

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

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **Ri.ALTO**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL **01/11/2014** AL **31/10/2015**

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **003**
RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

| Proventi ed oneri distinti per categorie di attività | | Importi |
|---|------------------|----------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 397.109.607 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 203.861.101 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | 2.372.877 |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | 119.153.709 |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | 2.220.534 |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 18.675.442 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | 2.625.006 |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | - |
| 150 Altre tipologie di proventi | | 48.200.939 |
| di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | 48.200.939 |
| 200 Utili/perdite da realzi | B | -17.495.842 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | 377.260 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | -1.406.778 |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | -8.365.345 |
| 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 | | 4.128.642 |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | - |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | -1.997.064 |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | - |
| 211 Immobili | | - |
| 212 Cambi | | -10.979.886 |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite | | 747.330 |
| di cui: 251 Altre attività finanziarie | | 747.330 |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | 144.280 |
| 400 Risultato finanziario lordo | A+B+C | 379.758.046 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 11.846 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 3.508.668 |
| 700 Risultato finanziario netto | A+B+C-D-E | 376.237.532 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 9.887.362.479 |

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **3,81%**

Redatto il 04/12/2015

Il rappresentante legale dell'impresa


PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

| | Alla chiusura del periodo di osservazione 31/10/2015 | Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/10/2014 |
|--|---|--|
| | Importi da libro mastro ¹ | Importi da libro mastro ¹ |
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 9.249.262.643 | 6.811.601.536 |
| 101 BTP | 3.957.487.312 | 3.441.657.072 |
| 102 CCT | - | - |
| 103 Altri titoli di Stato emessi in euro | 1.565.575.288 | 956.789.951 |
| 104 Altri titoli di Stato emessi in valuta | 72.471.491 | 53.368.737 |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | 3.535.784.918 | 2.284.285.475 |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | 50.929.990 | 30.059.089 |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | 67.013.644 | 45.441.212 |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | - | - |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | - | - |
| 200 Titoli di capitale: | 423.455.595 | 415.508.137 |
| 201 Azioni quotate in euro | 271.111.293 | 260.812.105 |
| 202 Azioni non quotate in euro | 110.046.650 | 110.046.650 |
| 203 Azioni quotate in valuta | 42.297.652 | 44.649.382 |
| 204 Azioni non quotate in valuta | - | - |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | - | - |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 1.572.525.010 | 1.438.616.000 |
| 301 Immobili | - | - |
| 302 Prestiti | - | - |
| 303 Quote di OICR | 1.225.807.440 | 1.314.420.316 |
| 304 Strumenti derivati | 2.267.646 | 2.267.646 |
| 305 Liquidità | 249.449.924 | 31.928.038 |
| 350 Altre tipologie di attività | 95.000.000 | 90.000.000 |
| di cui: 351 Pronti contro termine | - | - |
| 352 Crediti d'imposta | 95.000.000 | 90.000.000 |
| 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 | 11.245.243.248 | 8.665.725.673 |

valori in euro

| | Alla chiusura del periodo di osservazione 31/10/2015 | Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/10/2014 |
|---|---|--|
| Riserve matematiche | 11.215.761.353 | 8.578.573.630 |
| 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 04/12/2015

Il rappresentante legale dell'impresa


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

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **Ri.ALTO \$**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL **01/11/2014** AL **31/10/2015**

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **009**

(cambio in euro alla data di fine periodo 1,104650)

RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

| Proventi ed oneri distinti per categorie di attività | | Importi |
|---|------------------|--------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 20.997.969 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | - |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | 9.889.924 |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | - |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | 8.368.252 |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | - |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | - |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | - |
| 150 Altre tipologie di proventi | | 2.739.794 |
| di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | 2.739.794 |
| 200 Utili/perdite da realzi | B | -2.040.845 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | - |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | 1.204.128 |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | - |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | - |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | -1.481.612 |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | - |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | - |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | - |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | - |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | - |
| 211 Immobili | | - |
| 212 Cambi | | -1.763.531 |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite | | 170 |
| di cui: 251 Altre attività finanziarie | | 170 |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | 82.766 |
| 400 Risultato finanziario lordo | A+B+C | 19.039.891 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 4.242 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | - |
| 700 Risultato finanziario netto | A+B+C-D-E | 19.035.649 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 539.410.124 |

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **3,53%**

Redatto il 04/12/2015

Il rappresentante legale dell'impresa


PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

| | Alla chiusura del periodo di osservazione 31/10/2015 | Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/10/2014 |
|--|---|--|
| | Importi da libro mastro ¹ | Importi da libro mastro ¹ |
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 437.462.946 | 440.091.397 |
| 101 BTP | - | - |
| 102 CCT | - | - |
| 103 Altri titoli di Stato emessi in euro | - | - |
| 104 Altri titoli di Stato emessi in valuta | 214.840.396 | 256.276.340 |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | - | - |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | 222.622.550 | 171.953.874 |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | - | - |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | - | 11.861.183 |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | - | - |
| 200 Titoli di capitale: | - | - |
| 201 Azioni quotate in euro | - | - |
| 202 Azioni non quotate in euro | - | - |
| 203 Azioni quotate in valuta | - | - |
| 204 Azioni non quotate in valuta | - | - |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | - | - |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 69.888.080 | 61.300.025 |
| 301 Immobili | - | - |
| 302 Prestiti | - | - |
| 303 Quote di OICR | 69.714.594 | 60.128.785 |
| 304 Strumenti derivati | - | - |
| 305 Liquidità | 173.486 | 1.171.240 |
| 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 | 507.351.026 | 501.391.422 |

valori in euro

| | Alla chiusura del periodo di osservazione 31/10/2015 | Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/10/2014 |
|---|---|--|
| Riserve matematiche | 477.467.799 | 484.440.848 |
| 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 04/12/2015

Il rappresentante legale dell'impresa

