

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) REALE LINEA PRUDENTE
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 |
| A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 216.266.893,62 | 95,56 | 216.936.614,75 | 96,22 |
| A1. Titoli di debito | 216.266.893,62 | 95,56 | 216.936.614,75 | 96,22 |
| A1.1. Titoli di Stato | 216.266.893,62 | 95,56 | 216.936.614,75 | 96,22 |
| 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. | | | | |
| B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI | | | | |
| 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. | | | | |
| C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| C1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| C1.1. Warrant | | | | |
| C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio | | | | |
| C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE | | | | |
| E. DEPOSITI BANCARI | 8.380.328,28 | 3,70 | 6.098.234,53 | 2,70 |
| F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare | | | 401.148,48 | 0,18 |
| G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | | | |
| H. ALTRE ATTIVITA' | 1.685.433,55 | 0,74 | 2.013.914,15 | 0,89 |
| H1. Ratei attivi | 1.685.433,55 | 0,74 | 2.013.914,15 | 0,89 |
| H2. Altri attivi (da specificare) | | | | |
| H2.1. Crediti d'imposta | | | | |
| H2.2. Crediti per ritenute | | | | |
| H2.3. Commissioni Retrocedute | | | | |
| H2.4. Crediti tax reclaim | | | | |
| TOTALE ATTIVITA' | 226.332.655,45 | 100,00 | 225.449.911,91 | 100,00 |

| PASSIVITA' E NETTO | Situazione al 31-12-2021 | | Situazione a fine esercizio precedente | |
|--|--------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale | Valore complessivo | % sul totale |
| I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | | | |
| I1. Negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente) | | | | |
| I2.1. Interest rate swap | | | | |
| L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE | -625.732,55 | 76,01 | | |
| M. ALTRE PASSIVITA' | -197.528,98 | 23,99 | -195.075,03 | 100,00 |
| M1. Ratei passivi | | | | |
| M2. Spese pubblicazione quota | | | | |
| M3. Spese revisione rendiconto | | | | |
| M4. Commissione di gestione | -197.528,98 | 23,99 | -195.075,03 | 100,00 |
| M5. Passività diverse | | | | |
| TOTALE PASSIVITA' | -823.261,53 | 100,00 | -195.075,03 | 100,00 |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | | 225.509.393,92 | | 225.254.836,88 |
| Numero delle quote in circolazione | | 12.965.353,890 | | 12.498.219,413 |
| Valore unitario delle quote | | 17,393 | | 18,022 |

| Movimenti delle quote dell'esercizio | I trimestre | II trimestre | III trimestre | IV trimestre |
|--------------------------------------|-------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 445.200,152 | 187.945,803 | 187.161,715 | 514.121,795 |
| Quote rimborsate | 267.436,149 | 196.570,333 | 124.656,362 | 278.632,144 |

Torino, 31/01/2022

Il Rappresentante della Società



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

Allegato 2

| | Rendiconto al 31-12-2021 | Rendiconto esercizio precedente |
|---|--------------------------|---------------------------------|
| A. STRUMENTI FINANZIARI | | |
| A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI | 4.144.471,85 | 4.635.087,10 |
| A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito | 4.144.471,85 | 4.635.087,10 |
| A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari | | |
| A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R. | | |
| A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI | -2.213.122,59 | 99.086,94 |
| A2.1. Titoli di debito | -2.213.122,59 | 99.086,94 |
| A2.2. Titoli azionari | | |
| A2.3. Parti di O.I.C.R. | | |
| A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE | -9.126.905,84 | 5.362.492,31 |
| A3.1. Titoli di debito | -9.126.905,84 | 5.362.492,31 |
| A3.2. Titoli di capitale | | |
| A3.3. Parti di O.I.C.R. | | |
| Risultato gestione strumenti finanziari | -7.195.556,58 | 10.096.666,35 |
| B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI | | |
| 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 | | |
| Risultato gestione strumenti finanziari derivati | | |
| C. INTERESSI ATTIVI | | |
| C1. SU DEPOSITI BANCARI | | |
| C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI | | |
| D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | | |
| D1. RISULTATI REALIZZATI | | |
| D2. RISULTATI NON REALIZZATI | | |
| E. PROVENTI SU CREDITI | | |
| F. ALTRI PROVENTI | | |
| F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI | | |
| F2. PROVENTI DIVERSI | | |
| Risultato lordo della gestione di portafoglio | -7.195.556,58 | 10.096.666,35 |
| G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | -56.703,65 | -70.627,31 |
| G1. Bolli, spese e commissioni | -56.703,65 | -70.627,31 |
| Risultato netto della gestione di portafoglio | -7.252.260,23 | 10.026.039,04 |
| H. ONERI DI GESTIONE | -802.052,86 | -774.651,14 |
| H1. Commissione di gestione | -783.422,39 | -754.851,51 |
| H2. Spese pubblicazione quota | | |
| H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia | -8,00 | -8,00 |
| H4. Altri oneri di gestione | -18.622,47 | -19.791,63 |
| I. ALTRI RICAVI E ONERI | | |
| I1. Altri ricavi | | |
| I2. Altri costi | | |
| Utile/perdita della gestione del Fondo | -8.054.313,09 | 9.251.387,90 |

SEZIONE DI CONFRONTO *

| | | | |
|---------------------------|-------|-----------------------------|-------------|
| Rendimento della gestione | -3,49 | Volatilità della gestione | 3,26 |
| Rendimento del benchmark | -3,39 | Volatilità del benchmark ** | |
| Differenza | -0,10 | 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

