

ALLEGATO 1
**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO LINEA CONSERVATIVA
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	16.467.173,15	95,69%	14.984.684,90	96,19%
A 1 Titoli di debito	3.622.112,70	21,05%	3.522.182,90	22,61%
A 1.1 Titoli di Stato	2.553.591,58	14,84%	3.007.870,06	19,31%
A 1.2 Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	1.068.521,12	6,21%	514.312,84	3,30%
A 1.3 Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	0,00	0,00%	0,00	0,00%
A 2 Titoli azionari	1.678.528,96	9,75%	1.593.916,57	10,23%
A 3 Parti di OICR	11.166.531,49	64,89%	9.868.585,43	63,35%
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	1.115,48	0,01%	0,00	0,00%
C 1 Negoziati (da specificare ulteriormente)	1.115,48	0,01%	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	741.317,97	4,31%	593.831,45	3,81%
F LIQUIDITÀ DA IMPEGNARE PER OPERAZIONI DA REGOLARE	0,00	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	17.209.606,60	100,00%	15.578.516,35	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	-26.185,61	100,00%	-47.897,42	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	-16.374,56	62,53%	-34.899,98	72,86%
M 5 Passività diverse	-9.811,05	37,47%	-12.997,44	27,14%
TOTALE PASSIVITÀ	-26.185,61	100,00%	-47.897,42	100,00%
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	17.183.420,99		15.530.618,93	
Numero delle quote in circolazione		160.218.068395		149.562.557269
Valore unitario delle quote		107,250207		103,840287

MOVIMENTI DELLE QUOTE NELL'ESERCIZIO	I TRIMESTRE	II TRIMESTRE	III TRIMESTRE	IV TRIMESTRE
Quote emesse	10968.319706	2155.758032	0.000000	3466.770450
Quote rimborsate	-3016.897625	-756.522823	-409.282192	-1752.634422

Milano, 28 febbraio 2021

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale

Gilles Ferreol

ALLEGATO 2

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO LINEA CONSERVATIVA
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2020**

			Valori espressi in Euro
		RENDICONTO AL 31/12/2020	RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE
A	STRUMENTI FINANZIARI	874.543,74	1.129.845,42
A 1	Proventi da investimenti	65.604,64	151.868,29
A 1.1	Interessi e altri proventi su titoli di debito	33.720,54	78.666,70
A 1.2	Dividendi e altri proventi su titoli azionari	25.573,78	55.220,22
A 1.3	Proventi su parti di OICR	6.310,32	17.981,37
A 2	Utile/perdita da realizzati	5.516,00	189.109,46
A 2.1	Titoli di debito	24.160,81	41.265,01
A 2.2	Titoli azionari	-133.041,93	80.576,98
A 2.3	Parti di OICR	114.397,12	67.267,47
A 3	Plusvalenze/minusvalenze	803.423,10	788.867,67
A 3.1	Titoli di debito	207.771,84	55.941,46
A 3.2	Titoli azionari	141.204,98	263.800,78
A 3.3	Parti di OICR	454.446,28	469.125,43
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI		874.543,74	1.129.845,42
B	STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	225.115,57	-117.447,16
B 1	Risultati realizzati	256.618,96	-117.447,16
B 1.1	Su strumenti negoziati	256.618,96	-117.447,16
B 1.2	Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
B 2	Risultati non realizzati	-31.503,39	0,00
B 2.1	Su strumenti negoziati	-31.503,39	0,00
B 2.2	Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		225.115,57	-117.447,16
C	INTERESSI ATTIVI	3,33	1.060,61
C 1	Su depositi bancari	3,33	1.060,61
C 2	Su mutui e prestiti garantiti	0,00	0,00
D	RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	-573.628,98	122.263,16
D 1	Risultati realizzati	-165.641,80	63.340,07
D 2	Risultati non realizzati	-407.987,18	58.923,09
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		526.033,66	1.135.722,03
G	ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-2.223,07	-2.119,04
RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO		523.810,59	1.133.602,99
H	ONERI DI GESTIONE	-103.182,98	-127.119,66
H 1	Commissione di gestione	-102.862,78	-125.521,94
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	-320,20	-1.597,72
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		420.627,61	1.006.483,33

SEZIONE DI CONFRONTO*

Rendimento della gestione	3,28%	Volatilità della gestione	6,61%
Rendimento del benchmark	2,71%	Volatilità del benchmark**	5,02%
Differenza	0,58%	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