

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO LVA DINAMICO PREVIDENZA

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	150.228.708,32	94,25	116.198.001,17	93,25
A1. Titoli di debito	7.486.997,90	4,70	8.327.853,96	6,68
A1.1. Titoli di Stato	7.486.997,90	4,70	8.327.853,96	6,68
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari	140.368.137,87	88,07	107.870.147,21	86,57
A3. Parti di O.I.C.R.	2.373.572,55	1,49		
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	572.329,37	0,36	543.192,73	0,44
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	572.329,37	0,36	543.192,73	0,44
B3. Parti di O.I.C.R.				
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	8.088,18	0,01	36.852,16	0,03
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	8.088,18	0,01	9.243,20	0,01
C1.1. Future (negoziati)				
C1.2. Warrants / Diritti	8.088,18	0,01	9.243,20	0,01
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)			27.608,96	0,02
C2.1. da definire			27.608,96	0,02
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	16.833,39	0,01	23.778,32	0,02
E. DEPOSITI BANCARI	7.232.888,01	4,54	6.458.078,96	5,18
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regoiare	970.505,40	0,61	1.064.205,75	0,85
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITÀ	360.093,42	0,23	278.943,80	0,22
H1. Ratei attivi	927,08		9.541,75	0,01
H2. Altri attivi (da specificare)	359.166,34	0,23	269.402,05	0,22
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	358.488,28	0,22	269.402,05	0,22
H2.3. Retrocessione commissioni	678,06			
TOTALE ATTIVITÀ	159.389.446,09	100,00	124.603.052,89	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	-1.081,47	1,66	-130.979,79	76,18
M. ALTRE PASSIVITÀ	-63.902,74	98,34	-40.946,03	23,82
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-61.127,74	94,07	-38.186,03	22,21
M5. Passività diverse	-2.775,00	4,27	-2.760,00	1,61
TOTALE PASSIVITÀ	-64.984,21	100,00	-171.925,82	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		159.324.461,88		124.431.127,07
Numero delle quote in circolazione		13.819.425,303		13.086.555,220
Valore unitario delle quote		11,529		9,508

Movimenti delle quote nell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	470.122,043	299.056,715	329.765,780	588.053,257
Quote rimborsate	227.378,786	231.612,532	211.274,480	283.861,914

28/02/2020




RENDICONTO DEL FONDO INTERNO LVA DINAMICO PREVIDENZA
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2019

	Rendiconto al 31/12/2019	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	4.122.081,39	3.513.071,68
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	56.473,54	65.624,39
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	4.045.956,81	3.447.447,29
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	19.651,04	
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	4.222.424,99	-538,08
A2.1. Titoli di debito	-34.748,19	-4.531,48
A2.2. Titoli azionari	4.272.270,34	3.993,40
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-15.097,16	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	20.762.388,93	-16.028.857,14
A3.1. Titoli di debito	105.849,77	-209.046,15
A3.2. Titoli di capitale	20.476.330,26	-15.819.810,99
A3.3. Parti di O.I.C.R.	180.208,90	
Risultato gestione strumenti finanziari	29.106.895,31	-12.516.323,54
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		
B1. RISULTATI REALIZZATI	-221.210,40	-187.788,55
B1.1. Su strumenti negoziati	-45.617,54	-45.623,86
B1.2. Su strumenti non negoziati	-175.592,86	-142.164,69
B2. RISULTATI NON REALIZZATI	482,23	-3.555,96
B2.1. Su strumenti negoziati	482,23	-249,73
B2.2. Su strumenti non negoziati		-3.306,23
Risultato gestione strumenti finanziari derivati	-220.728,17	-191.344,51
C. INTERESSI ATTIVI	12.380,65	1.774,30
C1. SU DEPOSITI BANCARI	12.380,65	1.774,30
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	2.226.217,80	1.606.240,58
D1. RISULTATI REALIZZATI		
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	2.226.217,80	1.606.240,58
E. PROVENTI SU CREDITI		
F. ALTRI PROVENTI	3.084,09	22.080,95
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI	3.084,09	22.080,95
Risultato lordo della gestione di portafoglio	31.127.849,68	-11.077.572,22
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-74.286,53	-58.966,36
G1. Bolli, spese e commissioni	-74.286,53	-58.966,36
Risultato netto della gestione di portafoglio	31.053.563,15	-11.136.538,58
H. ONERI DI GESTIONE	-4.040.361,39	-3.671.453,02
H1. Commissione di gestione	-4.030.604,99	-3.656.505,52
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-5.057,93	-3.156,76
H4. Altri oneri di gestione	-4.698,47	-11.790,74
I. ALTRI RICAVI E ONERI	-24.021,12	-13.571,67
I1. Altri ricavi	4,60	63,59
I2. Altri costi	-24.025,72	-13.635,26
Utile/perdita della gestione del Fondo	26.989.180,64	-14.821.563,27

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	24,71	Volatilità della gestione	7,92
Rendimento del benchmark	21,03	Volatilità del benchmark **	7,96
Differenza	3,68	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

28/02/2020


