

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2023		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>35.656.878,67</b>	<b>98,13</b>	<b>23.609.229,33</b>	<b>95,86</b>
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.	35.656.878,67	98,13	23.609.229,33	95,86
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>				
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.				
<b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>330.409,08</b>	<b>0,91</b>	<b>42.358,62</b>	<b>0,17</b>
C1. Negoziati				
C2. Non negoziati	330.409,08	0,91	42.358,62	0,17
C2.4. Contratti Forward	330.409,08	0,91	42.358,62	0,17
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b>				
<b>E. DEPOSITI BANCARI</b>	<b>190.114,73</b>	<b>0,52</b>	<b>975.908,87</b>	<b>3,96</b>
<b>F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare</b>	<b>158.481,75</b>	<b>0,44</b>		
<b>G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>				
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>	<b>740,32</b>		<b>574,55</b>	
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	740,32		574,55	
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	740,32		574,55	
H2.3. Retrocessione commissioni				
H2.4. Altri attivi autorizzati dall'Istituto				
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>36.336.624,55</b>	<b>100,00</b>	<b>24.628.071,37</b>	<b>100,00</b>

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2023		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore	% sul totale
<b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
I1. Negoziati				
I2. Non negoziati				
<b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b>			<b>-1.211,28</b>	<b>0,99</b>
<b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>-167.809,50</b>	<b>100,00</b>	<b>-120.531,47</b>	<b>99,01</b>
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto	-3.193,85	1,90	-2.090,75	1,72
M4. Commissione di gestione	-164.615,66	98,10	-118.440,72	97,29
M5. Passività diverse	0,01			
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>-167.809,50</b>	<b>100,00</b>	<b>-121.742,75</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>36.168.815,05</b>		<b>24.506.328,62</b>
Numero delle quote in circolazione		3.052.915,723		2.390.134,318
Valore unitario delle quote		11,847		10,253

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	166.733,690	275.296,166	127.248,087	206.501,223
Quote rimborsate	18.400,250	25.082,446	10.067,383	59.447,682

Data 28/02/24

Groupama Assicurazioni SpA  
 Chief Financial Officer

	Rendiconto al 31-12-2023	Rendiconto esercizio precedente
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI		
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.		
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	891.905,70	-426.039,87
A2.1. Titoli di debito		
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.	891.905,70	-426.039,87
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	3.402.610,91	-3.389.040,36
A3.1. Titoli di debito		
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.	3.402.610,91	-3.389.040,36
<b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>	<b>4.294.516,61</b>	<b>-3.815.080,23</b>
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>		
B1. RISULTATI REALIZZATI	322.301,83	-855.007,35
B1.1. Su strumenti negoziati		
B1.2. Su strumenti non negoziati	322.301,83	-855.007,35
B2. RISULTATI NON REALIZZATI	330.409,08	42.358,62
B2.1. Su strumenti negoziati		
B2.2. Su strumenti non negoziati	330.409,08	42.358,62
<b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>	<b>652.710,91</b>	<b>-812.648,73</b>
<b>C. INTERESSI ATTIVI</b>		
C1. SU DEPOSITI BANCARI		
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
<b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>	<b>4,72</b>	<b>0,52</b>
D1. RISULTATI REALIZZATI	4,72	0,52
D2. RISULTATI NON REALIZZATI		
<b>E. PROVENTI SU CREDITI</b>		
<b>F. ALTRI PROVENTI</b>		
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI		
<b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>	<b>4.947.232,24</b>	<b>-4.627.728,44</b>
<b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>	<b>-591,12</b>	<b>-3.861,95</b>
G1. Bolli, spese e commissioni	-591,12	-3.861,95
<b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>	<b>4.946.641,12</b>	<b>-4.631.590,39</b>
<b>H. ONERI DI GESTIONE</b>	<b>-598.336,99</b>	<b>-444.197,02</b>
H1. Commissione di gestione	-591.486,62	-439.998,51
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-6.850,37	-4.198,51
H4. Altri oneri di gestione		
<b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>	<b>12.324,36</b>	<b>2.533,49</b>
I1. Altri ricavi	12.342,96	2.599,05
I2. Altri costi	-18,60	-65,56
<b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>	<b>4.360.628,49</b>	<b>-5.073.253,92</b>

**SEZIONE DI CONFRONTO**

Rendimento della gestione	15,55	Volatilità della gestione	10,58
Rendimento del benchmark	18,17	Volatilità del benchmark	11,37
Differenza	-2,62	Volatilità dichiarata	

Data 28/02/24

Groupama Assicurazioni SpA  
 Chief Financial Officer