

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA AZIONI ITALIA
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2023

Allegato I

| ATTIVITA' | Situazione al 31-12-2023 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|---|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 831.634,15 | 94,62 | 378.590,51 | 92,31 |
| A1. Titoli di debito | | | 9.710,90 | 2,37 |
| A1.1. Titoli di Stato | | | 9.710,90 | 2,37 |
| 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. | 831.634,15 | 94,62 | 368.879,61 | 89,94 |
| 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 | 47.047,20 | 5,35 | 31.530,36 | 7,69 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | | | | |
| G. MUTUE PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 259,88 | 0,03 | 16,45 | 0,00 |
| H1. Ratei attivi | | | | |
| H2. Altri attivi (da specificare) | 259,88 | 0,03 | 16,45 | 0,00 |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | 259,88 | 0,03 | 16,45 | 0,00 |
| H2.3. Commissioni Retrocedute | | | | |
| H2.4. Crediti tax reclaim | | | | |
| TOTALE ATTIVITA' | 878.941,23 | 100,00 | 410.137,32 | 100,00 |

| PASSIVITA' E NETTO | Situazione al 31-12-2023 | | 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 | | | -26,98 | 1,41 |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -4.015,44 | 100,00 | -1.883,60 | 98,59 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | -4.015,44 | 100,00 | -1.883,60 | 98,59 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -4.015,44 | 100,00 | -1.910,58 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 874.925,79 | | 408.226,74 |
| Numero delle quote in circolazione | | 142.620,871 | | 78.723,407 |
| Valore unitario delle quote | | 6,134 | | 5,185 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 15.671,856 | 21.365,336 | 22.434,180 | 24.321,185 |
| Quote rimborsate | 1.829,760 | 1.157,063 | 1.045,857 | 15.862,413 |

Milano, 19/02/2024

Il Rappresentante della Società



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA AZIONI ITALIA
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2023

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2023 | 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 | 1.940,76 | -1.817,05 |
| A2.1. Titoli di debito | 13,90 | |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | 1.926,86 | -1.817,05 |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | 111.444,25 | -12.028,69 |
| A3.1. Titoli di debito | | -13,76 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | 111.444,25 | -12.014,93 |
| Risultato gestione strumenti finanziari | 113.385,01 | -13.845,74 |
| 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 | 739,65 | 46,81 |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | 739,65 | 46,81 |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | -1.155,99 | -199,14 |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | -1.155,99 | -34,81 |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | | -164,33 |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | |
| F. ALTRI PROVENTI | 259,88 | 16,45 |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | 259,88 | 16,45 |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | 113.228,55 | -13.981,62 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -1,17 | -77,57 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -1,17 | -77,57 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | 113.227,38 | -14.059,19 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -13.502,06 | -5.836,30 |
| H1. Commissione di gestione | -12.836,48 | -5.170,72 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -665,58 | -665,58 |
| H4. Altri oneri di gestione | | |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | 99.725,32 | -19.895,49 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 18,30 | Volatilità della gestione | 11,86 |
| Rendimento del benchmark | 8,88 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | 9,42 | 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

Milano, 19/02/2024

Il Rappresentante della Società

Jane Lanfieri

