

| 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 | 25.910.762,43 | 98,56 | 29.005.302,58 | 98,40 |
| 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. | 25.910.762,43 | 98,56 | 29.005.302,58 | 98,40 |
| 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 | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 124.880,22 | 0,48 | 320.437,79 | 1,09 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 254.662,35 | 0,97 | 152.537,55 | 0,52 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | | | | |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | | |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 26.290.305,00 | 100,00 | 29.478.277,92 | 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 | -2.046.898,05 | 95,51 | -1.971.249,25 | 94,42 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -96.306,68 | 4,49 | -116.582,98 | 5,58 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | 0,04 | -903,00 | 0,04 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -12.642,00 | 0,59 | -12.255,00 | 0,59 |
| M4. Commissione di gestione | -82.759,87 | 3,86 | -103.423,17 | 4,95 |
| M5. Passività diverse | -1,81 | | -1,81 | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -2.143.204,73 | 100,00 | -2.087.832,23 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 24.147.100,27 | | 27.390.445,69 |
| Numero delle quote in circolazione | | 7.063.351,796 | | 7.875.343,787 |
| Valore unitario delle quote | | 3,419 | | 3,478 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 789.642,569 | 40.118,697 | 44.867,911 | 126.720,527 |
| Quote rimborsate | 625.168,638 | 290.233,147 | 120.165,708 | 777.774,202 |

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@genelife.it - www.genelife.it

Genelife spa
 Ufficio Registro Imposte
 Treviso

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO Espansione Duemila
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2016

| | Rendiconto al 31/12/2016 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | | |
| 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. | | |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | -262.006,31 | 1.617.728,03 |
| A2.1. Titoli di debito | | |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | -262.006,31 | 1.617.728,03 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 36.518,82 | 488.114,76 |
| A3.1. Titoli di debito | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 36.518,82 | 488.114,76 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | -225.487,49 | 2.105.842,79 |
| 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 | | |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | | |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | | |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | | |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | |
| F. ALTRI PROVENTI | | |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | | |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | -225.487,49 | 2.105.842,79 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | -225.487,49 | 2.105.842,79 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -346.224,23 | -433.534,80 |
| H1. Commissione di gestione | -332.675,23 | -420.372,80 |
| H2. Spese pubblicazione quota | -903,00 | -903,00 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -12.646,00 | -12.259,00 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | -571.711,72 | 1.672.307,99 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | -1,70 | Volatilità della gestione | 15,31 |
| Rendimento del benchmark | 5,67 | Volatilità del benchmark ** | 12,00 |
| Differenza | -7,37 | 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
 [Signature]
 [Stamp]