

**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG A 2023**
**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 |
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>                    | <b>43.055.450,94</b>     | <b>99,45</b>          | <b>49.414.178,29</b>                   | <b>99,20</b>          |
| <b>A1. Titoli di debito</b>                                 | 42.624.455,18            | 98,45                 | 48.463.638,41                          | 97,29                 |
| <b>A1.1. Titoli di Stato</b>                                | 42.624.455,18            | 98,45                 | 48.463.638,41                          | 97,29                 |
| <b>A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili</b>      |                          |                       |  |                       |
| <b>A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi</b>   |                          |                       |  |                       |
| <b>A2. Titoli azionari</b>                                  |                          |                       |  |                       |
| <b>A3. Parti di O.I.C.R.</b>                                | 430.995,76               | 1,00                  | 950.539,88                             | 1,91                  |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>                |                          |                       |  |                       |
| <b>B1. Titoli di debito</b>                                 |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.1. Titoli di Stato</b>                                |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili</b>       |                          |                       |  |                       |
| <b>B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi</b>   |                          |                       |  |                       |
| <b>B2. Titoli azionari</b>                                  |                          |                       |  |                       |
| <b>B3. Parti di O.I.C.R.</b>                                |                          |                       |  |                       |
| <b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                       |  |                       |
| <b>C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)</b>         |                          |                       |  |                       |
| <b>C1.1. Future (negoziati)</b>                             |                          |                       |  |                       |
| <b>C1.2. Warrants / Diritti</b>                             |                          |                       |  |                       |
| <b>C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)</b>     |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.1. da definire</b>                                    |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.2. da definire</b>                                    |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.3. Opzioni (non negoziate)</b>                        |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.4. DCS (non negoziate)</b>                            |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.5. da definire</b>                                    |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.6. da definire</b>                                    |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.7. Swap su valute (non negoziati)</b>                 |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.8. Swap su tassi (non negoziati)</b>                  |                          |                       |  |                       |
| <b>C2.9. Strumenti finanziari derivati (Index)</b>          |                          |                       |  |                       |
| <b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE</b>  |                          |                       | <b>8.408,37</b>                        | <b>0,02</b>           |
| <b>E. DEPOSITI BANCARI</b>                                  | <b>190.806,51</b>        | <b>0,44</b>           | <b>337.776,19</b>                      | <b>0,68</b>           |
| <b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b> | <b>48.523,24</b>         | <b>0,11</b>           | <b>51.710,19</b>                       | <b>0,10</b>           |
| <b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>                        |                          |                       |  |                       |
| <b>H. ALTRE ATTIVITÀ</b>                                    | <b>55,88</b>             | <b>0,00</b>           | <b>41,16</b>                           | <b>0,00</b>           |
| <b>H1. Ratei attivi</b>                                     |                          |                       |  |                       |
| <b>H2. Altri attivi (da specificare)</b>                    | 55,88                    | 0,00                  | 41,16                                  | 0,00                  |
| <b>H2.1. Crediti d'imposta</b>                              |                          |                       |  |                       |
| <b>H2.2. Crediti per ritenute</b>                           | 55,88                    | 0,00                  | 41,16                                  | 0,00                  |
| <b>H2.3. Retrocessione commissioni</b>                      |                          |                       |  |                       |
| <b>TOTALE ATTIVITÀ</b>                                      | <b>43.294.836,57</b>     | <b>100,00</b>         | <b>49.812.114,20</b>                   | <b>100,00</b>         |

