

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ELIOS OBBLIGAZIONARIO

SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2009

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2009		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	10.817.663,60	92,03	12.409.083,30	90,48
A1. Titoli di debito	10.817.663,60	92,03	12.409.083,30	90,48
A1.1. Titoli di Stato	2.787.355,00	23,71	1.651.830,00	12,04
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	5.441.858,00	46,29	9.054.157,60	66,02
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	2.588.450,60	22,02	1.703.095,70	12,42
A2. Titoli azionari	-	-	-	-
A3. Parti di O.I.C.R.	-	-	-	-
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	50.000,00	0,43	649.194,93	4,73
B1. Titoli di debito	50.000,00	0,43	649.194,93	4,73
B1.1. Titoli di Stato	-	-	-	-
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili	50.000,00	0,43	50.000,00	0,36
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	-	-	599.194,93	4,37
B2. Titoli azionari	-	-	-	-
B3. Parti di O.I.C.R.	-	-	-	-
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	-	-	-	-
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
C1.1. Warrant	-	-	-	-
C1.2. Future su indici azionari	-	-	-	-
C1.3. Opzioni Call	-	-	-	-
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
C2.1. Strumenti finanziari derivati non negoziati	-	-	-	-
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE	-	-	-	-
E. DEPOSITI BANCARI	729.559,64	6,21	380.972,86	2,78
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	-	-	-	-
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-	-	-	-
H. ALTRE ATTIVITA'	157.576,59	1,34	275.337,19	2,01
H1. Ratei attivi	154.930,55	1,32	251.843,94	1,84
H2. Altri attivi (da specificare)	2.646,04	0,02	23.493,25	0,17
H2.1. Crediti d'imposta	-	-	-	-
H2.2. Crediti per ritenute	2.646,04	0,02	23.493,25	0,17
H2.3. Retrocessione Commissioni	-	-	-	-
H2.4. Altre Attività Diverse	-	-	-	-
TOTALE ATTIVITA'	11.754.799,83	100,00	13.714.588,28	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2009		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)	-	-	-	-
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE	-	-	-	-
M. ALTRE PASSIVITA'	-	14.104,49	-	100,00
M1. Ratei passivi	-	-	-	-
M2. Spese pubblicazione quota	-	-	-	-
M3. Spese revisione rendiconto	-	-	-	-
M4. Commissione di gestione	-	14.104,49	-	100,00
M5. Passività diverse	-	-	-	-
TOTALE PASSIVITA'	-	14.104,49	-	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		11.740.695,34		13.698.500,29
Numero delle quote in circolazione		1.011.140,74000		1.303.062,49300
Valore unitario delle quote		11,611		10,512

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	36.890,02	20.630,92	21.924,03	13.794,64
Quote rimborsate	85.918,24	108.420,77	119.702,12	71.120,23

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ELIOS OBBLIGAZIONARIO

SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2009

	Rendiconto al 31-12-2009		Rendiconto esercizio precedente	
A. STRUMENTI FINANZIARI				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	515.010,50		767.244,95	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	515.010,50		767.244,95	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	-		-	
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	-		-	
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	392.063,90		90.700,59	
A2.1 Titoli di debito	392.063,90		90.700,59	
A2.2. Titoli azionari	-		-	
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-		-	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	514.755,41		1.022.926,80	
A3.1. Titoli di debito	514.755,41		1.022.926,80	
A3.2. Titoli di capitale	-		-	
A3.3. Parti di O.I.C.R.	-		-	
Risultato gestione strumenti finanziari		1.421.829,81		346.382,44
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	7.918,80		44.825,16	
C1. SU DEPOSITI BANCARI	7.918,80		44.825,16	
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		1.429.748,61		301.557,28
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-		-	
G1. Bolli, spese e commissioni	-		-	
Risultato netto della gestione di portafoglio		1.429.748,61		301.557,28
H. ONERI DI GESTIONE	- 198.077,14		- 264.482,50	
H1. Commissione di gestione	- 189.377,63		- 253.448,01	
H2. Spese pubblicazione quota	- 1.152,00		- 1.152,00	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	- 7.547,51		- 9.882,49	
H4. Altri oneri di gestione	-		-	
I. ALTRI RICAVI E ONERI	2,24		0,13	
I1. Altri ricavi	2,24		-	
I2. Altri costi	-		0,13	
Utile/perdita della gestione del Fondo		1.231.673,71		566.039,91

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	10,45	Volatilità della gestione	3,26
Rendimento del benchmark	4,57	Volatilità del benchmark **	
Differenza	5,88	Volatilità dichiarata ***	0-3

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
		Volatilità dichiarata	

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark