

RENDICONTO RIEPILOGATIVO E PROSPETTO ANNUALE DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **NUOVO AURIS**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL 01/01/2016 AL 31/12/2016

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **006**
RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività		Importi
100 Proventi da investimenti	A	41.627.185
101 Interessi su titoli di Stato in euro		25.961.752
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		12.162.307
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		209.629
105 Dividendi su azioni in euro		2.743.870
106 Dividendi su azioni in valuta		71.262
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		478.366
		478.366
200 Utili/perdite da realzi	B	233.212
201 Titoli di Stato in euro		43.912
202 Titoli di Stato in valuta		-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		213.920
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro		131.148
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta		-
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta		-
207 Titoli azionari quotati in euro		-112.206
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		105.073
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		-147.211
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		-1.424
		-1.424
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	10.016
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	41.870.413
500 Spese di revisione contabile	D	4.144
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	23.952
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	41.842.316
800 Giacenza media delle attività investite		1.033.413.688

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,05%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/15 al 31/01/16	4,53%
dal 01/03/15 al 29/02/16	4,48%
dal 01/04/15 al 31/03/16	4,38%
dal 01/05/15 al 30/04/16	4,24%
dal 01/06/15 al 31/05/16	4,16%
dal 01/07/15 al 30/06/16	4,07%
dal 01/08/15 al 31/07/16	4,01%
dal 01/09/15 al 31/08/16	3,96%
dal 01/10/15 al 30/09/16	4,08%
dal 01/11/15 al 31/10/16	4,03%
dal 01/12/15 al 30/11/16	4,07%
dal 01/01/16 al 31/12/16	4,05%

Redatto il, 02/02/2017

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2016	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2015
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	1.000.351.636	949.623.851
101 BTP	568.208.547	457.817.946
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	106.068.868	243.511.485
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	321.052.302	241.150.448
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	2.894.182	5.016.235
108 Obbligazioni non quotate in valuta	2.127.737	2.127.737
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	47.690.163	48.481.161
201 Azioni quotate in euro	44.090.939	44.601.607
202 Azioni non quotate in euro	1.596.017	1.596.017
203 Azioni quotate in valuta	858.051	1.138.381
204 Azioni non quotate in valuta	1.145.156	1.145.156
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	25.250.045	20.131.696
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	17.105.891	11.867.802
304 Strumenti derivati	127.121	127.121
305 Liquidità*	517.033	2.136.773
350 Altre tipologie di attività di cui: 351 Pronti contro termine	7.500.000	6.000.000
	-	-
352 Crediti d'imposta	7.500.000	6.000.000
353 Crediti verso riassicuratori	-	-
354 Retrocessione di commissioni	-	-
355 Crediti verso assicurati	-	-
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	1.073.291.844	1.018.236.708

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2016	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2015
Riserve matematiche	1.074.109.177	999.606.687
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38/2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

(*) non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

Redatto il, 02/02/2017

Il rappresentante legale dell'impresa

RENDICONTO RIEPILOGATIVO E PROSPETTO ANNUALE DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

 IMPRESA: **GENERELIFE S.p.A.**
 DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: **PREVIDENZA CONCRETA**
 PERIODO DI OSSERVAZIONE: DAL 01/01/2016 AL 31/12/2016

 CODICE IMPRESA: **447**
 CODICE GESTIONE: **001**
RENDICONTO RIEPILOGATIVO

valori in euro

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività		Importi
100 Proventi da investimenti	A	8.989.139
101 Interessi su titoli di Stato in euro		4.459.348
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		204.859
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		3.718.126
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		-
105 Dividendi su azioni in euro		404.437
106 Dividendi su azioni in valuta		6.440
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		195.929
		195.929
200 Utili/perdite da realzi	B	-375.934
201 Titoli di Stato in euro		-175.049
202 Titoli di Stato in valuta		-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		23.280
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		-138.896
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		4.648
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		-89.941
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		24
		24
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	8.613.205
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	14.929
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	8.598.276
800 Giacenza media delle attività investite		210.463.198

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,09%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/15 al 31/01/16	4,10%
dal 01/03/15 al 29/02/16	4,08%
dal 01/04/15 al 31/03/16	4,02%
dal 01/05/15 al 30/04/16	3,99%
dal 01/06/15 al 31/05/16	4,05%
dal 01/07/15 al 30/06/16	4,02%
dal 01/08/15 al 31/07/16	3,98%
dal 01/09/15 al 31/08/16	3,88%
dal 01/10/15 al 30/09/16	4,34%
dal 01/11/15 al 31/10/16	4,29%
dal 01/12/15 al 30/11/16	4,12%
dal 01/01/16 al 31/12/16	4,09%

Redatto il, 02/02/2017

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2016	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2015
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	200.904.222	189.710.250
101 BTP	82.577.090	80.786.811
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	16.297.035	13.380.268
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	4.839.262	4.836.828
105 Obbligazioni quotate in euro	96.788.311	90.406.420
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	402.524	299.923
108 Obbligazioni non quotate in valuta	-	-
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	9.025.774	8.616.340
201 Azioni quotate in euro	8.878.623	8.616.340
202 Azioni non quotate in euro	-	-
203 Azioni quotate in valuta	147.151	-
204 Azioni non quotate in valuta	-	-
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	10.179.599	6.910.896
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	4.470.882	4.862.030
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità*	5.708.717	2.048.866
350 Altre tipologie di attività di cui: 351 Pronti contro termine	-	-
	-	-
352 Crediti d'imposta	-	-
353 Crediti verso riassicuratori	-	-
354 Retrocessione di commissioni	-	-
355 Crediti verso assicurati	-	-
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	220.109.595	205.237.486

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2016	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2015
Riserve matematiche	221.029.233	203.983.695
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art. 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008	(*)	(*)

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38/2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

(*) non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

Redatto il, 02/02/2017

Il rappresentante legale dell'impresa

