

ALLEGATO 1

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO TOTAL RETURN**  
**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
<b>A STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>97.954,65</b>	<b>96,53%</b>	<b>95.760,41</b>	<b>96,31%</b>
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	97.954,65	96,53%	95.760,41	96,31%
<b>B STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
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%
<b>C STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
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%
<b>D PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITÀ MONETARIE</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>E DEPOSITI BANCARI</b>	<b>3.518,25</b>	<b>3,47%</b>	<b>3.667,56</b>	<b>3,69%</b>
<b>F LIQUIDITÀ DA IMPEGNARE PER OPERAZIONI DA REGOLARE</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>G MUTUI E PRESTITI GARANTITI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>H ALTRE ATTIVITÀ</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
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%
<b>TOTALE ATTIVITÀ</b>	<b>101.472,90</b>	<b>100,00%</b>	<b>99.427,97</b>	<b>100,00%</b>

ATTIVITÀ	SITUAZIONE AL 31/12/2021		SITUAZIONE A FINE ESERCIZIO PRECEDENTE	
	Valore complessivo	% sul totale passività	Valore complessivo	% sul totale passività
<b>I STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
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%
<b>L PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITÀ MONETARIE</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>
<b>M ALTRE PASSIVITÀ</b>	<b>-355,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>-350,42</b>	<b>100,00%</b>
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	-345,72	97,36%	-341,53	97,46%
M 5 Passività diverse	-9,37	2,64%	-8,89	2,54%
<b>TOTALE PASSIVITÀ</b>	<b>-355,09</b>	<b>100,00%</b>	<b>-350,42</b>	<b>100,00%</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>	<b>101.117,81</b>		<b>99.077,55</b>	
Numero delle quote in circolazione	927.261.071		940.309.793	
Valore unitario delle quote	109,049989		105,366923	

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	-3,255224	-3,336004	-3,247985	-3,209509

Milano, 22 febbraio 2022

**CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.**

Il Direttore Generale

Francesco Flaminio



ALLEGATO 2

**RENDICONTO RIEPILOGATIVO DEL FONDO TOTAL RETURN**  
SEZIONE REDDITUALE AL 31/12/2021

		Valori espressi in Euro
	RENDICONTO AL 31/12/2021	RENDICONTO ESERCIZIO PRECEDENTE
<b>A STRUMENTI FINANZIARI</b>	<b>3.449,31</b>	<b>4.325,67</b>
A 1 Proventi da investimenti	292,32	371,63
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	292,32	371,63
A 2 Utile/perdita da realizzati	304,00	-3.791,96
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	304,00	-3.791,96
A 3 Plusvalenze/minusvalenze	2.852,99	7.746,00
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	2.852,99	7.746,00
<b>RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI</b>	<b>3.449,31</b>	<b>4.325,67</b>
<b>B STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
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
<b>RISULTATO GESTIONE STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>C INTERESSI ATTIVI</b>	<b>113,22</b>	<b>0,03</b>
C 1 Su depositi bancari	113,22	0,03
C 2 Su mutui e prestiti garantiti	0,00	0,00
<b>D RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
D 1 Risultati realizzati	0,00	0,00
D 2 Risultati non realizzati	0,00	0,00
<b>E PROVENTI SU CREDITI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>F ALTRI PROVENTI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
F 1 Proventi sulle operazioni di pronti contro termine attivi	0,00	0,00
F 2 Proventi diversi	0,00	0,00
<b>RISULTATO LORDO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO</b>	<b>3.562,53</b>	<b>4.325,70</b>
<b>G ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>	<b>-108,11</b>	<b>0,00</b>
<b>RISULTATO NETTO DELLA GESTIONE DI PORTAFOGLIO</b>	<b>3.454,42</b>	<b>4.325,70</b>
<b>H ONERI DI GESTIONE</b>	<b>-553,31</b>	<b>-515,34</b>
H 1 Commissione di gestione	-553,31	-515,34
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	0,00
<b>I ALTRI RICAVI E ONERI</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
I 1 Altri ricavi	0,00	0,00
I 2 Altri costi	0,00	0,00
<b>UTILE/PERDITA DELLA GESTIONE DEL FONDO</b>	<b>2.901,11</b>	<b>3.810,36</b>

**SEZIONE DI CONFRONTO\***

Rendimento della gestione	3,50%	Volatilità della gestione	2,13%
		Volatilità dichiarata***	

\* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

Milano, 22 febbraio 2022

**CNP Partners de Seguros y Reaseguros S.A.**

Il Direttore Generale  
Francesco Romano  


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@drubapec.it