

**ELENCO DEGLI OICR ED ETF INTERESSATI DALL'ATTIVITA' DI MONITORAGGIO DA PARTE DELLA COMPAGNIA**

La Compagnia, secondo quanto indicato dalle Condizioni di Polizza, svolge un'attività di monitoraggio e di analisi su performance, volatilità e dimensione degli OICR ed ETF volta a garantire il mantenimento degli standard quantitativi degli OICR ed ETF disponibili nel prodotto. Si specifica che ai fini di tale attività, qualora la Compagnia non disponesse dei dati del benchmark di riferimento per alcuni OICR, verrà individuato un altro benchmark avente caratteristiche similari.

**Dati di riferimento: terzo trimestre 2021**  
**I valori in rosso si riferiscono agli OICR ed ETF c.d. "in breach"**

| cerca vert    | Group/Investment                           | Currency | Has a Benchmark? | Underperformance |        |           |           | Volatilità                      |            |                         | Outflows                 |  |  |              |
|---------------|--|----------|------------------|------------------|--------|-----------|-----------|---------------------------------|------------|-------------------------|--------------------------|--|--|--------------|
|               |  |          |                  | Luglio           | Agosto | Settembre | Trimestre | Volatilità Trimestre Precedente | Volatilità | Volatilità annualizzata | AUM netto Entrate/Uscite | Dimensione dell'OICR alla fine del Trimestre |  |              |
| IE0006BNGP67  | Invesco Elwood Global Blockchain ETF       | Euro     | yes              | -8,26            | 1,56   | -0,55     | -7,40     |                                 |            | 26,31                   | -3,87%                   | 869.246.663                                  | MSCI World/Information Tech NR USD       |              |
| LU18127795864 | BGF ESG Emerging Markets Blind Bd D2 EURH  | Euro     | yes              | -0,73            | -0,26  | -1,04     | -2,02     |                                 |            | 4,06                    | 3,53%                    | 61.357.000                                   | JPM EMBI Global Diversified Hedge TR EUR |              |
| LU1817799351  | BGF ESG Emerging Markets Bond D2 EUR H     | Euro     | yes              | -0,70            | 0,03   | -0,06     | -0,72     |                                 |            | 2,04                    | 4,99%                    | 456.049.660                                  | JPM EMBI Global Diversified Hedge TR EUR |              |
| LU1817796326  | BGF ESG Emerging Markets Corp Bd D2 EURH   | Euro     | yes              | 0,11             | 0,14   | -0,03     | 0,22      |                                 |            | 1,31                    | 24,23%                   | 97.166.679                                   | JPM CEMBI Broad Diversified Hdg TR EUR   |              |
| LU1817794628  | BGF ESG Emerging Mkts Lcl Ccy Bd D2 EURH   | Euro     | no               | -0,71            | 0,41   | -3,56     | -3,85     | 6,15                            | 5,33       |                         | 4,90%                    | 356.083.929                                  | No Benchmark                             |              |
| LU0473185139  | BGF ESG Multi-Asset D2 EUR                 | Euro     | yes              | 0,54             | 0,60   | 0,15      | 1,30      |                                 |            | 2,95                    | 22,38%                   | 3.765.574.227                                | Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR  |              |
| LU1435395808  | BSF ESG Euro Bond D2 EUR                   | Euro     | yes              | -0,12            | 0,16   | -0,27     | -0,22     |                                 |            | 1,20                    | 7,31%                    | 630.782.139                                  | Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR           |              |
| LU1908247130  | BSF ESG Euro Corporate Bond D2 EUR         | Euro     | yes              | -0,18            | 0,12   | -0,22     | -0,18     |                                 |            | 0,62                    | 3,17%                    | 286.238.572                                  | Bloomberg Euro Corp TR EUR               |              |
| LU1254583435  | BSF Systematic ESG World Equity D2 EUR     | Euro     | yes              | 0,10             | -0,21  | 1,22      | 1,16      |                                 |            | 6,53                    | -3,19%                   | 316.277.720                                  | MSCI World NR USD                        |              |
