Allegato I

Allegato B

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

IMPRESA: GROUPAMA ASSICURAZIONI SPA — CODICE IMPRESA: 095
DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: VALOREPIU' — CODICE GESTIONE: 2
PERIODO DI OSSERVAZIONE: 1 Ottobre 2022 - 30 Settembre 2023

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione (30/09/2023)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (30/09/2022)
	Importi da libro mastro	Importi da libro mastro
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	**862.026.010**	**915.565.361**
101 BTP	278.037.543	286.344.272
102 CCT		
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	178.659.751	162.227.441
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta		
105 Obbligazioni quotate in euro	405.328.716	419.493.648
106 Obbligazioni quotate in valuta		
107 Obbligazioni non quotate in euro		47.500.000
108 Obbligazioni non quotate in valuta		
150 Altre tipologie di titoli di debito		
200 Titoli di capitale:	**2.070.168**	**2.070.168**
201 Azioni quotate in euro	2.070.168	2.070.168
202 Azioni non quotate in euro		
203 Azioni quotate in valuta		
204 Azioni non quotate in valuta		
250 Altre tipologie di titoli di capitale		
300 Altre attività patrimoniali:	**105.868.086**	**74.820.442**
301 Immobili		
302 Prestiti		
303 Quote di OICR	105.141.470	72.845.509
304 Strumenti derivati		
305 Liquidita'	726.616	1.974.933
350 Altre tipologie di attività		
di cui: 351 Altre attività		
352 Retrocessione di commissioni e altre utilità		
353 Crediti per Commitment versato		
400 Passività patrimoniali:	**-25.062**	**-22.312**
401 Debiti per spese di revisione contabile	-25.062	-22.312
402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività		
1000 Saldo attività della gestione separata	**969.939.202**	**992.433.659**

valori in euro

	Alla chiusura del periodo di osservazione (30/09/2023)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (30/09/2022)
Riserve matematiche	958.376.370	993.541.396
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008		
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008		
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008		

Redatto il 22 Novembre 2023

Il rappresentante legale dell'impresa

Allegato II

Allegato A

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

IMPRESA: GROUPAMA ASSICURAZIONI SPA — CODICE IMPRESA: 095
DENOMINAZIONE GESTIONE SEPARATA: VALOREPIU' — CODICE GESTIONE: 2
PERIODO DI OSSERVAZIONE: 1 Ottobre 2022 - 30 Settembre 2023

valori in euro

Proventi ed oneri distinti per categorie di attività	IMPORTI
100 Proventi da investimenti A	22.820.906
101 Interessi su titoli di Stato in euro	12.152.294
102 Interessi su titoli di Stato in valuta	
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro	8.421.024
104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta	
105 Dividendi su azioni in euro	1.382
106 Dividendi su azioni in valuta	
107 Redditi degli investimenti immobiliari	
150 Altre tipologie di proventi	2.246.207
di cui: 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività	
152 Proventi da retrocessione di commissioni	
153 Proventi da strumenti derivati	
154 Proventi da fondi comuni	2.246.207
200 Utili/perdite da realizzi B	1.794.292
201 Titoli di Stato in euro	1.762.341
202 Titoli di Stato in valuta	
203 Titoli obbligazionari quotati in euro	-1.007.898
204 Titoli obbligazionari non quotati in euro	697.500
205 Titoli obbligazionari quotati in valuta	
206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta	
207 Titoli azionari quotati in euro	
208 Titoli azionari non quotati in euro	
209 Titoli azionari in valuta quotati	
210 Titoli azionari in valuta non quotati	
211 Immobili	
212 Cambi	
250 Altre tipologie di utili/perdite	342.350
di cui: 251 Utili/Perdite su altre attività finanziarie	
252 Utili/perdite su derivati	
253 Utili/perdite da fondi comuni	342.350
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità C	17.989
400 Risultato finanziario lordo A+B+C	24.633.187
500 Spese di revisione contabile D	25.062
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività E	
700 Risultato finanziario netto A+B+C-D-E	24.608.124
800 Giacenza media delle attività investite	993.286.588

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione 2,48%

Il rappresentante legale dell'impresa

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione	tasso realizzato
dal 01/11/21 al 31/10/22	2,40%
dal 01/12/21 al 30/11/22	2,43%
dal 01/01/22 al 31/12/22	2,45%
dal 01/02/22 al 31/01/23	2,46%
dal 01/03/22 al 28/02/23	2,38%
dal 01/04/22 al 31/03/23	2,40%
dal 01/05/22 al 30/04/23	2,49%
dal 01/06/22 al 31/05/23	2,49%
dal 01/07/22 al 30/06/23	2,53%
dal 01/08/22 al 31/07/23	2,44%
dal 01/09/22 al 31/08/23	2,44%
dal 01/10/22 al 30/09/23	2,48%

Redatto il 22 Novembre 2023

Il rappresentante legale dell'impresa