



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO CBA TREND FOLLOWING
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2015

Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2015		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	2.813,96	82,92	188.732,88	67,69
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.	2.813,96	82,92	188.732,88	67,69
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	579,49	17,08	33.396,84	11,98
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare				
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'			56.671,46	20,33
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)			56.671,46	20,33
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute			56.671,46	20,33
H2.3. Commissioni di retrocessione				
TOTALE ATTIVITA'	3.393,45	100,00	278.801,18	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2015		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'			-20.057,20	100,00
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota			-885,00	4,41
M3. Spese revisione rendiconto			-5.725,00	28,54
M4. Commissione di gestione			-13.447,20	67,04
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'			-20.057,20	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		3.393,45		258.743,98
Numero delle quote in circolazione		321.91485		24.098.05485
Valore unitario delle quote		10,541		10,737

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse				
Quote rimborsate		9.235,89000	12.393,50000	2.146,75000

Il responsabile della Società

Data 26.02.16

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO CBA TREND FOLLOWING
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2015

Allegato 2

	Rendiconto al 31-12-2015		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	-29,38		185.779,49	
A2.1. Titoli di debito				
A2.2. Titoli azionari				
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-29,38		185.779,49	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	-1,58		31,53	
A3.1. Titoli di debito				
A3.2. Titoli di capitale				
A3.3. Parti di O.I.C.R.	-1,58		31,53	
Risultato gestione strumenti finanziari		-30,96		185.811,02
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			17.326,97	
D1. RISULTATI REALIZZATI			17.326,97	
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		-30,96		203.137,99
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)			-5,46	
G1. Bolli, spese e commissioni	-2,26		-5,46	
Risultato netto della gestione di portafoglio		-33,22		203.132,53
H. ONERI DI GESTIONE		-3.477,12		-103.858,97
H1. Commissione di gestione	-2.059,51		-97.248,97	
H2. Spese pubblicazione quota	-777,61		-885,00	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-640,00		-5.725,00	
H4. Altri oneri di gestione				
I. ALTRI RICAVI E ONERI		-8,00		3.012,59
I1. Altri ricavi			3.020,59	
I2. Altri costi	-8,00		-8,00	
Utile/perdita della gestione del Fondo		-3.518,34		102.286,15

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	-1,83	Volatilità della gestione	0,78
		Volatilità dichiarata	8,50

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Il responsabile della Società



Data 26.02.16