| LU1507918209  | CSIF (Lux) Equity EmMkts ESG Blue QB EUR   | Euro     | yes              | 0,01             | -0,05  | -0,02     | -0,06     |                                 |            | 0,10                    | 9,15%                    | 3.296.904.679                                | MSCI EM ESG Leaders NR USD               |              |
| LU1815002479  | CSIF (Lux) Equity EMUJ ESG Blue QB EUR     | Euro     | yes              | 0,01             | -0,01  | 0,16      | 0,17      |                                 |            | 0,42                    | 3,23%                    | 1.528.164.462                                | MSCI EMU ESG Leaders NR LCL              |              |
| LU0145657366  | DWS Invest ESG Euro Bonds (Short) FC       | Euro     | yes              | 0,03             | 0,07   | -0,08     | 0,02      |                                 |            | 0,18                    | 5,84%                    | 1.314.856.956                                | Markit iBoxx EUR Overall 1-3 TR          |              |
| LU1652387454  | Eurizon Bond Corporate Smart Esg Z EUR     | Euro     | yes              | -0,07            | -0,08  | -0,02     | -0,17     |                                 |            | 0,46                    | 13,07%                   | 284.652.833                                  | Bloomberg Euro Corp TR EUR               |              |
| LU1103307663  | GS Absolute Ret Trkr I Acc EUR Hdg         | Euro     | no               | -0,64            | 0,96   | -1,99     | -1,67     | 4,96                            | 5,17       |                         | 30,55%                   | 968.458.871                                  | No Benchmark                             |              |
| LU0622306495  | GS EM Corp Bd I Acc EUR Hdg                | Euro     | yes              | -0,19            | -0,14  | -0,27     | -2,43     |                                 |            | 4,69                    | -1,26%                   | 3.689.516.982                                | JPM CEMBI Broad Diversified TR USD       |              |
| LU0242506524  | GS EM Mkts Dbl I Acc EUR Hdg               | Euro     | yes              | -0,19            | -0,08  | -1,74     | -2,03     |                                 |            | 4,69                    | -7,54%                   | 4.218.214.914                                | JPM EMBI Global Diversified TR USD       |              |
| LU2075335302  | GS Emerging Markets Esg ESG I Acc EUR      | Euro     | yes              | 1,52             | 1,18   | -0,32     | 1,39      |                                 |            | 7,73                    | 9,00%                    | 404.478.188                                  | MSCI EM NR EUR                           |              |
| LU1357028627  | GS Emerging Markets Eq I Acc EUR           | Euro     | yes              | 1,51             | -0,29  | 0,11      | 1,36      |                                 |            | 7,63                    | 4,82%                    | 4.355.019.819                                | MSCI EM NR USD                           |              |
| LU0494455123  | GS Emerging Mkts Dbl Lcl I Acc EUR         | Euro     | yes              | 0,05             | -0,25  | 0,67      | 0,48      |                                 |            | 2,85                    | -1,91%                   | 1.412.288.432                                | JPM GBI-EM Global Diversified TR USD     |              |
| LU1055657629  | GS ESG Enh Eur HY Bd I Acc EUR             | Euro     | yes              | 0,01             | -0,03  | -0,01     | -0,03     |                                 |            | 4,45                    | 14,33%                   | 94.478.736                                   | ICE BofA Euran Ccy HY Constnd TR HEUR    |              |
| LU0234682044  | GS Europe CORE Equity I Acc EUR            | Euro     | yes              | 0,73             | -0,38  | -0,60     | -0,28     |                                 |            | 6,31                    | -1,45%                   | 1.722.334.486                                | MSCI Europe NR EUR                       |              |
| LU0328436547  | GS Gbl Sm Cp CORE Eq I Acc EUR Snap        | Euro     | yes              | 1,12             | -0,69  | 1,33      | 1,82      |                                 |            | 10,69                   | 3,49%                    | 623.948.129                                  | S&P Developed Small NR USD               |              |
