 | 40.835,529 | 36.181,255 |
| Quote rimborsate | 380.525,475 | 343.255,497 | 298.758,648 | 544.549,015 |

29/02/2024



Genertel life S.p.A.

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO STRATEGIC MODEL PORTFOLIO

SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2023

| | Rendiconto al 31/12/2023 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 4.941,88 | 121.486,74 |
| 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. | 4.941,88 | 121.486,74 |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 3.135.147,42 | -2.582.074,64 |
| A2.1. Titoli di debito | | |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 3.135.147,42 | -2.582.074,64 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 12.524.987,89 | -16.842.205,61 |
| A3.1. Titoli di debito | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 12.524.987,89 | -16.842.205,61 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 15.665.077,19 | -19.302.793,51 |
| 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 | 38.449,20 | 4.531,15 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 38.449,20 | 4.531,15 |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | -605,22 | 2.164,04 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | -605,22 | 2.164,04 |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | |
| F. ALTRI PROVENTI | | 131,52 |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | | 131,52 |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | 15.702.921,17 | -19.295.966,80 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -32.925,06 | -56.244,86 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -32.925,06 | -56.244,86 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 15.669.996,11 | -19.352.211,66 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -2.467.686,30 | -2.704.068,65 |
| H1. Commissione di gestione | -2.432.535,57 | -2.667.241,20 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -33.947,00 | -33.947,00 |
| H4. Altri oneri di gestione | -1.203,73 | -2.880,45 |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 1.293,37 | 2.525,45 |
| I1. Altri ricavi | 1.293,40 | 2.525,45 |
| I2. Altri costi | -0,03 | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 13.203.603,18 | -22.053.754,86 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|--|-----------------------------|--|
| Rendimento della gestione | | Volatilità della gestione | |
| Rendimento del benchmark | | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | | Volatilità dichiarata *** | |

* 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 | 10,35 | Volatilità della gestione | 8,23 |
| | | Volatilità dichiarata | |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

29/02/2024