| PASSIVITÀ E NETTO   | Situazione al 31/12/2016 |                        | Situazione a fine esercizio precedente |                        |
|---|--------------------------|------------------------|--|------------------------|
|   | Valore complessivo       | % sul totale passività | Valore complessivo                     | % sul totale passività |
| <b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                        |  |                        |
| <b>I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)</b>         |                          |                        |  |                        |
| <b>I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)</b>     |                          |                        |  |                        |
| <b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE</b> | <b>-62.372,84</b>        | <b>52,55</b>           | <b>-201.539,27</b>                     | <b>85,04</b>           |
| <b>M. ALTRE PASSIVITÀ</b>                                   | <b>-56.323,68</b>        | <b>47,45</b>           | <b>-35.444,92</b>                      | <b>14,96</b>           |
| <b>M1. Ratei passivi</b>                                    |                          |                        |  |                        |
| <b>M2. Spese pubblicazione quota</b>                        | -903,00                  | 0,76                   | -903,00                                | 0,38                   |
| <b>M3. Spese revisione rendiconto</b>                       | -22.896,00               | 19,29                  | -5.522,00                              | 2,33                   |
| <b>M4. Commissione di gestione</b>                          | -32.524,68               | 27,40                  | -29.019,92                             | 12,25                  |
| <b>M5. Passività diverse</b>                                |                          |                        |  |                        |
| <b>TOTALE PASSIVITÀ</b>                                     | <b>-118.696,52</b>       | <b>100,00</b>          | <b>-236.984,19</b>                     | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>                   |                          | <b>43.176.140,05</b>   |  | <b>49.575.130,01</b>   |
| Numero delle quote in circolazione                          |                          | 2.613.680,040          |  | 2.976.412,705          |
| Valore unitario delle quote                                 |                          | 16,519                 |  | 16,656                 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse                         | 70.513,018  | 48.782,478   | 86.908,135    | 46.433,390   |
| Quote rimborsate                     | 256.255,446 | 158.894,995  | 92.401,340    | 107.817,905  |

28/02/2017



genelife 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, iscritta all'albo dei gruppi assicurativi al numero 026, e soggetta alla  
 direzione ed al coordinamento di assicurazioni generali spa - genelife@genelife.it - www.genelife.it

Genelife S.p.A.  
 [Signature]  
 UFFICIO REGISTRO BOLLO DI TRIVISO

**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG A 2023**
**SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2016**

|   | Rendiconto al 31/12/2016 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>                                |                          |                                 |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI                                  | <b>1.454,87</b>          | <b>9.446,24</b>                 |
| 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.                           | 1.454,87                 | 9.446,24                        |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI                                 | <b>114.068,35</b>        | <b>604.035,04</b>               |
| A2.1. Titoli di debito  | 137.343,66               | 264.362,64                      |
| A2.2. Titoli azionari   |                          |                                 |
| A2.3. Parti di O.I.C.R.                                       | -23.275,31               | 339.672,40                      |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE                                  | <b>975.693,41</b>        | <b>2.718.039,05</b>             |
| A3.1. Titoli di debito  | 942.897,58               | 2.720.084,24                    |
| A3.2. Titoli di capitale                                      |                          |                                 |
| A3.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 32.795,83                | -2.045,19                       |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>                | <b>1.091.216,63</b>      | <b>3.331.520,33</b>             |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                       |                          |                                 |
| 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                              |                          |                                 |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>       |                          |                                 |
| <b>C. INTERESSI ATTIVI</b>                                    | <b>214,91</b>            | <b>100,46</b>                   |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI                                       | 214,91                   | 100,46                          |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI                             |                          |                                 |
| <b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>                      | <b>6.975,71</b>          | <b>292.690,16</b>               |
| D1. RISULTATI REALIZZATI                                      |                          |                                 |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  | 6.975,71                 | 292.690,16                      |
| <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>1.098.407,25</b>      | <b>3.624.310,95</b>             |
| <b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>     | <b>-46,02</b>            | <b>-369,01</b>                  |
| G1. Bolli, spese e commissioni                                | -46,02                   | -369,01                         |
| <b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>          | <b>1.098.361,23</b>      | <b>3.623.941,94</b>             |
| <b>H. ONERI DI GESTIONE</b>                                   | <b>-1.435.743,77</b>     | <b>-1.622.398,76</b>            |
| H1. Commissione di gestione                                   | -1.409.227,31            | -1.612.374,83                   |
| H2. Spese pubblicazione quota                                 | -903,00                  | -903,00                         |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia             | -25.609,62               | -8.995,72                       |
| H4. Altri oneri di gestione                                   | -3,84                    | -125,21                         |
| <b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>                                | <b>-0,52</b>             | <b>-1.023,61</b>                |
| I1. Altri ricavi  |                          | 0,02                            |
| I2. Altri costi   | -0,52                    | -1.023,63                       |
| <b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>                 | <b>-337.383,06</b>       | <b>2.000.519,57</b>             |

**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 | -0,82 | Volatilità della gestione | 5,13 |
|                           |       | Volatilità dichiarata     |      |

\* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

28/02/2017



generetellife 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 - generetellife@generetellife.it - www.generetellife.it

