



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) EV Strategia 30
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 | 19.352.364,94 | 92,65 | 17.559.671,16 | 91,94 |
| 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. | 19.352.364,94 | 92,65 | 17.559.671,16 | 91,94 |
| 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 | 1.399.125,16 | 6,70 | 1.356.311,89 | 7,10 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 103.981,46 | 0,50 | 153.087,57 | 0,80 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 31.687,28 | 0,15 | 30.099,23 | 0,16 |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 31.687,28 | 0,15 | 30.099,23 | 0,16 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Crediti diversi | | | | |
| H2.4. Retrocessione commissioni | 31.687,28 | 0,15 | 30.099,23 | 0,16 |
| TOTALE ATTIVITA' | 20.887.158,84 | 100,00 | 19.099.169,85 | 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 | -68.105,24 | 40,81 | -18.787,86 | 17,02 |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -98.793,55 | 59,19 | -91.593,36 | 82,98 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | -98.143,98 | 58,80 | -91.593,36 | 82,98 |
| M5. Passività diverse | -649,57 | 0,39 | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -166.898,79 | 100,00 | -110.381,22 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 20.720.260,05 | | 18.988.788,63 |
| Numero delle quote in circolazione | | 1.664.508.83072 | | 1.655.307.96172 |
| Valore unitario delle quote | | 12,448 | | 11,471 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| Quote emesse | 26.657,05000 | 70.139,36800 | 78.826,67800 | 135.264,54900 |
| Quote rimborsate | 51.726,03600 | 64.807,90700 | 59.371,66600 | 125.781,16700 |

Milano, 28 febbraio 2020

Intesa Sanpaolo Vita S.p.A.

Alfredo Cella

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) EV Strategia 30
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 | 117.701,00 | 178.037,99 |
| A2.1. Titoli di debito | | |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 117.701,00 | 178.037,99 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 1.714.618,07 | -803.040,28 |
| A3.1. Titoli di debito | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 1.714.618,07 | -803.040,28 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 1.832.319,07 | -625.002,29 |
| 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 | 1.832.319,07 | -625.002,29 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 1.832.319,07 | -625.002,29 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -380.302,22 | -432.543,19 |
| H1. Commissione di gestione | -379.152,07 | -431.272,71 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | | |
| H4. Altri oneri di gestione | -1.150,15 | -1.270,48 |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 151.287,04 | 210.802,74 |
| I1. Altri ricavi | 151.287,04 | 210.802,74 |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 1.603.303,89 | -846.742,74 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 9,14 | Volatilità della gestione | 3,17 |
| Rendimento del benchmark | 11,10 | Volatilità del benchmark ** | 3,31 |
| Differenza | -1,96 | 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.

Alfano Colli

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**