

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 01/01/2017 AL 31/12/2017

 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	44.945.057
101 Interessi su titoli di Stato in euro		28.864.937
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		-
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		12.125.397
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		209.435
105 Dividendi su azioni in euro		2.777.866
106 Dividendi su azioni in valuta		356.076
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		611.346
		611.346
200 Utili/perdite da realizzo	B	999.561
201 Titoli di Stato in euro		-115.141
202 Titoli di Stato in valuta		-
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		505.775
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro		-
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta		41
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta		-
207 Titoli azionari quotati in euro		420.391
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		60.751
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		138.651
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		-10.906
		-10.906
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	10.582
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	45.955.201
500 Spese di revisione contabile	D	4.144
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	75.779
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	45.875.277
800 Giacenza media delle attività investite		1.275.808.962

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **3,60%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/16 al 31/01/17	4,06%
dal 01/03/16 al 28/02/17	4,05%
dal 01/04/16 al 31/03/17	4,02%
dal 01/05/16 al 30/04/17	4,01%
dal 01/06/16 al 31/05/17	3,99%
dal 01/07/16 al 30/06/17	3,97%
dal 01/08/16 al 31/07/17	3,91%
dal 01/09/16 al 31/08/17	3,86%
dal 01/10/16 al 30/09/17	3,81%
dal 01/11/16 al 31/10/17	3,76%
dal 01/12/16 al 30/11/17	3,64%
dal 01/01/17 al 31/12/17	3,60%

Redatto il, 05/02/2018

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2017	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2016
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	1.335.003.944	1.000.351.636
101 BTP	556.609.762	568.208.547
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	394.282.820	106.068.868
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	-
105 Obbligazioni quotate in euro	379.323.719	321.052.302
106 Obbligazioni quotate in valuta	1.845.255	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	814.651	2.894.182
108 Obbligazioni non quotate in valuta	2.127.737	2.127.737
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	56.369.106	47.690.163
201 Azioni quotate in euro	51.273.619	44.090.939
202 Azioni non quotate in euro	1.596.017	1.596.017
203 Azioni quotate in valuta	2.354.314	858.051
204 Azioni non quotate in valuta	1.145.156	1.145.156
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	72.033.750	25.250.045
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	2.079.531	-
303 Quote di OICR	56.889.228	17.105.891
304 Strumenti derivati	127.121	127.121
305 Liquidità ¹	1.937.870	517.033
350 Altre tipologie di attività di cui: 351 Pronti contro termine	11.000.000	7.500.000
	-	-
352 Crediti d'imposta	11.000.000	7.500.000
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	1.463.406.800	1.073.291.844

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2017	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2016
Riserve matematiche	1.478.872.148	1.074.109.177
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, 05/02/2018

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 01/01/2017 AL 31/12/2017

 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	8.942.538
101 Interessi su titoli di Stato in euro		4.388.385
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		24.817
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		3.733.283
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta		-
105 Dividendi su azioni in euro		570.159
106 Dividendi su azioni in valuta		50.189
107 Redditi degli investimenti immobiliari		-
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività		175.704
		175.704
200 Utili/perdite da realizzo	B	1.085.968
201 Titoli di Stato in euro		-168.670
202 Titoli di Stato in valuta		440.259
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		36.922
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		-492.576
208 Titoli azionari non quotati in euro		-
209 Titoli azionari in valuta quotati		-18.269
210 Titoli azionari in valuta non quotati		-
211 Immobili		-
212 Cambi		1.288.302
250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Altre attività finanziarie		-
		-
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	10.028.506
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	26.084
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	10.002.422
800 Giacenza media delle attività investite		227.441.503

 Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,40%** Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione

tasso realizzato

dal 01/02/16 al 31/01/17	4,06%
dal 01/03/16 al 28/02/17	4,84%
dal 01/04/16 al 31/03/17	4,84%
dal 01/05/16 al 30/04/17	4,82%
dal 01/06/16 al 31/05/17	4,79%
dal 01/07/16 al 30/06/17	4,70%
dal 01/08/16 al 31/07/17	4,67%
dal 01/09/16 al 31/08/17	4,70%
dal 01/10/16 al 30/09/17	4,42%
dal 01/11/16 al 31/10/17	4,40%
dal 01/12/16 al 30/11/17	4,41%
dal 01/01/17 al 31/12/17	4,40%

Redatto il, 05/02/2018

Il rappresentante legale dell'impresa

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2017	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2016
	Importi da libro mastro ¹	Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	211.009.427	200.904.222
101 BTP	79.980.198	82.577.090
102 CCT	-	-
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	25.759.955	16.297.035
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	-	4.839.262
105 Obbligazioni quotate in euro	104.873.985	96.788.311
106 Obbligazioni quotate in valuta	-	-
107 Obbligazioni non quotate in euro	395.289	402.524
108 Obbligazioni non quotate in valuta	-	-
150 Altre tipologie di titoli di debito	-	-
200 Titoli di capitale:	10.472.738	9.025.774
201 Azioni quotate in euro	10.032.507	8.878.623
202 Azioni non quotate in euro	-	-
203 Azioni quotate in valuta	440.231	147.151
204 Azioni non quotate in valuta	-	-
250 Altre tipologie di titoli di capitale	-	-
300 Altre attività patrimoniali:	11.370.463	10.179.599
301 Immobili	-	-
302 Prestiti	-	-
303 Quote di OICR	4.351.093	4.470.882
304 Strumenti derivati	-	-
305 Liquidità ¹	7.019.370	5.708.717
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	232.852.628	220.109.595

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione 31/12/2017	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente 31/12/2016
Riserve matematiche	224.451.166	221.029.233
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, 05/02/2018

Il rappresentante legale dell'impresa

