

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2023		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	47.593.803,95	84,54	58.806.836,64	97,74
A1. Titoli di debito				
A1.1. Titoli di Stato				
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.	47.593.803,95	84,54	58.806.836,64	97,74
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	8.511.723,44	15,12		
B1. Titoli di debito				
B1.1. Titoli di Stato				
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili				
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
B2. Titoli azionari				
B3. Parti di O.I.C.R.	8.511.723,44	15,12		
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
C1. Negoziati				
C2. Non negoziati				
C2.4. Contratti Forward				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	191.900,68	0,34	1.310.544,99	2,18
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	280,63		51.532,18	0,09
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	374,53		660,06	
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	374,53		660,06	
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	374,53		660,06	
H2.3. Retrocessione commissioni				
H2.4. Altri attivi autorizzati dall'Istituto				
TOTALE ATTIVITA'	56.298.083,23	100,00	60.169.573,87	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2023		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore	% sul totale
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati				
I2. Non negoziati				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	-125.475,76	35,39	-41.541,51	14,08
M. ALTRE PASSIVITA'	-229.081,62	64,61	-253.519,34	85,92
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto	-7.803,29	2,20	-7.417,53	2,51
M4 Commissioni di Gestione				
M4.1 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI A	-3.332,95	0,94	-3.576,37	1,21
M4.2 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI B	-127.590,49	35,99	-159.396,56	54,02
M4.3 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI C	-90.354,89	25,48	-83.128,88	28,17
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'	-354.557,38	100,00	-295.060,85	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		55.943.525,85		59.874.513,02
UNIT Valore Piu BilanciatoCI A Numero quote in circolazione		64.524,385		70.375,551
UNIT Valore Piu BilanciatoCI A Valore unitario delle quote		17,586		16,099
UNIT Valore Piu BilanciatoCI B Numero quote in circolazione		2.309.846,179		2.958.343,701
UNIT Valore Piu BilanciatoCI B Valore unitario delle quote		14,906		13,708
UNIT Valore Piu BilanciatoCI C Numero quote in circolazione		1.931.633,876		1.872.232,998
UNIT Valore Piu BilanciatoCI C Valore unitario delle quote		10,550		9,715

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
UNIT Valore Piu BilanciatoCI A Quote emesse	915,407	185,213	100,082	406,905
UNIT Valore Piu BilanciatoCI A Quote Rimborsate	2.296,035	1.793,829	1.933,315	1.435,594
UNIT Valore Piu BilanciatoCI B Quote emesse	34.138,441	26.693,696	17.343,261	29.101,139
UNIT Valore Piu BilanciatoCI B Quote Rimborsate	107.040,955	151.923,840	192.954,070	303.855,194
UNIT Valore Piu BilanciatoCI C Quote emesse	91.368,616	95.852,112	41.025,821	64.534,785
UNIT Valore Piu BilanciatoCI C Quote Rimborsate	32.528,545	34.942,910	33.691,220	132.217,781

Data 28/02/24

Groupama Assicurazioni SpA
Chief Financial Officer

	Rendiconto al 31-12-2023		Rendiconto esercizio precedente	
A. STRUMENTI FINANZIARI				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	184.071,41		193.708,95	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito				
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari				
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	184.071,41		193.708,95	
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	882.985,51		-1.617.473,89	
A2.1. Titoli di debito				
A2.2. Titoli azionari				
A2.3. Parti di O.I.C.R.	882.985,51		-1.617.473,89	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	4.612.666,93		-8.198.637,40	
A3.1. Titoli di debito				
A3.2. Titoli di capitale				
A3.3. Parti di O.I.C.R.	4.612.666,93		-8.198.637,40	
Risultato gestione strumenti finanziari	5.679.723,85		-9.622.402,34	
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
B1. RISULTATI REALIZZATI				
B1.1. Su strumenti negoziati				
B1.2. Su strumenti non negoziati				
B2. RISULTATI NON REALIZZATI				
B2.1. Su strumenti negoziati				
B2.2. Su strumenti non negoziati				
Risultato gestione strumenti finanziari derivati				
C. INTERESSI ATTIVI				
C1. SU DEPOSITI BANCARI				
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	920,24			
D1. RISULTATI REALIZZATI	928,78			
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-8,54			
E. PROVENTI SU CREDITI				
F. ALTRI PROVENTI				
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI				
F2. PROVENTI DIVERSI				
Risultato lordo della gestione di portafoglio	5.680.644,09		-9.622.402,34	
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-143,27		-821,74	
G1. Bolli, spese e commissioni	-143,27		-821,74	
Risultato netto della gestione di portafoglio	5.680.500,82		-9.623.224,08	
H. ONERI DI GESTIONE	-947.634,37		-1.033.495,44	
H1 Commissioni di Gestione				
H1.1 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI A	-13.469,78		-15.245,75	
H1.2 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI B	-572.069,64		-678.323,07	
H1.3 Commissioni di Gestione UNIT Valore Piu BilanciatoCI C	-354.291,66		-332.509,09	
H2. Spese pubblicazione quota				
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-7.803,29		-7.417,53	
H4. Altri oneri di gestione				
I. ALTRI RICAVI E ONERI	12.569,45		2.538,67	
I1. Altri ricavi	12.569,45		2.538,67	
I2. Altri costi				
Utile/perdita della gestione del Fondo	4.745.435,90		-10.654.180,85	

SEZIONE DI CONFRONTO

UNIT Valore Piu BilanciatoCI A			
Rendimento della gestione	9,24	Volatilità della gestione	5,38
Rendimento del benchmark	10,68	Volatilità del benchmark	5,51
Differenza	-1,44	Volatilità dichiarata	
UNIT Valore Piu BilanciatoCI B			
Rendimento della gestione	8,74	Volatilità della gestione	5,40
Rendimento del benchmark	10,68	Volatilità del benchmark	5,51
Differenza	-1,94	Volatilità dichiarata	
UNIT Valore Piu BilanciatoCI C			
Rendimento della gestione	8,59	Volatilità della gestione	5,40
Rendimento del benchmark	10,68	Volatilità del benchmark	5,51
Differenza	-2,09	Volatilità dichiarata	

Data 28/02/24

Groupama Assicurazioni SpA
 Chief Financial Officer