

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) TWIN SELECTION
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2019

Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2019		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	108.804.069,84	98,97	39.814.836,81	95,29
A1. Titoli di debito				
A1.1. Titoli di Stato				
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.	108.804.069,84	98,97	39.814.836,81	95,29
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)				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	531.127,84	0,48	1.897.601,73	4,54
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	605.240,2	0,55	69.836,72	0,17
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'				
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)				
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
TOTALE ATTIVITA'	109.940.437,85	100,00	41.782.275,26	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2019		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	-192.121,48	20,50		
M. ALTRE PASSIVITA'	-745.270,48	79,50	-274.353,06	100,00
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto	-6.000,00	0,64	-876,00	0,32
M4. Commissione di gestione	-739.270,48	78,86	-273.477,06	99,68
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'	-937.391,96	100,00	-274.353,06	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		109.003.045,89		41.507.922,20
Numero delle quote in circolazione		1.033.210,619		446.050,050
Valore unitario delle quote		105,50		93,06

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	137.468,68	155.420,43	134.515,8	194.223,0
Quote rimborsate	2.847,56	9.873,72	11.659,3	10.086,8

Roma, 31 gennaio 2020

BancAssurance Popolari S.p.A.

	Rendiconto al 31-12-2019	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	166.033,09	82.071,51
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	5,01	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari		
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	166.028,08	82.071,51
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	2.634.761,56	-128.415,46
A2.1. Titoli di debito	30,54	
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.	2.634.731,02	-128.415,46
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	6.221.574,18	-1.970.994,61
A3.1. Titoli di debito		
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.	6.221.574,18	-1.970.994,61
Risultato gestione strumenti finanziari	9.022.368,83	-2.017.338,56
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	114.719,08	38.390,93
D1. RISULTATI REALIZZATI	124.738,94	-1.061,67
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-10.019,86	39.452,60
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	9.137.087,91	-1.978.947,63
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-14.348,62	-7.284,57
G1. Bolli, spese e commissioni	-14.348,62	-7.284,57
Risultato netto della gestione di portafoglio	9.122.739,29	-1.986.232,20
H. ONERI DI GESTIONE	-1.200.595,97	-318.646,48
H1. Commissione di gestione	-1.194.415,99	-307.768,50
H2. Spese pubblicazione quota		-4.877,98
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-6.179,98	-6.000,00
H4. Altri oneri di gestione		
I. ALTRI RICAVI E ONERI		-281,87
I1. Altri ricavi		
I2. Altri costi		-281,87
Utile/perdita della gestione del Fondo	7.922.143,32	-2.305.160,55

SEZIONE DI CONFRONTO *			
Rendimento della gestione	13,37%	Volatilità della gestione	4,43%
Rendimento del benchmark	13,31%	Volatilità del benchmark **	4,45%
Differenza	0,06%	Volatilità dichiarata ***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva