



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ISV Prospettiva Dinamica  
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2019

Allegato 1

| ATTIVITA'   | Situazione al 31-12-2019 |                       | Situazione a fine esercizio precedente |                       |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
|   | Valore complessivo       | % sul totale attività | Valore complessivo                     | % sul totale attività |
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>                    | <b>85.779.069,26</b>     | <b>99,76</b>          | <b>83.351.476,34</b>                   | <b>99,31</b>          |
| 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   |                          |                       |  |                       |
| <b>A3. Parti di O.I.C.R.</b>                                | <b>85.779.069,26</b>     | <b>99,76</b>          | <b>83.351.476,34</b>                   | <b>99,31</b>          |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>                |                          |                       |  |                       |
| 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.                                       |                          |                       |  |                       |
| <b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                     |                          |                       |  |                       |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                |                          |                       |  |                       |
| C1.1. Strumenti finanziari derivati - Call                  |                          |                       |  |                       |
| C1.2. Diritti - Strumenti finanziari derivati               |                          |                       |  |                       |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)            |                          |                       |  |                       |
| C2.1. Strumenti finanziari derivati non negoziati - Call    |                          |                       |  |                       |
| C2.2. Contratti Forward                                     |                          |                       |  |                       |
| <b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b> |                          |                       |  |                       |
| <b>E. DEPOSITI BANCARI</b>                                  | <b>180.169,08</b>        | <b>0,21</b>           | <b>251.652,39</b>                      | <b>0,30</b>           |
| <b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b> | <b>26.282,25</b>         | <b>0,03</b>           | <b>325.572,48</b>                      | <b>0,39</b>           |
| <b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>                        |                          |                       |  |                       |
| <b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>                                   |                          |                       |  |                       |
| H1. Ratei attivi  |                          |                       |  |                       |
| H2. Altri attivi (da specificare)                           |                          |                       |  |                       |
| H2.1. Crediti d'imposta                                     |                          |                       |  |                       |
| H2.2. Crediti per ritenute                                  |                          |                       |  |                       |
| H2.3. Crediti diversi                                       |                          |                       |  |                       |
| H2.4. Retrocessione commissioni                             |                          |                       |  |                       |
| <b>TOTALE ATTIVITA'</b>                                     | <b>85.985.520,59</b>     | <b>100,00</b>         | <b>83.928.701,21</b>                   | <b>100,00</b>         |

| PASSIVITA' E NETTO   | Situazione al 31-12-2019 |                      | Situazione a fine esercizio precedente |                      |
|--|--------------------------|----------------------|--|----------------------|
|  | Valore complessivo       | % sul totale         | Valore complessivo                     | % sul totale         |
| <b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                      |                          |                      |  |                      |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)                 |                          |                      |  |                      |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)             |                          |                      |  |                      |
| <b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b> | <b>-35.044,01</b>        | <b>8,26</b>          | <b>-356.175,98</b>                     | <b>47,48</b>         |
| <b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>                                   | <b>-389.321,41</b>       | <b>91,74</b>         | <b>-394.026,33</b>                     | <b>52,52</b>         |
| M1. Ratei passivi  |                          |                      |  |                      |
| M2. Spese pubblicazione quota                                |                          |                      |  |                      |
| M3. Spese revisione rendiconto                               |                          |                      |  |                      |
| M4. Commissione di gestione                                  | -389.321,41              | 91,74                | -394.026,33                            | 52,52                |
| M5. Passività diverse  |                          |                      |  |                      |
| <b>TOTALE PASSIVITA'</b>                                     | <b>-424.365,42</b>       | <b>100,00</b>        | <b>-750.202,31</b>                     | <b>100,00</b>        |
| <b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>                    |                          | <b>85.561.155,17</b> |  | <b>83.178.498,90</b> |
| Numero delle quote in circolazione                           |                          | 5.299.999,23000      |  | 5.942.997,02600      |
| Valore unitario delle quote                                  |                          | 16,144               |  | 13,996               |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse                         | 88.407,837  | 87.289,474   | 127.560,382   | 63.344,202   |
| Quote rimborsate                     | 343.949,982 | 267.610,451  | 166.190,380   | 231.848,878  |

Milano, 28 febbraio 2020

Intesa Sanpaolo Vita S.p.A.

