

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO ALLEATA BILANCIATA

SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2023

ATTIVITÀ	Situazione al		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	786.951.016,97	95,84	635.053.266,76	96,61
A1. Titoli di debito	386.837.135,86	47,11	322.582.853,74	49,07
A1.1. Titoli di Stato	277.354.463,32	33,78	236.607.408,41	35,60
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	12.333.555,15	1,50	10.400.009,31	1,56
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	97.149.117,39	11,83	75.575.436,02	11,37
A2. Titoli azionari	356.302.392,08	43,39	263.419.254,70	40,07
A3. Parti di O.I.C.R.	43.811.489,03	5,34	49.051.158,32	7,47
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	4.245.212,64	0,52	3.069.760,54	0,46
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	4.245.212,64	0,52	3.069.760,54	0,46
B3. Parti di O.I.C.R.				
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	6.875.715,46	0,84	-10.315.376,57	-1,55
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)			0,00	
C1.1. Future (negoziati)				
C1.2. Warrants / Diritti			0,00	
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	6.875.715,46	0,84	-10.315.376,57	-1,55
C2.1. da definire				
C2.2. da definire				
C2.3. Opzioni (non negoziate)				
C2.4. DCS (non negoziate)	6.875.715,46	0,84	-10.315.376,57	-1,55
C2.5. da definire				
C2.6. da definire				
C2.7. Swap su valute (non negoziati)				
C2.8. Swap su tassi (non negoziati)				
C2.9. Strumenti finanziari derivati (Index)				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	14.149.856,21	1,72	18.803.848,22	2,85
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	4.606.050,87	0,56	6.828.608,14	1,04
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITÀ	4.255.733,67	0,52	3.895.003,25	0,59
H1. Ratei attivi	3.788.309,55	0,46	3.584.765,39	0,54
H2. Altri attivi (da specificare)	467.424,12	0,06	310.237,86	0,05
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	454.650,59	0,06	289.922,01	0,04
H2.3. Retrocessione commissioni	12.773,53		20.315,85	
TOTALE ATTIVITÀ	821.083.585,82	100,00	657.335.110,34	100,00

PASSIVITÀ E NETTO	Situazione al		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale passività	Valore complessivo	% sul totale passività
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE	-18.446.036,02	99,63	-3.047.577,88	99,01
M. ALTRE PASSIVITÀ	-68.720,75	0,37	-30.473,67	0,99
M1. Ratei passivi	0,00		0,00	
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-68.169,17	0,37	-30.473,67	0,99
M5. Passività diverse	-551,58		0,00	
TOTALE PASSIVITÀ	-18.514.756,77	100,00	-3.078.051,55	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		802.568.829,05		654.257.058,79
Numero delle quote in circolazione		58.830.330,520		53.554.526,692
Valore unitario delle quote		13,642		12,217

Movimenti delle quote nell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	3.657.565,243	2.807.583,556	2.938.007,523	5.731.998,871
Quote rimborsate	1.189.096,859	1.329.488,504	1.343.200,517	5.997.565,485

Nice H D'Amico
 S. B. R. R. R.

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO ALLEATA BILANCIATA

SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2023

	Rendiconto al	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	13.730.524,86	11.644.780,70
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	8.052.448,40	6.706.320,25
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	5.678.076,46	4.938.460,45
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.		
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	26.845.459,97	-35.598.679,52
A2.1. Titoli di debito	5.341.289,70	-10.358.655,33
A2.2. Titoli azionari	22.282.563,56	-24.813.220,54
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-778.393,29	-426.803,65
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	56.443.011,69	-94.243.931,82
A3.1. Titoli di debito	14.576.800,46	-55.651.794,60
A3.2. Titoli di capitale	41.563.659,84	-32.940.466,44
A3.3. Parti di O.I.C.R.	302.551,39	-5.651.670,78
Risultato gestione strumenti finanziari	97.018.996,52	-118.197.830,64
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		
B1. RISULTATI REALIZZATI	10.202.102,69	5.376.098,06
B1.1. Su strumenti negoziati	-79.028,27	-98.773,24
B1.2. Su strumenti non negoziati	10.281.130,96	5.474.871,30
B2. RISULTATI NON REALIZZATI	6.872.421,29	-10.874.680,84
B2.1. Su strumenti negoziati	0,00	
B2.2. Su strumenti non negoziati	6.872.421,29	-10.874.680,84
Risultato gestione strumenti finanziari derivati	17.074.523,98	-5.498.582,78
C. INTERESSI ATTIVI	391.517,94	87.647,92
C1. SU DEPOSITI BANCARI	391.517,94	87.647,92
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	-20.952.717,35	7.222.244,54
D1. RISULTATI REALIZZATI		
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-20.952.717,35	7.222.244,54
E. PROVENTI SU CREDITI		
F. ALTRI PROVENTI	1.575.565,70	134.797,62
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI	1.575.565,70	134.797,62
Risultato lordo della gestione di portafoglio	95.107.886,79	-116.251.723,34
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-170.408,37	-279.913,07
G1. Bolli, spese e commissioni	-170.408,37	-279.913,07
Risultato netto della gestione di portafoglio	94.937.478,42	-116.531.636,41
H. ONERI DI GESTIONE	-13.512.500,30	-11.026.482,30
H1. Commissione di gestione	-12.056.991,61	-10.979.934,77
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-17.183,59	-14.172,54
H4. Altri oneri di gestione	-1.438.325,10	-32.374,99
I. ALTRI RICAVI E ONERI	-81.576,07	-135.293,83
I1. Altri ricavi	3.696,29	1.578,89
I2. Altri costi	-85.272,36	-136.872,72
Utile/perdita della gestione del Fondo	81.343.402,05	-127.693.412,54

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	11,67	Volatilità della gestione	5,92
Rendimento del benchmark	14,62	Volatilità del benchmark **	7,38
Differenza	-2,95	Volatilità dichiarata ***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicare soltanto in caso di gestione passiva

*** indicare 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