

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ORIZZONTE 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 | 3.794.834,66 | 83,05 | 3.561.919,17 | 88,65 |
| A1. Titoli di debito | 912.622,54 | 19,97 | 873.432,67 | 21,74 |
| A1.1. Titoli di Stato | 912.622,54 | 19,97 | 873.432,67 | 21,74 |
| 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. | 2.882.212,12 | 63,08 | 2.688.486,50 | 66,91 |
| B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI | | | | |
| B1. Titoli di debito | | | | |
| B1.1. Titoli di Stato | | | | |
| B1.2. Obbligazioni ed 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 | 768.445,76 | 16,82 | 449.705,39 | 11,19 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | 1.250,31 | 0,02 | 955,18 | 0,02 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 4.882,49 | 0,11 | 5.552,38 | 0,14 |
| H1. Ratei attivi | 3.584,63 | 0,08 | 4.806,55 | 0,12 |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 1.297,86 | 0,03 | 745,83 | 0,02 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Commissioni di retrocessione | 1.297,86 | 0,03 | 745,83 | 0,02 |
| TOTALE ATTIVITA' | 4.569.413,22 | 100,00 | 4.018.132,12 | 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 | -5,68 | 0,03 | | |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -20.287,58 | 99,97 | -18.173,75 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | -20.287,58 | 99,97 | -18.173,75 | 100,00 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -20.293,26 | 100,00 | -18.173,75 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | 4.549.119,96 | | 3.999.958,37 | |
| Numero delle quote in circolazione | 376.342,240 | | 359.829,804 | |
| Valore unitario delle quote | 12,087 | | 11,116 | |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 5.943,026 | 5.563,817 | 9.491,481 | 13.438,302 |
| Quote rimborsate | 2.785,490 | 4.340,220 | 3.990,500 | 6.807,980 |

Il rappresentante legale della Società



Data 27.02.2020

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ORIZZONTE 30
SEZIONE REDDITUALE AL 31.12.2019

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2019 | | Rendiconto esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-------------------|---------------------------------|--------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 53.536,48 | | 62.267,60 | |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito | 23.584,52 | | 29.989,93 | |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari | | | | |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R. | 29.951,96 | | 32.277,67 | |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 16.790,17 | | 9.389,37 | |
| A2.1. Titoli di debito | -1.489,83 | | | |
| A2.2. Titoli azionari | | | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 18.280,00 | | 9.389,37 | |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 355.596,81 | | -183.774,70 | |
| A3.1. Titoli di debito | 11.890,98 | | -44.151,56 | |
| A3.2. Titoli di capitale | | | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 343.705,83 | | -139.623,14 | |
| Risultato gestione strumenti finanziari | | 425.923,46 | | -112.117,72 |
| 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 | | -8,07 | | |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | | -8,07 | | |
| 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 | | 425.915,39 | | -112.117,72 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | | | | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | | | | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | | 425.915,39 | | -112.117,72 |
| H. ONERI DI GESTIONE | | | | |
| H1. Commissione di gestione | -77.493,69 | | -72.783,37 | |
| H2. Spese pubblicazione quota | -77.493,69 | | -72.783,37 | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | | | | |
| H4. Altri oneri di gestione | | | | |
| I. ALTRI RICAVIDI E ONERI | | | | |
| I1. Altri ricavi | 5.030,28 | | 3.778,89 | |
| I2. Altri costi | 5.030,28 | | 3.778,89 | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | | 353.451,98 | | -181.122,20 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 8,74 | Volatilità della gestione | 3,44 |
| Rendimento del benchmark | 8,60 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | 0,14 | Volatilità dichiarata *** | |

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

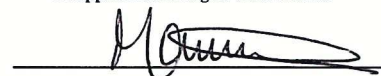
*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

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