

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA MONETARIA
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2021

Allegato 1

| ATTIVITA' | Situazione al 31-12-2021 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 560.922,19 | 91,53 | 707.091,80 | 91,18 |
| 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. | 560.922,19 | 91,53 | 707.091,80 | 91,18 |
| 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. Warrant | | | | |
| C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio | | | | |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 51.925,96 | 8,47 | 68.413,54 | 8,82 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | | | | |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | | | | |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | | |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Commissioni Retrocedute | | | | |
| H2.4. Crediti tax reclaim | | | | |
| TOTALE ATTIVITA' | 612.848,15 | 100,00 | 775.505,34 | 100,00 |

| PASSIVITA' E NETTO | Situazione al 31-12-2021 | | 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) | | | | |
| I2.1. Interest rate swap | | | | |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE | | | | |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -772,68 | 100,00 | -938,06 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | -772,68 | 100,00 | -938,06 | 100,00 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -772,68 | 100,00 | -938,06 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 612.075,47 | | 774.567,28 |
| Numero delle quote in circolazione | | 131.145,464 | | 163.860,811 |
| Valore unitario delle quote | | 4,667 | | 4,726 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 0,000 | 0,000 | 0,000 | 0,000 |
| Quote rimborsate | 18.845,921 | 13.869,426 | 0,000 | 0,000 |

Milano, 31/01/2022

Il Rappresentante della Società



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA MONETARIA
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2021

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2021 | | 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 | -293,41 | | -329,87 | |
| A2.1. Titoli di debito | | | | |
| A2.2. Titoli azionari | | | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | -293,41 | | -329,87 | |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | -3.203,13 | | -2.275,43 | |
| A3.1. Titoli di debito | | | | |
| A3.2. Titoli di capitale | | | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | -3.203,13 | | -2.275,43 | |
| Risultato gestione strumenti finanziari | | -3.496,54 | | -2.605,30 |
| 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 | | -3.496,54 | | -2.605,30 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | | | | |
| G1. Bolli, spese e commissioni | | | | |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | | -3.496,54 | | -2.605,30 |
| H. ONERI DI GESTIONE | | | | |
| H1. Commissione di gestione | -4.780,69 | | -5.565,72 | |
| H2. Spese pubblicazione quota | -3.247,69 | | -3.744,75 | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -1.533,00 | | -1.820,97 | |
| H4. Altri oneri di gestione | | | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | | | |
| I1. Altri ricavi | | | | |
| I2. Altri costi | | | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | | -8.277,23 | | -8.171,02 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------------|
| Rendimento della gestione | -1,25 | Volatilità della gestione | 0,06 |
| Rendimento del benchmark | -0,49 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | -0,76 | Volatilità dichiarata *** | 0,01 - 0,49 |

* 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, 31/01/2022

Il Rappresentante della Società

Jane Lanteri