

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG 2011-2031

SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2016

| ATTIVITÀ | Situazione al 31/12/2016 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 7.609.862,23 | 99,15 | 8.467.475,65 | 98,36 |
| A1. Titoli di debito | 6.152.631,02 | 80,17 | 6.773.742,38 | 78,69 |
| A1.1. Titoli di Stato | 6.152.631,02 | 80,17 | 6.773.742,38 | 78,69 |
| 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. | 1.457.231,21 | 18,99 | 1.693.733,27 | 19,68 |
| 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) | | | | |
| 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 | 0,01 | 0,00 | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 54.293,06 | 0,71 | 41.490,93 | 0,48 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 10.584,48 | 0,14 | 99.558,13 | 1,16 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | 18,09 | 0,00 | 1,00 | 0,00 |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 18,09 | 0,00 | 1,00 | 0,00 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | 18,09 | 0,00 | 1,00 | 0,00 |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 7.674.757,87 | 100,00 | 8.608.525,71 | 100,00 |

| PASSIVITÀ E NETTO | Situazione al 31/12/2016 | | 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 | | | -3.963,60 | 20,44 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -9.672,92 | 100,00 | -15.431,30 | 79,56 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | 9,34 | -903,00 | 4,66 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -4.114,00 | 42,53 | -10.537,00 | 54,33 |
| M4. Commissione di gestione | -4.655,92 | 48,13 | -3.991,30 | 20,58 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -9.672,92 | 100,00 | -19.394,90 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 7.665.084,95 | | 8.589.130,81 |
| Numero delle quote in circolazione | | 517.276,248 | | 574.408,534 |
| Valore unitario delle quote | | 14,818 | | 14,953 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 21.800,461 | 5.813,819 | 12.656,701 | 5.879,440 |
| Quote rimborsate | 49.172,205 | 13.123,072 | 29.582,228 | 11.405,202 |

28/02/2017



generetelife spa - sede legale e direzione generale via ferretto, 1 - 31021 mogliano veneto (tv) - tel. 041/5939704
 capitale sociale € 168.200.000,00 int. vers. - iscritta all'albo imprese isvap n. 1.00141 - codice fiscale e registro
 imprese treviso 00979820321 - partita iva 06515871009 - c.p. 51 - 31021 mogliano veneto (tv) p.t. società
 unipersonale appartenente al gruppo generali, iscritto all'albo dei gruppi assicurativi al numero 026, e soggetta alla
 direzione ed al coordinamento di assicurazioni generali spa - generetelife@generetelife.it - www.generetelife.it



RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG 2011-2031

SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2016

| | Rendiconto al 31/12/2016 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 680,13 | 1.565,99 |
| 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. | 680,13 | 1.565,99 |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 206.336,54 | 424.342,29 |
| A2.1. Titoli di debito | 196.808,83 | 281.574,84 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 9.527,71 | 142.767,45 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | -44.652,16 | 435.876,76 |
| A3.1. Titoli di debito | -115.885,83 | 458.332,73 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 71.233,67 | -22.455,97 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 162.364,51 | 861.785,04 |
| 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 | 69,57 | |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 69,57 | |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | 5.810,96 | 97.565,74 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | 5.810,96 | 97.565,74 |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | |
| F. ALTRI PROVENTI | | 10,45 |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | | 10,45 |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | 168.245,04 | 959.361,23 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -72,55 | -136,07 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -72,55 | -136,07 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 168.172,49 | 959.225,16 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -209.663,51 | -231.815,15 |
| H1. Commissione di gestione | -203.068,37 | -219.375,91 |
| H2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | -903,00 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -5.681,26 | -11.506,86 |
| H4. Altri oneri di gestione | -10,88 | -29,38 |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 1,27 | -358,56 |
| I1. Altri ricavi | 1,27 | 1,75 |
| I2. Altri costi | | -360,31 |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | -41.489,75 | 727.051,45 |

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 | -0,90 | Volatilità della gestione | 11,71 |
| | | Volatilità dichiarata | |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

28/02/2017



generaltelife spa - sede legale e direzione generale via ferretto, 1 - 31021 mogliano veneto (tv) - tel. 041 5939701
 capitale sociale € 168.200.000,00 int. vers. - iscritta all'albo imprese isvap n. 1.00141 - codice fiscale e registro
 imprese treviso 00979820321 - partita iva 06515871009 - c.p. 51 - 31021 mogliano veneto (tv) p.t. - società
 unipersonale appartenente al gruppo generali, iscritto all'albo dei gruppi assicurativi al numero 026, e soggetta alla
 direzione ed al coordinamento di assicurazioni generali spa - generaltelife@generaltelife.it - www.generaltelife.it

Generaltelife S.p.A.
