

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG AZIONARIO II

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 | 16.603.705,88 | 93,35 | 19.167.342,10 | 97,81 |
| 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. | 16.603.705,88 | 93,35 | 19.167.342,10 | 97,81 |
| 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 | 35.448,65 | 0,20 | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 1.084.302,18 | 6,10 | 377.510,27 | 1,93 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 63.481,03 | 0,36 | 48.596,54 | 0,25 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | | | 2.804,12 | 0,01 |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | 2.804,12 | 0,01 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | 2.804,12 | 0,01 |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 17.786.937,74 | 100,00 | 19.596.253,03 | 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 | -23.929,02 | 63,94 | -159.985,43 | 92,45 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -13.493,20 | 36,06 | -13.056,82 | 7,55 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | 2,41 | -903,00 | 0,52 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -8.331,00 | 22,26 | -8.616,00 | 4,98 |
| M4. Commissione di gestione | -4.259,20 | 11,38 | -3.537,82 | 2,04 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -37.422,22 | 100,00 | -173.042,25 | |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 17.749.515,52 | | 19.423.210,78 |
| Numero delle quote in circolazione | | 5.250.566,832 | | 5.782.438,459 |
| Valore unitario delle quote | | 3,380 | | 3,359 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 62.659,663 | 25.773,795 | 106.367,933 | 66.277,161 |
| Quote rimborsate | 332.218,800 | 210.251,279 | 126.259,762 | 124.220,338 |

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




RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG AZIONARIO II
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2016

| | Rendiconto al 31/12/2016 | | Rendiconto esercizio precedente | |
|---------------------------------------------------------------|--------------------------|-------------------|---------------------------------|---------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 19.038,96 | | 11.389,70 | |
| 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. | 19.038,96 | | 11.389,70 | |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | -197.910,45 | | 560.038,91 | |
| A2.1. Titoli di debito | | | | |
| A2.2. Titoli azionari | | | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | -197.910,45 | | 560.038,91 | |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 367.369,56 | | 1.282.237,30 | |
| A3.1. Titoli di debito | | | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 367.369,56 | | 1.282.237,30 | |
| Risultato gestione strumenti finanziari | | 188.498,07 | | 1.853.665,91 |
| 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 | 11,05 | | 0,36 | |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 11,05 | | 0,36 | |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | 558,55 | | 42,40 | |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | 558,55 | | 42,40 | |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | 189.067,67 | | 1.853.708,67 |
| F. ALTRI PROVENTI | | | | |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | | | | |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | | 189.067,67 | | 1.853.708,67 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -664,24 | | -456,38 | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -664,24 | | -456,38 | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | | 377.471,10 | | 1.853.252,29 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -201.373,26 | | -244.225,28 | |
| H1. Commissione di gestione | -190.093,31 | | -233.884,81 | |
| H2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | | -903,00 | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -10.376,95 | | -9.421,64 | |
| H4. Altri oneri di gestione | | | -15,83 | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 2,32 | | -436,03 | |
| I1. Altri ricavi | 2,32 | | 2,36 | |
| I2. Altri costi | | | -438,39 | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | | -12.967,51 | | 1.608.590,98 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 0,63 | Volatilità della gestione | 14,46 |
| Rendimento del benchmark | 3,18 | Volatilità del benchmark ** | 13,82 |
| Differenza | -2,55 | 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 | | Volatilità della gestione | |
| | | Volatilità dichiarata | |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

28/02/2017


 generelife spa - sede legale e direzione generale via ferretto, 1 - 31021 mogliano veneto (tv) - tel. 041 893970
 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 - generelife@generelife.it - www.generelife.it

Generelife S.p.A.

