

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO CNP PRUDENTE
SEZIONE PATRIMONIALE AL 31/12/2019**

Valori espressi in Euro

| ATTIVITÀ | SITUAZIONE AL 31/12/2019 | | SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE | |
|--|-----------------------------|-----------------------|---|-----------------------|
| | Valore complessivo | % sul totale attività | Valore complessivo | % sul totale attività |
| A STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI | 8.233.346,51 | 99,99% | 4.698.959,14 | 99,20% |
| 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 | 8.233.346,51 | 99,99% | 4.698.959,14 | 99,20% |
| 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 | 4.379,13 | 0,05% | -305.878,73 | -6,46% |
| F LIQUIDITÀ DA IMPEGNARE PER OPERAZIONI DA REGOLARE | 7.312,85 | 0,09% | 342.612,67 | 7,23% |
| G MUTUI E PRESTITI GARANTITI | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| H ALTRE ATTIVITÀ | -11.080,86 | -0,13% | 1.079,64 | 0,02% |
| H 1 Ratei attivi | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| H 2 Altri attivi (da specificare) | -11.080,86 | -0,13% | 1.079,64 | 0,02% |
| TOTALE ATTIVITÀ | 8.233.957,63 | 100,00% | 4.736.772,72 | 100,00% |

| ATTIVITÀ | SITUAZIONE AL 31/12/2019 | | 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 | -30.572,84 | 100,00% | -12.575,59 | 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 | -20.131,16 | 65,85% | -12.283,61 | 97,68% |
| M 5 Passività diverse | -10.441,68 | 34,15% | -291,98 | 2,32% |
| TOTALE PASSIVITÀ | -30.572,84 | 100,00% | -12.575,59 | 100,00% |
| VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO | 8.203.384,79 | | 4.724.197,13 | |
| Numero delle quote in circolazione | 76.289,591765 | | 48.090,372985 | |
| Valore unitario delle quote | 107,529541 | | 98,235818 | |

| MOVIMENTI DELLE QUOTE NELL'ESERCIZIO | I TRIMESTRE | II TRIMESTRE | III TRIMESTRE | IV TRIMESTRE |
|--------------------------------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| Quote emesse | 2589,459302 | 22793,336940 | 5145,664804 | 5351,315558 |
| Quote rimborsate | -1225,792535 | -5213,005552 | -830,707539 | -411,052198 |

Milano, 28 febbraio 2020

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.

Il Direttore Generale

Gilles Ferreol

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO CNP PRUDENTE
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2019**
Valori espressi in Euro

| | RENDICONTO AL 31/12/2019 | RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE |
|---|-----------------------------|------------------------------------|
| A STRUMENTI FINANZIARI | 529.979,06 | -274.731,24 |
| A 1 Proventi da investimenti | 22.931,90 | 19.866,39 |
| 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 | 22.931,90 | 19.866,39 |
| A 2 Utile/perdita da realizzi | 272.366,77 | -77.789,23 |
| 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 | 272.366,77 | -77.789,23 |
| A 3 Plusvalenze/minusvalenze | 234.680,39 | -216.808,40 |
| 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 | 234.680,39 | -216.808,40 |
| RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI | 529.979,06 | -274.731,24 |
| 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 | -12,75 | -55,60 |
| C 1 Su depositi bancari | -12,75 | -55,60 |
| C 2 Su mutui e prestiti garantiti | 0,00 | 0,00 |
| D RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI | 6.546,77 | 21.139,07 |
| D 1 Risultati realizzati | 2.429,74 | 3.626,02 |
| D 2 Risultati non realizzati | 4.117,03 | 17.513,05 |
| 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 | 536.513,08 | -253.647,77 |
| G ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare) | 0,00 | 0,00 |
| RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO | 536.513,08 | -253.647,77 |
| H ONERI DI GESTIONE | -74.701,25 | -49.116,67 |
| H 1 Commissione di gestione | -29.929,99 | -19.331,01 |
| 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 | -44.771,26 | -29.785,66 |
| 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 | 461.811,83 | -302.764,44 |

SEZIONE DI CONFRONTO*

| | | | |
|---------------------------|-------|---------------------------|-------|
| Rendimento della gestione | 9,46% | Volatilità della gestione | 2,12% |
| | | Volatilità dichiarata*** | |

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

Milano, 28 febbraio 2020

CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.
Il Direttore Generale
Gilles Ferreol