| LU0208851410  | GS Gbl Fxd Inc Plus (Hdg) I Acc EUR        | Euro     | yes              | -0,05            | -0,44  | -1,13     | 0,30      |                                 |            | 10,06%                  | 1.832.415.179            | Bloomberg Global Aggregate TR Hdg EUR        |  |              |
| LU0208842005  | GS Gbl HI Yld I Acc EUR Hdg                | Euro     | yes              | -0,18            | -0,77  | -1,70     | -2,68     |                                 |            | 5,07                    | -1,63%                   | 2.666.833.593                                | Bloomberg US HY 2% Issuer Cap TR USD     |              |
| LU1135780176  | GS Gbl Strat Macro Bd I Acc EUR Hdg        | Euro     | no               | -0,70            | 0,32   | 0,27      | -0,11     | 2,71                            | 2,26       |                         | -3,12%                   | 322.376.199                                  | No Benchmark                             |              |
| LU0208841296  | GS Global CORE Eq I Acc EUR Close          | Euro     | yes              | 0,29             | 0,87   | -0,67     | 0,44      |                                 |            | 3,43                    | 7,18%                    | 3.571.862.566                                | MSCI World NR USD                        |              |
| LU0600090953  | GS Global Dyn Bd Pl Port I Acc EUR H       | Euro     | yes              | -0,14            | 0,42   | -1,11     | -1,84     |                                 |            | 4,79                    | 3,62%                    | 1.123.902.957                                | ICE LIBOR 3 Month USD                    |              |
| LU0417259313  | GS Global Equity Ptnrs I Acc EUR           | Euro     | yes              | 1,76             | -0,54  | 1,35      | 2,65      |                                 |            | 6,51                    | 19,69%                   | 1.386.998.573                                | MSCI World NR USD                        |              |
| LU1759633750  | GS Global MA Cnsv I Acc EUR PHH            | Euro     | yes              | -0,32            | 0,58   | -0,27     | -0,01     |                                 |            | 2,75                    | 2,22%                    | 413.830.592                                  | Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR  |              |
| LU1081142314  | GS Global MA Inc I Acc EUR Prty Hdg        | Euro     | yes              | -0,06            | -0,44  | 0,47      | -0,02     |                                 |            | 3,46                    | 51,99%                   | 2.474.675.695                                | Morningstar EU Mod Gbl Tgt Alloc NR EUR  |              |
| LU1820776075  | GS Global Millenials Eq I Acc EUR          | Euro     | yes              | -2,62            | -1,15  | -0,22     | -2,99     |                                 |            | 10,64                   | 6,49%                    | 2.333.332.752                                | MSCI ACWI Growth NR USD                  |              |
| LU1242773882  | GS India Equity I Acc EUR                  | Euro     | yes              | 3,13             | -2,99  | -0,38     | -0,11     |                                 |            | 6,85                    | 7,81%                    | 2.204.863.734                                | MSCI India IMI NR USD                    |              |
| LU0909885758  | GS Japan Equity I Acc EUR Hdg              | Euro     | yes              | 1,54             | -0,04  | 0,45      | 2,08      |                                 |            | 12,19                   | 8,76%                    | 1.330.140.444                                | TOPIX TR JPY                             |              |
| LU0280851253  | GS US Mrtgsg Bkfd Secs I Acc EUR Hdg       | Euro     | yes              | -0,19            | -0,29  | 0,55      | -2,55     |                                 |            | 4,48                    | -2,77%                   | 249.345.019                                  | Bloomberg US Srtzd MBS ABS CMB TR USD    |              |
| LU0883503087  | GS US Rtsctt Ball I Acc EUR Hdg            | Euro     | no               | 2,50             | 0,44   | -2,09     | 0,80      | 5,57                            | 5,03       |                         | 0,00                     | -1,84%                                       | 190.725.736                              | No Benchmark |
| LU1254821553  | GS Fx Gbl Mlt-Mgr Alts I Acc EUR H Acc     | Euro     | yes              | 0,74             | 1,35   | -1,93     | 0,14      |                                 |            | 4,59                    | 6,07%                    | 286.816.624                                  | ICE LIBOR 3 Month USD                    |              |
| LU0288890789  | Kairos Intl SICAV Europe ESG P             | Euro     | yes              | 0,24             | 0,14   | -0,20     | 0,17      |                                 |            | 2,02                    | 46,01%                   | 109.005.694                                  | MSCI Europe NR EUR                       |              |
| LU2008814787  | M&G (Lux) EM Corp ESG Bd CH EUR Acc        | Euro     | yes              | -0,41            | -0,37  | -1,99     | -2,80     |                                 |            | 4,21                    | 2,82%                    | 33.796.390                                   | JPM CEMBI Broad Diversified TR USD       |              |
| LU1665236136  | M&G (Lux) Global HY ESG Bd CH EUR Acc      | Euro     | yes              | -0,03            | -0,28  | 0,05      | -2,38     |                                 |            | 4,36                    | 7,00%                    | 78.424.522                                   | ICE BofA Gbl HY TR USD                   |              |
| IE00BYXVX196  | PIMCO GIS Global Bond ESG Instl EUR Acc    | Euro     | yes              | -0,24            | -0,07  | 0,04      | -0,27     |                                 |            | 0,87                    | 36,59%                   | 1.894.583.135                                | Bloomberg Global Aggregate TR Hdg USD    |              |
| IE00BFZPF322  | Invesco AT1 Capital Bond ETF               | Euro     | no               | 0,20             | 0,81   | 1,61      | 2,64      | 5,69                            | 5,28       |                         | -9,72%                   | 1.290.895.680                                | No Benchmark                             |              |
| IE00B6DFTQ80  | Invesco Bloomberg Commodity ETF            | Euro     | yes              | 1,95             | -0,14  | 0,14      | 2,07      |                                 |            | 7,41                    | 9,59%                    | 1.246.578.229                                | Bloomberg Commodity TR USD               |              |
| IE00BGSQ3Q90  | iShares \$CorpBd 0-3y ESG UCITS ETF€ H Acc | Euro     | no               | 0,08             | -0,17  | 0,12      | 0,03      | 1,76                            | 1,95       |                         | 21,54%                   | 245.625.749                                  | No Benchmark                             |              |
| DE000A0F5U17  | iShares STOXX Europe 600 Banks (DE)        | Euro     | yes              | -0,33            | -0,11  | 0,20      | -0,27     |                                 |            | 9,84                    | -5,89%                   | 1.257.293.922                                | STOXX Europe 600 Banks NR EUR            |              |
| DE000A0H08M3  | iShares STOXX Europe 600 Oil & Gas (DE)    | Euro     | yes              | -0,12            | 0,78   | -0,77     | -0,07     |                                 |            | 8,00                    | -9,90%                   | 1.721.919.000                                | STOXX Europe 600 Oil&Gas NR EUR          |              |
| IE000A0F5U11  | iShares STOXX Global Sel Div 100 (DE)      | Euro     | yes              | 0,30             | -0,44  | -0,18     | -0,03     |                                 |            | 4,00                    | -7,64%                   | 1.674.831.169                                | STOXX Global Select Dividend 100 NR EUR  |              |
| DE0005933931  | iShares Core DAX* ETF (DE) Acc             | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 2,92                    | -4,67%                   | 6.749.445.355                                | FSE DAX TR EUR                           |              |
| DE000A0H0728  | iShares Diversified Commodity Swap (DE)    | Euro     | yes              | 1,87             | -0,17  | 0,11      | 1,93      |                                 |            | 7,26                    | -11,36%                  | 439.348.952                                  | Bloomberg Commodity TR EUR               |              |
| IE00BDFL4P12  | iShares Diversified Commodity Swap ETF     | Euro     | yes              | 1,87             | -0,06  | -0,14     | 1,80      |                                 |            | 7,30                    | -4,13%                   | 1.774.204.421                                | Bloomberg Commodity TR USD               |              |
