

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) 01112 RAS OBBLIG.PLUS EUROPA
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2009

Allegato 1

| ATTIVITA' | Situazione al 31-12-2009 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 31.338.591,38 | 100,13 | 29.155.369,31 | 99,39 |
| A1. Titoli di debito | 21.029.365,50 | 67,19 | 19.675.192,90 | 67,07 |
| A1.1. Titoli di Stato | 18.959.759,00 | 60,58 | 18.781.187,90 | 64,02 |
| A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili | 2.069.606,50 | 6,61 | 894.005,00 | 3,05 |
| A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi | | | | |
| A2. Titoli azionari | | | | |
| A3. Parti di O.I.C.R. | 10.309.225,88 | 32,94 | 9.480.176,41 | 32,32 |
| 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 negoziati | | | | |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| C2.1. Strumenti finanziari derivati non negoziati | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 131.895,98 | 0,42 | 15.065,99 | 0,05 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | -631.439,73 | -2,02 | -204.649,43 | -0,70 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 460.073,51 | 1,47 | 369.928,96 | 1,26 |
| H1. Ratei attivi | 349.571,21 | 1,12 | 363.175,09 | 1,24 |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 110.502,30 | 0,35 | 6.753,87 | 0,02 |
| H2.1. Crediti d'imposta | 105.886,00 | 0,34 | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | 206,48 | | 1.543,16 | 0,01 |
| H2.3. Retrocessione Commissioni | 2.333,11 | 0,01 | 2.832,05 | 0,01 |
| H2.4. Altre Attività Diverse | 2.076,71 | 0,01 | 2.378,66 | 0,01 |
| TOTALE ATTIVITA' | 31.299.121,14 | 100,00 | 29.335.714,83 | 100,00 |

| PASSIVITA' E NETTO | Situazione al 31-12-2009 | | 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' | -43.034,59 | 100,00 | -43.477,75 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | -1.152,00 | 2,68 | -1.152,00 | 2,65 |
| M3. Spese revisione rendiconto | -7.632,00 | 17,73 | -7.924,70 | 18,23 |
| M4. Commissione di gestione | -34.250,59 | 79,59 | -34.401,05 | 79,12 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -43.034,59 | 100,00 | -43.477,75 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 31.256.086,55 | | 29.292.237,08 |
| Numero delle quote in circolazione | | 4.493.288,51 | | 4.675.399,77 |
| Valore unitario delle quote | | 6,956 | | 6,265 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 230.837,00 | 119.623,12 | 107.331,78 | 196.883,25 |
| Quote rimborsate | 267.882,77 | 166.928,35 | 195.327,75 | 206.647,52 |

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) 01112 RAS OBBLIG.PLUS EUROPA
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2009

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2009 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 786.245,78 | 971.692,53 |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito | 786.245,78 | 971.692,53 |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari | | |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R. | | |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | 172.761,87 | -49.023,28 |
| A2.1. Titoli di debito | 114.073,68 | 209.531,33 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 58.688,19 | -258.554,61 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 2.405.678,08 | -3.562.615,84 |
| A3.1. Titoli di debito | 197.979,70 | 703.265,63 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 2.207.698,38 | -4.265.881,47 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 3.364.685,73 | -2.639.946,59 |
| 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 | 763,61 | 5.668,89 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 763,61 | 5.668,89 |
| 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 | 105.886,00 | |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | 105.886,00 | |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | 3.471.335,34 | -2.634.277,70 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 3.471.335,34 | -2.634.277,70 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -404.115,98 | -429.467,94 |
| H1. Commissione di gestione | -388.949,30 | -414.824,35 |
| H2. Spese pubblicazione quota | -1.152,00 | -1.152,00 |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -14.014,68 | -13.491,59 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | 40.542,29 | 53.916,34 |
| I1. Altri ricavi | 40.542,29 | 53.916,34 |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 3.107.761,65 | -3.009.829,30 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|------|
| Rendimento della gestione | 11,03 | Volatilità della gestione | 5,94 |
| Rendimento del benchmark | 12,38 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | -1,35 | Volatilità dichiarata *** | 6,04 |

* 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