

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

Allegato 1

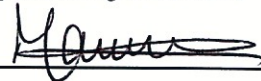
| ATTIVITA' | Situazione al 31-12-2019 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 118.159,49 | 88,96 | 125.083,19 | 97,68 |
| A1. Titoli di debito | 24.650,90 | 18,56 | 32.180,40 | 25,13 |
| A1.1. Titoli di Stato | 24.650,90 | 18,56 | 32.180,40 | 25,13 |
| 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. | 93.508,59 | 70,40 | 92.902,79 | 72,55 |
| 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) | | | | |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| C2.1. Opzioni | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 14.607,28 | 11,00 | 2.849,21 | 2,23 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 51,04 | 0,04 | 64,56 | 0,05 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 3,46 | | 53,17 | 0,04 |
| H1. Ratei attivi | 3,46 | | 53,17 | 0,04 |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | | |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Commissioni di retrocessione | | | | |
| H2.4. Altri crediti | | | | |
| TOTALE ATTIVITA' | 132.821,27 | 100,00 | 128.050,13 | 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' | -974,64 | 100,00 | -1.929,09 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | -830,00 | 43,03 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -386,64 | 39,67 | -500,00 | 25,92 |
| M4. Commissione di gestione | -588,00 | 60,33 | -599,09 | 31,06 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -974,64 | 100,00 | -1.929,09 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | 131.846,63 | | 126.121,04 | |
| Numero delle quote in circolazione | 9.128.689 | | 10.294.859 | |
| Valore unitario delle quote | 14,443 | | 12,250 | |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 18.117 | 69.687 | 16.958 | 12.458 |
| Quote rimborsate | 1.283.390 | | | |

Data 27.02.2020

Il rappresentante legale della Società



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

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2019 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 2.353,57 | 3.320,86 |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito | 475,34 | 582,11 |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari | | |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R. | 1.878,23 | 2.738,75 |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 814,23 | 886,15 |
| A2.1. Titoli di debito | 8,10 | 15,77 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 806,13 | 870,38 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 20.658,11 | -11.257,17 |
| A3.1. Titoli di debito | 511,00 | -1.694,63 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 20.147,11 | -9.562,54 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 23.825,91 | -7.050,16 |
| 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 | -0,51 | |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | -0,51 | |
| 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 | 23.825,40 | -7.050,16 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -464,54 | -505,58 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -464,54 | -505,58 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 23.360,86 | -7.555,74 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -2.638,02 | -4.137,04 |
| H1. Commissione di gestione | -2.251,38 | -2.807,04 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | -830,00 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -386,64 | -500,00 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 20.722,84 | -11.692,78 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 17,90 | Volatilità della gestione | 7,79 |
| Rendimento del benchmark | 16,10 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | 1,80 | Volatilità dichiarata *** | |

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

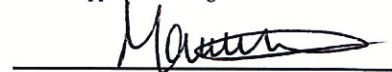
*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|--|---------------------------|--|
| Rendimento della gestione | | Volatilità della gestione | |
| | | Volatilità dichiarata | |

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Il rappresentante legale della Società



Data 27.02.2020