

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO¹

PERIODO DI OSSERVAZIONE: 1 gennaio 2012 - 31 dicembre 2012

CATEGORIA DI ATTIVITÀ	POSTA VALOREPIU'	
	valori in euro	
	CODICE IMPRESA: 432 Redatto il 28/02/2013	CODICE GESTIONE: 002 valori in euro
	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2012) Importi da libro mastro ²	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2011) Importi da libro mastro ²
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	37.754.768.831	33.298.358.982
101 BTP	27.470.956.239	23.976.176.895
102 CCT	1.251.603.173	1.441.649.378
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	2.368.877.120	2.904.883.782
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta		
105 Obbligazioni quotate in euro	6.608.935.294	4.876.605.639
106 Obbligazioni quotate in valuta		
107 Obbligazioni non quotate in euro	54.397.005	99.043.288
108 Obbligazioni non quotate in valuta		
150 Altre tipologie di titoli di debito di cui:		
151 Altri titoli di debito		
200 Titoli di capitale:		
201 Azioni quotate in euro		
202 Azioni non quotate in euro		
203 Azioni quotate in valuta		
204 Azioni non quotate in valuta		
250 Altre tipologie di titoli di capitale di cui:		
251 Warrants		
300 Altre attività patrimoniali:	3.681.747.427	3.270.410.350
301 Immobili		
302 Prestiti		
303 Quote di OICR	2.262.386.853	2.593.816.461
304 Strumenti derivati		
305 Liquidità	891.028.115	216.993.927
350 Altre tipologie di attività di cui:	528.332.459	459.599.962
351 Ratei	528.332.459	459.599.962
400 Passività patrimoniali:		
401 Debiti per spese di revisione contabile		
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività		
1000 Saldo attività della gestione separata	41.436.516.258	36.568.769.332
	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2012)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2011)
Riserve matematiche	41.068.780.000	36.201.013.418
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 ³		
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 ⁴		
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 ⁵		

¹ valuta di denominazione della gestione separata

² al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n.38 del 3 giugno 2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

³ da compilare solo se l'importo è maggiore dell'1% del totale delle riserve matematiche

⁴ da compilare solo se l'importo è maggiore dell'1% del totale dei premi del periodo di osservazione

⁵ da compilare solo se l'importo è maggiore dell'1% degli oneri relativi a sinistri sostenuti nel periodo di osservazione

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO¹

PERIODO DI OSSERVAZIONE: 1 gennaio 2012 - 31 dicembre 2012

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIE DI ATTIVITÀ	POSTA VALOREPIU'	
	valori in euro	
	CODICE IMPRESA: 432 Redatto il 28/02/2013	CODICE GESTIONE: 002 valori in euro
	IMPORTI	
Proventi ed oneri distinti per categorie di attività		
100 Proventi da investimenti A		1.566.989.013
101 Interessi su titoli di Stato in euro		1.311.905.131
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		218.546.856
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		
105 Dividendi su azioni in euro		
106 Dividendi su azioni in valuta		
107 Redditi degli investimenti immobiliari		
150 Altre tipologie di proventi di cui:		36.537.026
151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		6.615.625
152 Interessi ed altri proventi su Quote di OICR		29.921.401
200 Utili/perdite da realizzati B		-3.220.121
201 Titoli di Stato in euro		53.897.992
202 Titoli di Stato in valuta		
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		19.502.570
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro		
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta		
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta		
207 Titoli azionari quotati in euro		
208 Titoli azionari non quotati in euro		
209 Titoli azionari in valuta quotati		
210 Titoli azionari in valuta non quotati		
211 Immobili		
212 Cambi		
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui:		-76.620.682
251 Utili/perdite su altre attività finanziarie		
252 Utili/perdite su Quote di OICR		-76.620.682
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità C		
400 Risultato finanziario lordo A+B+C		1.563.768.893
500 Spese di revisione contabile D		6.000
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività E		
700 Risultato finanziario netto A+B+C-D-E		1.563.762.893
800 Giacenza media delle attività investite		38.776.377.130
Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione		4,03%
Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione *		Tasso realizzato *
dal 01/02/11 al 31/01/12		3,69%
dal 01/03/11 al 29/02/12		3,73%
dal 01/04/11 al 31/03/12		3,77%
dal 01/05/11 al 30/04/12		3,85%
dal 01/06/11 al 31/05/12		3,88%
dal 01/07/11 al 30/06/12		3,95%
dal 01/08/11 al 31/07/12		4,01%
dal 01/09/11 al 31/08/12		4,06%
dal 01/10/11 al 30/09/12		4,11%
dal 01/11/11 al 31/10/12		4,14%
dal 01/12/11 al 30/11/12		4,25%
dal 01/01/12 al 31/12/12		4,03%

¹ valuta di denominazione della gestione separata

* compilato ai sensi dell'art. 11 del Regolamento ISVAP n.38 del 3 giugno 2011