| IE00BYZTVV78  | iShares € Corp Bond 0-3yr ESG ETF € Dist   | Euro     | yes              | -0,04            | -0,14  | 0,09      | -0,09     |                                 |            | 0,95                    | 19,68%                   | 2.321.490.374                                | Bloomberg Euro Agg Corp 1-3 Yr TR EUR    |              |
| IE00B57X3V84  | iShares Dow Jones Gbl Sust Scrn ETF \$Acc  | Euro     | yes              | 0,38             | 0,15   | 0,31      | 0,85      |                                 |            | 4,56                    | 10,27%                   | 513.114.459                                  | MSCI ACWI NR USD                         |              |
| IE00B3DKXQ41  | iShares € Aggregate Bond ETF EUR Dist      | Euro     | yes              | -0,05            | -0,02  | -0,01     | -0,08     |                                 |            | 0,82                    | -1,12%                   | 1.913.129.205                                | Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR           |              |
| IE00B4L60045  | iShares € Corp Bond 1-5yr ETF EUR Dist     | Euro     | yes              | -0,01            | -0,05  | 0,00      | -0,06     |                                 |            | 0,34                    | -3,45%                   | 4.017.457.456                                | Bloomberg Euro Corp bonds 1-5Yr TR EUR   |              |
| IE00B4L5ZG21  | iShares € Corp Bond ex-Fncld ETF EUR Dist  | Euro     | yes              | 0,03             | 0,04   | -0,10     | -0,04     |                                 |            | 2,35                    | 6,42%                    | 1.648.847.084                                | Bloomberg Euro Agg Corp Ex Fncld TR EUR  |              |
| IE00B388Q275  | iShares € Covered Bond ETF EUR Dist        | Euro     | yes              | -0,01            | -0,04  | 0,03      | -0,03     |                                 |            | 0,46                    | -10,24%                  | 961.372.992                                  | Markit iBoxx EUR Covered TR              |              |
| IE00B4WJXJ64  | iShares Core € Govt Bond ETF EUR Dist      | Euro     | yes              | 0,04             | 0,66   | -0,77     | -0,08     |                                 |            | 2,96                    | 3,71%                    | 4.097.154.590                                | Bloomberg Euro Agg Treasury TR EUR       |              |
| IE00B3CRV6557 | iShares € Ultrashort Bond ETF EUR Dist     | Euro     | yes              | -0,02            | 0,07   | -0,04     | 0,01      |                                 |            | 0,28                    | 7,20%                    | 3.573.647.601                                | FTSE EUR EuroDepg 3 Mon EUR              |              |
| IE00BYZK4669  | iShares Ageing Population ETF USD Acc      | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 8,27                    | 21,75%                   | 817.718.869                                  | MSCI ACWI NR USD                         |              |
| IE00BYZK4552  | iShares Automation&Robotics ETF USD Acc    | Euro     | yes              | -1,46            | -0,84  | 2,02      | -0,16     |                                 |            | 10,36                   | -1,76%                   | 3.263.725.164                                | MSCI World/Information Tech NR USD       |              |
| IE00BYZK4883  | iShares Digitalisation ETF USD Acc         | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 10,24                   | -2,38%                   | 1.378.969.490                                | MSCI World/Information Tech NR USD       |              |
| IE00BYZK4776  | iShares Healthcare Innov ETF USD Acc       | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 14,80                   | 1,37%                    | 2.077.455.478                                | MSCI World/Health Care NR USD            |              |
| IE00BP3Q2R25  | iShares Edge MSCI Wid Mom Fctr ETF \$ Acc  | Euro     | yes              | 0,11             | 0,16   | 0,46      | 0,77      |                                 |            | 6,10                    | -0,82%                   | 2.504.057.154                                | MSCI World Momentum NR USD               |              |
