

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BNL DUO – Euro Export USA

SITUAZIONE PATRIMONIALE AL

31/12/2017

ATTIVITA'	Situazione al 31/12/2017		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	29.573.939,18	99,50	37.400.957,22	99,58
A1. Titoli di debito	22.533.391,50	75,82	30.391.374,60	80,91
A1.1. Titoli di Stato	22.533.391,50	75,82	30.391.374,60	80,91
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	-	-	-	-
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	-	-	-	-
A2. Titoli azionari	6.947.509,00	23,38	6.986.275,70	18,60
A3. Parti di O.I.C.R.	93.038,68	0,31	23.306,92	0,06
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	-	-	-	-
B1. Titoli di debito	-	-	-	-
B1.1. Titoli di Stato	-	-	-	-
B1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	-	-	-	-
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	-	-	-	-
B2. Titoli azionari	-	-	-	-
B3. Parti di O.I.C.R.	-	-	-	-
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	-	-	-	-
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE	-	-	-	-
E. DEPOSITI BANCARI	147.561,44	0,50	159.417,03	0,42
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	-	-	-	-
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-	-	-	-
H. ALTRE ATTIVITA'	-	-	-	-
H1. Ratei attivi	-	-	-	-
H2. Altri attivi (da specificare)	-	-	-	-
H2.1. Crediti d'imposta	-	-	-	-
H2.2. Crediti per ritenute	-	-	-	-
H2.3. Credito per retrocessione commissioni	-	-	-	-
TOTALE ATTIVITA'	29.721.500,62	100,00	37.560.374,25	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31/12/2017		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale passività	Valore complessivo	% sul totale passività
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	-	-	-	-
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
I2.1. CS - Forward in divisa	-	-	-	-
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	- 119.419,34	70,77	- 53.045,35	47,12
M. ALTRE PASSIVITA'	- 49.335,34	29,23	- 59.531,68	52,88
M1. Ratei passivi	-	-	-	-
M2. Spese pubblicazione quota	- 544,99	0,32	- 604,03	0,54
M3. Spese revisione rendiconto	- 4.270,00	2,53	- 4.270,00	3,79
M4. Commissione di gestione	- 44.520,35	26,38	- 54.657,65	48,55
M5. Passività diverse	-	-	-	-
TOTALE PASSIVITA'	- 168.754,68		- 112.577,03	
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	29.552.745,94		37.447.797,22	
Numero delle quote in circolazione	298.599,733		395.548,408	
Valore unitario delle quote	98,971		94,673	

Movimenti delle quote nell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	-	-	-	-
Quote rimborsate	23.752,274	28.234,616	15.043,380	29.918,405

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO BNL DUO – Euro Export USA

SEZIONE REDDITUALE AL

31/12/2017

	Rendiconto al 31/12/2017	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI	2.135.472,84	3.113.608,34
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	307.240,42	28.999,68
A2.1. Titoli di debito	20.912,97	92.162,48
A2.2. Titoli azionari	286.660,35	- 63.429,00
A2.3. Parti di O.I.C.R.	- 332,90	266,20
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	1.828.232,42	3.084.608,66
A3.1. Titoli di debito	240.657,90	647.139,90
A3.2. Titoli di capitale	1.587.580,20	2.437.469,40
A3.3. Parti di O.I.C.R.	- 5,68	- 0,64
Risultato gestione strumenti finanziari	2.135.472,84	3.113.608,34
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	- 716,19	
C1. SU DEPOSITI BANCARI	- 716,19	
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-	
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	-	
D1. RISULTATI REALIZZATI	-	
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-	
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	2.134.756,65	3.113.608,34
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	- 8.246,20	- 8.410,18
G.1. Bolli, spese e commissioni	- 8.246,20	- 8.410,18
Risultato netto della gestione di portafoglio	2.126.510,45	3.105.198,16
H. ONERI DI GESTIONE	- 593.753,86	- 657.317,13
H1. Commissioni di gestione	- 588.938,87	- 652.443,10
H2. Spese di pubblicazione quota	- 544,99	- 604,03
H3. Spese di gestione, amministrazione custodia	- 4.270,00	- 4.270,00
H4. Altri oneri di gestione	-	
I. ALTRI RICAVI E ONERI	- 60,06	- 0,07
I1. Altri ricavi	0,05	
I2. Altri costi	- 60,11	- 0,07
Utile/perdita della gestione del Fondo	1.532.696,53	2.447.880,96

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
Rendimento del benchmark		Volatilità del benchmark **	
Differenza		Volatilità dichiarata ***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicare soltanto in caso di gestione passiva

*** indicare soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	4,54%	Volatilità della gestione	6,09%
		Volatilità dichiarata	Tra 20% e 25%

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Milano, 28 febbraio 2018