



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) Synthesis Protetto
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 |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 44.696.973,59 | 99,63 | 47.594.466,17 | 98,88 |
| 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. | 44.696.973,59 | 99,63 | 47.594.466,17 | 98,88 |
| 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. 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 | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 165.688,65 | 0,37 | 293.134,19 | 0,61 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | | | 244.644,58 | 0,51 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | | | | |
| 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 | | | | |
| TOTALE ATTIVITA' | 44.862.662,24 | 100,00 | 48.132.244,94 | 100,00 |

| PASSIVITA' E NETTO | Situazione al 31-12-2019 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|--|--------------------------|----------------------|--|----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale | Valore complessivo | % sul totale |
| I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE | | | | |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -189.151,79 | 100,00 | -208.201,92 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | -2.009,58 | 0,97 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -6.101,16 | 3,23 | -6.028,82 | 2,90 |
| M4. Commissione di gestione | -183.050,63 | 96,77 | -200.163,52 | 96,14 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -189.151,79 | 100,00 | -208.201,92 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 44.673.510,45 | | 47.924.043,02 |
| Numero delle quote in circolazione | | 4.412.707,28100 | | 5.004.720,73100 |
| Valore unitario delle quote | | 10,124 | | 9,576 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 30.889,347 | 389.451,212 | 78.656,646 | 31.895,770 |
| Quote rimborsate | 123.716,357 | 604.142,466 | 158.094,014 | 236.953,588 |

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
direzionale 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) Synthesis Protetto
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2019

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2019 | 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 | 1.135.013,44 | -659.351,03 |
| A2.1. Titoli di debito | | |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 1.135.013,44 | -659.351,03 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 2.282.278,26 | -1.940.956,72 |
| A3.1. Titoli di debito | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 2.282.278,26 | -1.940.956,72 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 3.417.291,70 | -2.600.307,75 |
| 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 | -3.153,78 | -2.132,75 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | -3.153,78 | -2.132,75 |
| 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 | 3.414.137,92 | -2.602.440,50 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | 0,14 | 0,77 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | 0,14 | 0,77 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 3.414.138,06 | -2.602.439,73 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -749.552,85 | -806.355,18 |
| H1. Commissione di gestione | -743.083,69 | -797.948,78 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | -2.009,58 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -6.469,16 | -6.396,82 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 2.664.585,21 | -3.408.794,91 |

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

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|------|---------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 5,95 | Volatilità della gestione | 3,03 |
| | | 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**