| IE00BP3QZB59  | iShares Edge MSCI Wid Val Fctr ETF \$Acc   | Euro     | yes              | 0,32             | -0,22  | 0,31      | 0,42      |                                 |            | 5,69                    | -5,99%                   | 5.687.788.103                                | MSCI World Enhanced Value NR USD         |              |
| IE00BKP5L730  | iShares JP Morgan ESG 5 EM Bd ETF EURH Acc | Euro     | yes              | -0,17            | 0,62   | 0,50      | -0,08     |                                 |            | 6,26                    | 6,16%                    | 1.615.772.433                                | JPM EMBI Global Diversified Hedge TR EUR |              |
| IE00BYJRP778  | iShares MSCI EM SRI ETF USD Acc            | Euro     | yes              | 0,53             | -0,14  | 0,42      | 0,81      |                                 |            | 9,50                    | 27,88%                   | 2.619.104.957                                | MSCI EM NR USD                           |              |
| IE00B52V1196  | iShares MSCI Europe SRI ETF EUR Acc        | Euro     | yes              | 1,29             | 1,52   | -1,53     | 1,17      |                                 |            | 3,76                    | 8,98%                    | 4.337.228.057                                | MSCI Europe NR EUR                       |              |
| IE00BYJRR92   | iShares MSCI USA SRI ETF USD Acc           | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 6,81                    | 6,74%                    | 7.111.873.606                                | Russel 1000 TR USD                       |              |
| IE00BYZJ2D69  | iShares MSCI World SRI ETF EUR Acc         | Euro     | yes              | 0,00             | 0,00   | 0,00      | 0,00      |                                 |            | 5,81                    | 12,84%                   | 4.436.398.369                                | MSCI ACWI NR USD                         |              |
| IE0032523478  | iShares € Corp Bond Lg Cp ETF EUR Dist     | Euro     | yes              | -0,07            | -0,04  | 0,04      | -0,07     |                                 |            | 0,90                    | -4,35%                   | 2.723.464.961                                | Markit iBoxx EUR Liquid Corp Large TR    |              |
| IE00B6F4759   | iShares € High Yield CorpBd ETF EUR Dist   | Euro     | yes              | 0,15             | -0,28  | -0,12     | -0,25     |                                 |            | 1,35                    | 3,75%                    | 5.680.299.372                                | Markit iBoxx Liquid High Yield TR EUR    |              |
| IE00B0M62X26  | iShares € Inflat Lnkld GovtBd ETF EUR Acc  | Euro     | yes              | -0,04            | -0,08  | 0,00      | -0,12     |                                 |            | 0,97                    | 9,64%                    | 1.828.520.236                                | Bloomberg Euro Govt Intl Lkd TR EUR      |              |
| IE00BKM4G266  | iShares Core MSCI EM IMI ETF USD Acc       | Euro     | yes              | 0,62             | -0,99  | 0,87      | 0,54      |                                 |            | 8,52                    | -0,58%                   | 16.182.591.193                               | MSCI EM IMI NR USD                       |              |
| IE00B0M62572  | iShares Euro Dividend ETF EUR Dist         | Euro     | yes              | -0,08            | 0,01   | -0,07     | -0,14     |                                 |            | 1,01                    | -21,18%                  | 875.731.026                                  | EURO STOXX Select Dividend 30 NR EUR     |              |
| IE00B0M63284  | iShares European Prpty Yld ETF EUR Dist    | Euro     | yes              | 0,16             | -0,01  | 0,02      | 0,17      |                                 |            | 1,20                    | 0,89%                    | 1.828.218.686                                | FTSE EPRA Nareit Div Ex Eur Diw NR EUR   |              |
| IE00B6R52036  | iShares Gold Producers ETF USD Acc         | Euro     | yes              | 0,07             | -0,29  | 1,45      | 1,19      |                                 |            | 10,24                   | 2,81%                    | 1.514.089.001                                | S&P Commodity Producers Gold NR USD      |              |
| IE00B4Z25144  | iShares MSCI Japan EUR Hedged ETF Acc      | Euro     | yes              | 0,83             | -0,95  | -0,13     | -0,21     |                                 |            |                         |                          |  |  |              |