

ALLEGATO 1

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO LINEA E5T RISK RETURN ENGINEERING
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2021

Valori espressi in Euro

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2021		SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	12.435.404,62	90,57%	12.631.474,93	96,10%
A 1 Titoli di debito	5.359.952,23	39,04%	2.265.185,20	17,23%
A 1.1 Titoli di Stato	3.191.490,25	23,24%	2.265.185,20	17,23%
A 1.2 Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	2.168.461,98	15,79%	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	3.007.361,58	21,90%	2.173.857,37	16,54%
A 3 Parti di OICR	4.068.090,81	29,63%	8.192.432,36	62,33%
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	133.422,00	0,97%	102.646,00	0,78%
C 1 Negoziati (da specificare ulteriormente)	133.422,00	0,97%	102.646,00	0,78%
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	1.161.391,00	8,46%	410.156,89	3,12%
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	13.730.217,62	100,00%	13.144.277,82	100,00%

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2021		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	-63.334,10	100,00%	-28.660,70	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	-57.515,91	90,81%	-24.867,22	86,76%
M 5 Passività diverse	-5.818,19	9,19%	-3.793,48	13,24%
TOTALE PASSIVITÀ	-63.334,10	100,00%	-28.660,70	100,00%
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	13.666.883,52		13.115.617,12	
Numeri delle quote in circolazione	116.230,908283		117.003,418912	
Valore unitario delle quote	117,583900		112,096016	

MOVIMENTI DELLE QUOTE NELL'ESERCIZIO	I TRIMESTRE	II TRIMESTRE	III TRIMESTRE	IV TRIMESTRE
Quote emesse	0,000000	0,000000	0,000000	0,000000
Quote rimborsate	-192,475991	-197,332486	-192,453678	-190,248474

Milano, 22 febbraio 2022

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale

Francesco Frumando



ALLEGATO 2

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO LINEA E5T RISK RETURN ENGINEERING
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2021**

			Valori espressi in Euro
		RENDICONTO AL 31/12/2021	RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE
A	STRUMENTI FINANZIARI	573.649,91	638.387,72
A 1	Proventi da investimenti	18.668,63	38.982,24
A 1.1	Interessi e altri proventi su titoli di debito	-18.583,14	-1.958,67
A 1.2	Dividendi e altri proventi su titoli azionari	34.253,79	27.951,25
A 1.3	Proventi su parti di OICR	2.997,98	12.989,66
A 2	Utile/perdita da realizzati	-39.524,60	-226.109,95
A 2.1	Titoli di debito	19.109,81	18.523,60
A 2.2	Titoli azionari	29.627,44	-71.040,66
A 2.3	Parti di OICR	-88.261,85	-173.592,89
A 3	Plusvalenze/minusvalenze	594.505,88	825.515,43
A 3.1	Titoli di debito	29.068,49	35.757,35
A 3.2	Titoli azionari	535.527,64	201.748,26
A 3.3	Parti di OICR	29.909,75	588.009,82
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI		573.649,91	638.387,72
B	STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	-191.065,27	132.754,05
B 1	Risultati realizzati	-219.305,22	126.263,35
B 1.1	Su strumenti negoziati	-219.305,22	126.263,35
B 1.2	Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
B 2	Risultati non realizzati	28.239,95	6.490,70
B 2.1	Su strumenti negoziati	28.239,95	6.490,70
B 2.2	Su strumenti non negoziati	0,00	0,00
RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		-191.065,27	132.754,05
C	INTERESSI ATTIVI	-178,09	-121,04
C 1	Su depositi bancari	-178,09	-121,04
C 2	Su mutui e prestiti garantiti	0,00	0,00
D	RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	297.259,73	-334.662,31
D 1	Risultati realizzati	63.201,74	-15.947,40
D 2	Risultati non realizzati	234.057,99	-318.714,91
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		679.666,28	436.358,42
G	ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-39.642,93	-15.982,75
RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO		640.023,35	420.375,67
H	ONERI DI GESTIONE	-82.032,93	-77.134,31
H 1	Commissione di gestione	-82.032,93	-77.134,36
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	0,00	0,05
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		557.990,42	343.241,36

SEZIONE DI CONFRONTO*

Rendimento della gestione	4,90%	Volatilità della gestione	3,13%
Rendimento del benchmark	4,64%	Volatilità del benchmark**	3,30%
Differenza	0,26%	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, 22 febbraio 2022

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale
Francesco Fiorinò

CNP Partners de Seguros y Reaseguros, S.A. - Impresa di Assicurazione di diritto spagnolo appartenente al Gruppo Assicurativo CNP Assurances.
Sede Legale: Carrera de San Jerónimo 21, 28014 Madrid - Iscritta al Registro delle Imprese di Madrid Tomo 4467, Folio 1, Hoja numero M-73979
NIF A-28534345 - Capitale Sociale € 138.287.215,20 - Rappresentanza Generale per l'Italia: Via Bocchetto 6, 20123 Milano
Iscritto al Registro delle Imprese di Milano - N. Rea MI-2036433 - P.IVA/Codice Fiscale 08595960967 - Iscritta all'Albo delle Imprese di Assicurazione N. I.00117
www.cnppartners.it - Tel. 02 3046 66 00 - Email: cnppartners@arubapec.it