

RENDICONTO RIEPILOGATIVO E PROSPETTO ANNUALE DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **NUOVO AURIS**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL **01/01/2015** AL **31/12/2015**

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **006**
RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività		Importi
100 Proventi da investimenti	A	36.822.943
101 Interessi su titoli di Stato in euro		22.780.869
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		10.651.367
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		209.641
105 Dividendi su azioni in euro		2.578.886
106 Dividendi su azioni in valuta		240.425
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		361.756
		361.756
200 Utili/perdite da realizzo	B	538.905
201 Titoli di Stato in euro		-47.769
202 Titoli di Stato in valuta		-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		262.549
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro		-
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta		-
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta		-
207 Titoli azionari quotati in euro		-59.337
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		97.401
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		275.205
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		10.855
		10.855
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	771
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	37.362.618
500 Spese di revisione contabile	D	4.242
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	107.003
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	37.251.373
800 Giacenza media delle attività investite		795.564.082

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,68%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/14 al 31/01/15	4,68%
dal 01/03/14 al 28/02/15	4,67%
dal 01/04/14 al 31/03/15	4,69%
dal 01/05/14 al 30/04/15	4,81%
dal 01/06/14 al 31/05/15	4,83%
dal 01/07/14 al 30/06/15	4,84%
dal 01/08/14 al 31/07/15	4,95%
dal 01/09/14 al 31/08/15	4,96%
dal 01/10/14 al 30/09/15	4,75%
dal 01/11/14 al 31/10/15	4,70%
dal 01/12/14 al 30/11/15	4,68%
dal 01/01/15 al 31/12/15	4,68%

Redatto il, 04/02/2016

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2015	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2014
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	949.623.851	662.662.461
101 BTP	457.817.946	406.835.877
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	243.511.485	54.626.662
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	241.150.448	194.962.016
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	5.016.235	4.110.169
108 Obbligazioni non quotate in valuta	2.127.737	2.127.737
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	48.481.161	52.887.030
201 Azioni quotate in euro	44.601.607	42.794.702
202 Azioni non quotate in euro	1.596.017	1.596.017
203 Azioni quotate in valuta	1.138.381	7.351.155
204 Azioni non quotate in valuta	1.145.156	1.145.156
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	20.131.696	45.293.964
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	11.867.802	36.892.719
304 Strumenti derivati	127.121	127.121
305 Liquidità*	2.136.773	274.124
350 Altre tipologie di attività di cui: 351 Pronti contro termine	6.000.000	8.000.000
	-	-
352 Crediti d'imposta	6.000.000	8.000.000
353 Crediti verso riassicuratori	-	-
354 Retrocessione di commissioni	-	-
355 Crediti verso assicurati	-	-
400 Passività patrimoniali:		
401 Debiti per spese di revisione contabile	-	-
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività	-	-
1000 Saldo attività della gestione separata	1.018.236.708	760.843.455

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2015	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2014
Riserve matematiche	999.606.687	746.850.638
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38/2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

(*) non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

Redatto il, 04/02/2016

Il rappresentante legale dell'impresa

RENDICONTO RIEPILOGATIVO E PROSPETTO ANNUALE DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **PREVIDENZA CONCRETA**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL **01/01/2015** AL **31/12/2015**

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **001**
RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività		Importi
100 Proventi da investimenti	A	8.826.700
101 Interessi su titoli di Stato in euro		4.509.306
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		216.477
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		3.555.802
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		-
105 Dividendi su azioni in euro		298.495
106 Dividendi su azioni in valuta		61.978
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		184.643
		184.643
200 Utili/perdite da realizzo	B	-790.710
201 Titoli di Stato in euro		-147
202 Titoli di Stato in valuta		-143.598
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		5.038
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro		-
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta		-
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta		-
207 Titoli azionari quotati in euro		15.557
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		161.972
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		-829.532
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		-
		-
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	8.035.990
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	19.881
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	8.016.109
800 Giacenza media delle attività investite		194.922.936

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,11%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/14 al 31/01/15	4,83%
dal 01/03/14 al 28/02/15	4,82%
dal 01/04/14 al 31/03/15	4,81%
dal 01/05/14 al 30/04/15	4,84%
dal 01/06/14 al 31/05/15	4,82%
dal 01/07/14 al 30/06/15	4,66%
dal 01/08/14 al 31/07/15	4,64%
dal 01/09/14 al 31/08/15	4,62%
dal 01/10/14 al 30/09/15	4,08%
dal 01/11/14 al 31/10/15	4,08%
dal 01/12/14 al 30/11/15	4,15%
dal 01/01/15 al 31/12/15	4,11%

Redatto il, 04/02/2016

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2015	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2014
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	189.710.250	169.041.389
101 BTP	80.786.811	80.238.429
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	13.380.268	9.788.663
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	4.836.828	4.834.402
105 Obbligazioni quotate in euro	90.406.420	73.879.975
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	299.923	299.920
108 Obbligazioni non quotate in valuta	-	-
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	8.616.340	8.810.887
201 Azioni quotate in euro	8.616.340	7.007.671
202 Azioni non quotate in euro	-	-
203 Azioni quotate in valuta	-	1.803.216
204 Azioni non quotate in valuta	-	-
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	6.910.896	11.179.332
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	4.862.030	5.005.109
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità*	2.048.866	6.174.223
350 Altre tipologie di attività di cui: 351 Pronti contro termine	-	-
	-	-
352 Crediti d'imposta	-	-
353 Crediti verso riassicuratori	-	-
354 Retrocessione di commissioni	-	-
355 Crediti verso assicurati	-	-
400 Passività patrimoniali:		
401 Debiti per spese di revisione contabile	-	-
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività	-	-
1000 Saldo attività della gestione separata	205.237.486	189.031.608

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2015	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2014
Riserve matematiche	203.983.695	183.948.255
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38/2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

(*) non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

Redatto il, 04/02/2016

Il rappresentante legale dell'impresa

