

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA OBBLIGAZIONI PAESI EMERGENTI  
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
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>608.174,03</b>	<b>91,03</b>	<b>435.586,95</b>	<b>93,42</b>
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.	608.174,03	91,03	435.586,95	93,42
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>				
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.				
<b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
C1.1. Warrant				
C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b>				
<b>E. DEPOSITI BANCARI</b>	<b>59.742,54</b>	<b>8,94</b>	<b>30.655,01</b>	<b>6,58</b>
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare				
<b>G. MUTUE PRESTITI GARANTITI</b>				
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>	<b>221,87</b>	<b>0,03</b>	<b>12,22</b>	<b>0,00</b>
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	221,87	0,03	12,22	0,00
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	221,87	0,03	12,22	0,00
H2.3. Commissioni Retrocedute				
H2.4. Crediti tax reclaim				
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>668.138,44</b>	<b>100,00</b>	<b>466.254,18</b>	<b>100,00</b>

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2023		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
<b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2.1. Interest rate swap				
<b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b>	<b>-15.431,32</b>	<b>86,94</b>		
<b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>-2.318,62</b>	<b>13,06</b>	<b>-1.709,88</b>	<b>100,00</b>
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-2.318,62	13,06	-1.709,88	100,00
M5. Passività diverse				
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>-17.749,94</b>	<b>100,00</b>	<b>-1.709,88</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>650.388,50</b>		<b>464.544,30</b>
Numero delle quote in circolazione		137.231,136		106.337,713
Valore unitario delle quote		4,739		4,368

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	13.120,667	18.957,567	10.454,139	13.743,162
Quote rimborsate	5.502,379	947,784	11.543,819	7.388,130

Milano, 19/02/2024

Il Rappresentante della Società



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi

Allegato 2

**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ENEA - LINEA OBBLIGAZIONI PAESI EMERGENTI  
 SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2023**

	Rendiconto al 31-12-2023	Rendiconto esercizio precedente
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI		1.149,58
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.		1.149,58
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	1.039,88	-10.992,73
A2.1. Titoli di debito		
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.	1.039,88	-10.992,73
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	58.855,95	-16.636,47
A3.1. Titoli di debito		
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.	58.855,95	-16.636,47
<b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>	<b>59.895,83</b>	<b>-26.479,62</b>
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>		
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		
<b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>		
<b>C. INTERESSI ATTIVI</b>	<b>853,33</b>	<b>47,01</b>
C1. SU DEPOSITI BANCARI	853,33	47,01
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
<b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>	<b>-6.731,67</b>	<b>15.439,37</b>
D1. RISULTATI REALIZZATI	131,98	5.967,42
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-6.863,65	9.471,95
<b>E. PROVENTI SU CREDITI</b>		
<b>F. ALTRI PROVENTI</b>		
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI		
<b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>	<b>54.017,49</b>	<b>-10.993,24</b>
<b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>		<b>-68,21</b>
G1. Bolli, spese e commissioni		-68,21
<b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>	<b>54.017,49</b>	<b>-11.061,45</b>
<b>H. ONERI DI GESTIONE</b>	<b>-9.177,19</b>	<b>-8.135,86</b>
H1. Commissione di gestione	-8.511,61	-6.483,91
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-665,58	-1.651,95
H4. Altri oneri di gestione		
<b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>		
I1. Altri ricavi		
I2. Altri costi		
<b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>	<b>44.840,30</b>	<b>-19.197,31</b>

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

Rendimento della gestione	8,49	Volatilità della gestione	5,92
Rendimento del benchmark	7,36	Volatilità del benchmark **	
Differenza	1,13	Volatilità dichiarata ***	4,00 - 9,99

\* 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

