

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO DYNAMIC STRUCTURED OPPORTUNITY
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2020

Valori espressi in Euro

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2020		SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	465.675,65	95,06%	785.365,86	86,27%
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	465.675,65	95,06%	785.365,86	86,27%
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	24.199,16	4,94%	125.017,21	13,73%
F LIQUIDITÀ DA IMPEGNARE PER OPERAZIONI DA REGOLARE	-10,00	0,00%	0,00	0,00%
G MUTUI E PRESTITI GARANTITI	0,00	0,00%	0,00	0,00%
H ALTRE ATTIVITÀ	0,00	0,00%	0,00	0,00%
H 1 Ratei attivi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
H 2 Altri attivi (da specificare)	0,00	0,00%	0,00	0,00%
TOTALE ATTIVITÀ	489.864,81	100,00%	910.383,07	100,00%

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2020		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	-3.262,38	100,00%	-4.723,07	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	-2.600,87	79,72%	-2.469,65	52,29%
M 5 Passività diverse	-661,51	20,28%	-2.253,42	47,71%
TOTALE PASSIVITÀ	-3.262,38	100,00%	-4.723,07	100,00%
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	486.602,43		905.660,00	
Numero delle quote in circolazione	5.188,274311		8.732,533441	
Valore unitario delle quote	93,788879		103,711026	

MOVIMENTI DELLE QUOTE NELL'ESERCIZIO	I TRIMESTRE	II TRIMESTRE	III TRIMESTRE	IV TRIMESTRE
Quote emesse	379,323584	0,281782	362,618726	1,118133
Quote rimborsate	-321,477819	-725,587003	-634,262902	-2606,273631

Milano, 28 febbraio 2021

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale

Gilles Ferreol

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO DYNAMIC STRUCTURED OPPORTUNITY
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2020

Valori espressi in Euro

	RENDICONTO AL 31/12/2020	RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE
A STRUMENTI FINANZIARI	-91.747,59	31.542,44
A 1 Proventi da investimenti	621,32	3.000,00
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	621,32	3.000,00
A 2 Utile/perdita da realizzi	-85.116,78	-4.391,10
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	-85.116,78	-4.391,10
A 3 Plusvalenze/minusvalenze	-7.252,13	32.933,54
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	-7.252,13	32.933,54
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI	-91.747,59	31.542,44
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	-610,57	-649,97
C 1 Su depositi bancari	-610,57	-649,97
C 2 Su mutui e prestiti garantiti	0,00	0,00
D RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	239,83	-887,54
D 1 Risultati realizzati	239,83	0,00
D 2 Risultati non realizzati	0,00	-887,54
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	-92.118,33	30.004,93
G ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-5.939,51	-1.650,04
RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO	-98.057,84	28.354,89
H ONERI DI GESTIONE	-12.372,63	-13.389,26
H 1 Commissione di gestione	-6.871,47	-6.640,39
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	-5.501,16	-6.748,87
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	-110.430,47	14.965,63

SEZIONE DI CONFRONTO*

Rendimento della gestione	-9,57%	Volatilità della gestione	8,45%
Rendimento del benchmark	4,01%	Volatilità del benchmark**	0,00%
Differenza	-13,57%	Volatilità dichiarata***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** Indicare soltanto in caso di gestione passiva

*** Indicare soltanto in caso di gestione attiva

Milano, 28 febbraio 2021

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale

Gilles Ferreol