

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO CNP WB ALTERNATIVE DYNAMIC UNCONSTRAINED
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2019

Valori espressi in Euro

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2019		SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	8.324.192,57	98,75%	7.496.124,40	87,70%
A 1 Titoli di debito	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 1.1 Titoli di Stato	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 1.2 Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 1.3 Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 2 Titoli azionari	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 3 Parti di OICR	8.324.192,57	98,75%	7.496.124,40	87,70%
B STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 1 Titoli di debito	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 1.1 Titoli di Stato	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 1.2 Obbligazioni e altri titoli assimilabili	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 1.3 Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 2 Titoli azionari	0,00	0,00%	0,00	0,00%
B 3 Parti di OICR	0,00	0,00%	0,00	0,00%
C STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	0,00	0,00%	0,00	0,00%
C 1 Negoziati (da specificare ulteriormente)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
C 2 Non negoziati (da specificare ulteriormente)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
D PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE	0,00	0,00%	0,00	0,00%
E DEPOSITI BANCARI	101.477,82	1,20%	-1.436.971,23	-16,81%
F LIQUIDITÀ DA IMPEGNARE PER OPERAZIONI DA REGOLARE	3.840,54	0,05%	2.507.685,69	29,34%
G MUTUI E PRESTITI GARANTITI	0,00	0,00%	0,00	0,00%
H ALTRE ATTIVITÀ	0,00	0,00%	-19.742,95	-0,23%
H 1 Ratei attivi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
H 2 Altri attivi (da specificare)	0,00	0,00%	-19.742,95	-0,23%
TOTALE ATTIVITÀ	8.429.510,93	100,00%	8.547.095,91	100,00%

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2019		SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE	
	Valore complessivo	% sul totale passività	Valore complessivo	% sul totale passività
I STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	0,00	0,00%	0,00	0,00%
I 1 Negoziati (da specificare ulteriormente)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
I 2 Non negoziati (da specificare ulteriormente)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
L PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE	0,00	0,00%	0,00	0,00%
M ALTRE PASSIVITÀ	-18.049,35	100,00%	-18.008,47	100,00%
M 1 Ratei passivi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
M 2 Spese pubblicazione quota	0,00	0,00%	0,00	0,00%
M 3 Spese revisione rendiconto	0,00	0,00%	0,00	0,00%
M 4 Commissione di gestione	-17.717,63	98,16%	-22.521,24	125,06%
M 5 Passività diverse	-331,72	1,84%	4.512,77	-25,06%
TOTALE PASSIVITÀ	-18.049,35	100,00%	-18.008,47	100,00%
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	8.411.461,58		8.529.087,44	
Numero delle quote in circolazione	82.549,572394		87.557,623634	
Valore unitario delle quote	101,895883		97,411134	

MOVIMENTI DELLE QUOTE NELL'ESERCIZIO	I TRIMESTRE	II TRIMESTRE	III TRIMESTRE	IV TRIMESTRE
Quote emesse	0,000000	0,009875	0,000001	0,000000
Quote rimborsate	-1182,232059	-708,020085	-2773,561543	-344,247429

Milano, 28 febbraio 2020

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.
Il Direttore Generale
Gilles Ferreol

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO CNP WB ALTERNATIVE DYNAMIC UNCONSTRAINED SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2019

Valori espressi in Euro

	RENDICONTO AL 31/12/2019	RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE
A STRUMENTI FINANZIARI	355.410,69	-437.503,39
A 1 Proventi da investimenti	2.539,43	20.400,07
A 1.1 Interessi e altri proventi su titoli di debito	0,00	0,00
A 1.2 Dividendi e altri proventi su titoli azionari	0,00	0,00
A 1.3 Proventi su parti di OICR	2.539,43	20.400,07
A 2 Utile/perdita da realizzi	361.218,37	-321.701,47
A 2.1 Titoli di debito	0,00	0,00
A 2.2 Titoli azionari	0,00	0,00
A 2.3 Parti di OICR	361.218,37	-321.701,47
A 3 Plusvalenze/minusvalenze	-8.347,11	-136.201,99
A 3.1 Titoli di debito	0,00	0,00
A 3.2 Titoli azionari	0,00	0,00
A 3.3 Parti di OICR	-8.347,11	-136.201,99
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI	355.410,69	-437.503,39
B STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	0,00	0,00
B 1 Risultati realizzati	0,00	0,00
B 1.1 Su strumenti negoziati	0,00	0,00
B 1.2 Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
B 2 Risultati non realizzati	0,00	0,00
B 2.1 Su strumenti negoziati	0,00	0,00
B 2.2 Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	0,00	0,00
C INTERESSI ATTIVI	0,00	-447,23
C 1 Su depositi bancari	0,00	-447,23
C 2 Su mutui e prestiti garantiti	0,00	0,00
D RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	41.335,00	126.320,57
D 1 Risultati realizzati	56.410,24	92.315,51
D 2 Risultati non realizzati	-15.075,24	34.005,06
E PROVENTI SU CREDITI	0,00	0,00
F ALTRI PROVENTI	0,00	0,00
F 1 Proventi sulle operazioni di pronti contro termine attivi	0,00	0,00
F 2 Proventi diversi	0,00	0,00
RISULTATO LORDO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO	396.745,69	-311.630,05
G ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-5.546,78	-4.856,13
RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO	391.198,91	-316.486,18
H ONERI DI GESTIONE	-113.764,87	-131.890,57
H 1 Commissione di gestione	-56.721,39	-60.011,46
H 2 Spese pubblicazione quota	0,00	0,00
H 3 Spese di gestione, amministrazione e custodia	0,00	0,00
H 4 Altri oneri di gestione	-57.043,48	-71.879,11
I ALTRI RICAVI E ONERI	0,00	0,00
I 1 Altri ricavi	0,00	0,00
I 2 Altri costi	0,00	0,00
UTILE/PERDITA DELLA GESTIONE DEL FONDO	277.434,04	-448.376,75

SEZIONE DI CONFRONTO*

Rendimento della gestione	4,60%	Volatilità della gestione	2,75%
		Volatilità dichiarata***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

Milano, 28 febbraio 2020

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.
Il Direttore Generale
Gilles Ferreol