

| 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 | 5.288,60 | 92,26 | 3.892,45 | 98,69 |
| A1. Titoli di debito | 4.482,86 | 78,20 | 3.492,46 | 88,55 |
| A1.1. Titoli di Stato | 4.482,86 | 78,20 | 3.492,46 | 88,55 |
| 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. | 805,74 | 14,06 | 399,99 | 10,14 |
| 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 | 443,64 | 7,74 | 51,63 | 1,31 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | | | | |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | | | 0,01 | 0,00 |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | 0,01 | 0,00 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | 0,01 | 0,00 |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 5.732,24 | 100,00 | 3.944,09 | 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 | -8,20 | 100,00 | -8,25 | |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | | | | |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | | | | |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -8,20 | 100,00 | -8,25 | |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 5.724,04 | | 3.935,84 |
| Numero delle quote in circolazione | | 341,320 | | 233,595 |
| Valore unitario delle quote | | 16,770 | | 16,849 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 27,718 | 26,928 | 24,902 | 28,176 |
| Quote rimborsate | -0,490 | | | 0,489 |

28/02/2017



genertellife 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.i. - società
 unipersonale appartenente al gruppo generali, iscritto all'albo dei gruppi assicurativi al numero 046, e soggetta alla
 direzione ed al coordinamento di assicurazioni generali spa - genertellife@genertellife.it - www.genertellife.it



Genertellife S.p.A.
 [Firma]

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO GT BOND 2038
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 | 4,49 | 2.108,79 |
| A2.1. Titoli di debito | | 2.108,79 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 4,49 | |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | -87,38 | 95,07 |
| A3.1. Titoli di debito | -85,25 | 95,07 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | -2,13 | |
| Risultato gestione strumenti finanziari | -82,89 | 2.203,86 |
| 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 | -82,89 | 2.203,86 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | 0,14 | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | 0,14 | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 83,03 | 2.203,86 |
| H. ONERI DI GESTIONE | 22,41 | 6,01 |
| H1. Commissione di gestione | | |
| H2. Spese pubblicazione quota | | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | 22,41 | 6,01 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 0,01 | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | 0,01 | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 105,45 | 2.197,85 |

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 | -0,47 | Volatilità della gestione | 18,79 |
| | | 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. 044 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.l. - 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.