*Roberto Celli*

Intesa Sanpaolo Vita S.p.A. Sede Legale: Corso Inghilterra 3, 10138 Torino Sede Operativa: Viale Stelvio 55/57, 20159 Milano comunicazioni@pec.intesasampaolovita.it Capitale Sociale Euro 320.422.508 Codice Fiscale e n. Iscrizione Registro Imprese di Torino 02505650370 Società partecipante al Gruppo IVA "Intesa Sanpaolo" - Partita IVA 11991500015 (IT11991500015) e soggetta all'attività di direzione e coordinamento di Intesa Sanpaolo S.p.A. Iscritta all'Albo delle imprese di assicurazione e riassicurazione al n. 1.00066 Capogruppo del Gruppo Assicurativo Intesa Sanpaolo Vita, iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 28

Società del gruppo **INTESA** **SANPAOLO**



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ISV Prospettiva Dinamica  
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2019

Allegato 2

|   | Rendiconto al 31-12-2019 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| <b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>                                |                          |                                 |
| 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 REALIZZATI                               | 2.946.184,75             | -67.426,04                      |
| A2.1. Titoli di debito  |                          |                                 |
| A2.2. Titoli azionari   |                          |                                 |
| A2.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 2.946.184,75             | -67.426,04                      |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE                                  | 10.652.298,71            | -4.677.784,10                   |
| A3.1. Titoli di debito  |                          |                                 |
| A3.2. Titoli di capitale                                      |                          |                                 |
| A3.3. Parti di O.I.C.R.                                       | 10.652.298,71            | -4.677.784,10                   |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>                | <b>13.598.483,46</b>     | <b>-4.745.210,14</b>            |
| <b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>                       |                          |                                 |
| 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                              |                          |                                 |
| <b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>       |                          |                                 |
| <b>C. INTERESSI ATTIVI</b>                                    | <b>-1.465,98</b>         | <b>-1.621,34</b>                |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI                                       | -1.465,98                | -1.621,34                       |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI                             |                          |                                 |
| <b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>                      | <b>152.753,91</b>        | <b>259.638,15</b>               |
| D1. RISULTATI REALIZZATI                                      | 59.077,46                | -55.832,52                      |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI                                  | 93.676,45                | 315.470,67                      |
| <b>E. PROVENTI SU CREDITI</b>                                 |                          |                                 |
| <b>F. ALTRI PROVENTI</b>                                      |                          |                                 |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI |                          |                                 |
| F2. PROVENTI DIVERSI  |                          |                                 |
| <b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>          | <b>13.749.771,39</b>     | <b>-4.487.193,33</b>            |
| <b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>     | <b>1,89</b>              | <b>-3,08</b>                    |
| G1. Bolli, spese e commissioni                                | 1,89                     | -3,08                           |
| <b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>          | <b>13.749.773,28</b>     | <b>-4.487.196,41</b>            |
| <b>H. ONERI DI GESTIONE</b>                                   | <b>-1.544.928,14</b>     | <b>-1.646.083,62</b>            |
| H1. Commissione di gestione                                   | -1.544.924,97            | -1.646.083,62                   |
| H2. Spese pubblicazione quota                                 |                          |                                 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia             | -3,17                    |                                 |
| H4. Altri oneri di gestione                                   |                          |                                 |
| <b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>                                |                          |                                 |
| I1. Altri ricavi  |                          |                                 |
| I2. Altri costi   |                          |                                 |
| <b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>                 | <b>12.204.845,14</b>     | <b>-6.133.280,03</b>            |

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

|                           |       |                             |      |
|---------------------------|-------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 17,00 | Volatilità della gestione   | 5,32 |
| Rendimento del benchmark  | 19,80 | Volatilità del benchmark ** | 5,34 |
| Differenza                | -2,80 | Volatilità dichiarata ***   |      |

\* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

\*\* indicate soltanto in caso di gestione passiva

\*\*\* indicate 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

Milano, 28 febbraio 2020

Intesa Sanpaolo Vita S.p.A.

Intesa Sanpaolo Vita S.p.A. Sede Legale: Corso Inghilterra 3, 10138 Torino Sede Operativa: Viale Stelvio 55/57, 20159 Milano  
comunicazioni@pec.intesasampaolovita.it Capitale Sociale Euro 320.422.508 Codice Fiscale e n. Iscrizione Registro Imprese di Torino  
02505650370 Società partecipante al Gruppo IVA "Intesa Sanpaolo" - Partita IVA 11991500015 (IT11991500015) e soggetta all'attività di  
direzione e coordinamento di Intesa Sanpaolo S.p.A. Iscritta all'Albo delle imprese di assicurazione e riassicurazione al n. 1.00066 Capogruppo  
del Gruppo Assicurativo Intesa Sanpaolo Vita, iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 28

Società del gruppo **INTESA** **SANPAOLO**