

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG A 2033

SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2019

| ATTIVITÀ | Situazione al 31/12/2019 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 12.603.455,84 | 99,75 | 11.209.704,27 | 99,40 |
| A1. Titoli di debito | 10.701.574,30 | 84,70 | 8.917.701,17 | 79,08 |
| A1.1. Titoli di Stato | 10.701.574,30 | 84,70 | 8.917.701,17 | 79,08 |
| 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. | 1.901.881,54 | 15,05 | 2.292.003,10 | 20,32 |
| 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 | 24.923,95 | 0,20 | 62.119,09 | 0,55 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 6.000,95 | 0,05 | 5.501,65 | 0,05 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITÀ | 141,42 | | 70,31 | |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 141,42 | | 70,31 | |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | 141,42 | | 70,31 | |
| H2.3. Retrocessione commissioni | | | | |
| TOTALE ATTIVITÀ | 12.634.522,16 | 100,00 | 11.277.395,32 | 100,00 |

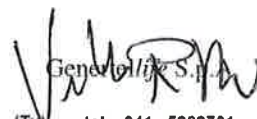
| PASSIVITÀ E NETTO | Situazione al 31/12/2019 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|------------------------|--|------------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale passività | Valore complessivo | % sul totale passività |
| I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE | -8.759,47 | 62,41 | -13.360,95 | 53,19 |
| M. ALTRE PASSIVITÀ | -5.275,73 | 37,59 | -11.758,36 | 46,81 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | -926,00 | 3,69 |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | -7.070,00 | 28,15 |
| M4. Commissione di gestione | -5.275,73 | 37,59 | -3.762,36 | 14,98 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITÀ | -14.035,20 | 100,00 | -25.119,31 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 12.620.486,96 | | 11.252.276,01 |
| Numero delle quote in circolazione | | 670.052,013 | | 717.233,572 |
| Valore unitario delle quote | | 18,835 | | 15,688 |

| Movimenti delle quote nell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 11.706,756 | 5.806,802 | 7.712,242 | 5.948,903 |
| Quote rimborsate | 7.636,517 | 18.984,892 | 7.331,866 | 44.402,987 |

28/02/2020



Generelife S.p.A. - Sede legale e Direzione Generale via Ferretto, 1 - 31021 Mogliano Veneto (TV) - tel. 041 5939701
 Capitale sociale € 168.200.000,00 int. ver. - Iscritta all'Albo delle imprese di assicurazione e riassicurazione n. 1.00141 - Codice fiscale e Registro Imprese di Treviso-Belluno
 00979820321 - partita iva 01333550323 - 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 S.p.A. -
 generelife@pec.generelife.it - www.generelife.it



RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BG A 2033
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2019

| | Rendiconto al 31/12/2019 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 1.922,68 | 2.698,77 |
| 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. | 1.922,68 | 2.698,77 |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 655.892,10 | 270.206,96 |
| A2.1. Titoli di debito | 536.767,08 | 331.283,59 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 119.125,02 | -61.076,63 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 1.980.819,75 | -898.444,40 |
| A3.1. Titoli di debito | 1.677.020,00 | -609.342,91 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 303.799,75 | -289.101,49 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 2.638.634,53 | -625.538,67 |
| 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 | 640,10 | 270,37 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 640,10 | 270,37 |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | 21.496,30 | 45.655,56 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | 21.496,30 | 45.655,56 |
| 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 | 2.660.770,93 | -579.612,74 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -185,52 | -178,16 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -185,52 | -178,16 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 2.660.585,41 | -579.790,90 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -389.644,87 | -367.909,53 |
| H1. Commissione di gestione | -379.900,65 | -357.599,27 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | -926,00 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -9.739,33 | -9.381,89 |
| H4. Altri oneri di gestione | -4,89 | -2,37 |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | -100,27 | -239,80 |
| I1. Altri ricavi | 1,36 | 2,60 |
| I2. Altri costi | -101,63 | -242,40 |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 2.270.840,27 | -947.940,23 |

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 | 20,62 | Volatilità della gestione | 7,84 |
| | | Volatilità dichiarata | |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

28/02/2020