

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) REALE LINEA OBBLIGAZIONARIA**  
**SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2021**

Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2021		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>78.606.203,53</b>	<b>96,07</b>	<b>82.718.925,99</b>	<b>96,48</b>
<b>A1. Titoli di debito</b>				
A1.1. Titoli di Stato				
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
<b>A2. Titoli azionari</b>				
<b>A3. Parti di O.I.C.R.</b>	78.606.203,53	96,07	82.718.925,99	96,48
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>				
<b>B1. Titoli di debito</b>				
B1.1. Titoli di Stato				
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili				
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
<b>B2. Titoli azionari</b>				
<b>B3. Parti di O.I.C.R.</b>				
<b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
<b>C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)</b>				
C1.1. Warrant				
C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio				
<b>C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)</b>				
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b>				
<b>E. DEPOSITI BANCARI</b>	<b>3.197.044,16</b>	<b>3,91</b>	<b>3.018.110,05</b>	<b>3,52</b>
<b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b>	<b>13.818,20</b>	<b>0,02</b>		
<b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>				
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>				
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)				
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni Retrocedute				
H2.4. Crediti tax reclaim				
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>81.817.065,89</b>	<b>100,00</b>	<b>85.737.036,04</b>	<b>100,00</b>

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2021		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>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>-145.932,93</b>	<b>100,00</b>	<b>-150.579,25</b>	<b>100,00</b>
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-145.932,93	100,00	-150.579,25	100,00
M5. Passività diverse				
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>-145.932,93</b>	<b>100,00</b>	<b>-150.579,25</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>81.671.132,96</b>		<b>85.586.456,79</b>
<b>Numero delle quote in circolazione</b>		5.213.160.901		5.452.220.942
<b>Valore unitario delle quote</b>		15,666		15,697

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	117.616,253	355.033,766	104.936,384	245.116,163
Quote rimborsate	246.967,087	243.537,052	229.908,179	341.350,289

Torino, 31/01/2022

Il Rappresentante della Società

*Giuseppe Lanterna*

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi

Allegato 2

**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) REALE LINEA OBBLIGAZIONARIA  
 SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2021**

	Rendiconto al 31-12-2021		Rendiconto esercizio precedente	
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	10.264,15			
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.	10.264,15			
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	452.327,42		-219.010,55	
A2.1. Titoli di debito				
A2.2. Titoli azionari				
A2.3. Parti di O.I.C.R.	452.327,42		-219.010,55	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	-227.846,71		3.846.466,26	
A3.1. Titoli di debito				
A3.2. Titoli di capitale				
A3.3. Parti di O.I.C.R.	-227.846,71		3.846.466,26	
<b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>		<b>234.744,86</b>		<b>3.627.455,71</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>				
C1. SU DEPOSITI BANCARI				
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
<b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>				
D1. RISULTATI REALIZZATI	217.925,93		-225.685,00	
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	88.955,71		21.525,35	
	128.970,22		-247.210,35	
<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>452.670,79</b>		<b>3.401.770,71</b>
<b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>				
G1. Bolli, spese e commissioni	-15.074,48		-6.907,05	
	-15.074,48		-6.907,05	
<b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>		<b>437.596,31</b>		<b>3.394.863,66</b>
<b>H. ONERI DI GESTIONE</b>				
H1. Commissione di gestione	-590.022,95		-582.057,75	
H2. Spese pubblicazione quota	-588.794,95		-580.139,77	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-1.228,00		-1.917,98	
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>-152.426,64</b>		<b>2.812.805,91</b>

**SEZIONE DI CONFRONTO \***

Rendimento della gestione	-0,20	Volatilità della gestione	2,55
Rendimento del benchmark	0,15	Volatilità del benchmark **	
Differenza	-0,35	Volatilità dichiarata ***	1,00 / 8,00

\* 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

Torino, 31/01/2022

Il Rappresentante della Società

