

## RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ELIOS OBBLIGAZIONARIO EURO

## 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
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>	<b>1.766.629,05</b>	<b>86,52</b>	<b>1.994.179,20</b>	<b>92,84</b>
A1. Titoli di debito	1.766.629,05	86,52	1.994.179,20	92,84
A1.1. Titoli di Stato	709.002,00	34,72	586.800,00	27,32
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	928.130,70	45,46	1.340.534,75	62,41
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	129.496,35	6,34	66.844,45	3,11
A2. Titoli azionari	-	-	-	-
A3. Parti di O.I.C.R.	-	-	-	-
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
B1. Titoli di debito	-	-	-	-
B1.1. Titoli di Stato	-	-	-	-
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili	-	-	-	-
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	-	-	-	-
B2. Titoli azionari	-	-	-	-
B3. Parti di O.I.C.R.	-	-	-	-
<b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
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	-	-	-	-
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
E. DEPOSITI BANCARI	253.345,32	12,41	115.354,26	5,37
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	-	-	-	-
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-	-	-	-
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>	<b>21.862,49</b>	<b>1,07</b>	<b>38.522,23</b>	<b>1,79</b>
H1. Ratei attivi	21.206,75	1,04	36.166,00	1,68
H2. Altri attivi (da specificare)	655,74	0,03	2.356,23	0,11
H2.1. Crediti d'imposta	-	-	-	-
H2.2. Crediti per ritenute	655,74	0,03	2.356,23	0,11
H2.3. Retrocessione Commissioni	-	-	-	-
H2.4. Altre Attività Diverse	-	-	-	-
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>2.041.836,86</b>	<b>100,00</b>	<b>2.148.055,69</b>	<b>100,00</b>

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2009		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale passività	Valore complessivo	% sul totale passività
<b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
<b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>- 2.023,12</b>	<b>100,00</b>	<b>- 2.064,33</b>	<b>100,00</b>
M1. Ratei passivi	-	-	-	-
M2. Spese pubblicazione quota	-	-	-	-
M3. Spese revisione rendiconto	-	-	-	-
M4. Commissione di gestione	- 2.023,12	100,00	- 2.064,33	100,00
M5. Passività diverse	-	-	-	-
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>- 2.023,12</b>	<b>100,00</b>	<b>- 2.064,33</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>2.039.813,74</b>		<b>2.145.991,36</b>
Numero delle quote in circolazione		154.145,35800		176.029,37600
Valore unitario delle quote		13,233		12,191

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	9.628,32	6.770,49	2.938,93	4.767,82
Quote rimborsate	13.915,59	16.274,21	12.681,81	3.117,96

## RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ELIOS OBBLIGAZIONARIO EURO

## SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2009

	Rendiconto al 31-12-2009		Rendiconto esercizio precedente	
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI</b>				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	74.956,70		102.274,77	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	74.956,70		102.274,77	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	-		-	
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	-		-	
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	59.650,13		17.663,84	
A2.1 Titoli di debito	59.650,13		17.663,84	
A2.2. Titoli azionari	-		-	
A2.3. Parti di O.I.C.R.	-		-	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	66.807,34		21.637,69	
A3.1. Titoli di debito	66.807,34		21.637,69	
A3.2. Titoli di capitale	-		-	
A3.3. Parti di O.I.C.R.	-		-	
<b>Risultato gestione strumenti finanziari</b>		<b>201.414,17</b>		<b>62.973,24</b>
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
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	-		-	
<b>Risultato gestione strumenti finanziari derivati</b>		-		-
<b>C. INTERESSI ATTIVI</b>	<b>2.428,67</b>		<b>8.696,01</b>	
C1. SU DEPOSITI BANCARI	2.428,67		8.696,01	
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-		-	
<b>D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI</b>	-		-	
D1. RISULTATI REALIZZATI	-		-	
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	-		-	
<b>E. PROVENTI SU CREDITI</b>	-		-	
<b>F. ALTRI PROVENTI</b>	-		-	
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI	-		-	
F2. PROVENTI DIVERSI	-		-	
<b>Risultato lordo della gestione di portafoglio</b>		<b>203.842,84</b>		<b>71.669,25</b>
<b>G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)</b>	-		-	
G1. Bolli, spese e commissioni	-		-	
<b>Risultato netto della gestione di portafoglio</b>		<b>203.842,84</b>		<b>71.669,25</b>
<b>H. ONERI DI GESTIONE</b>	- <b>30.423,11</b>		- <b>35.156,74</b>	
H1. Commissione di gestione	- 26.225,30		- 30.927,57	
H2. Spese pubblicazione quota	- 1.152,00		- 1.152,00	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	- 3.045,81		- 3.077,17	
H4. Altri oneri di gestione	-		-	
<b>I. ALTRI RICAVI E ONERI</b>	- <b>1,39</b>		-	
I1. Altri ricavi	-		-	
I2. Altri costi	- 1,39		-	
<b>Utile/perdita della gestione del Fondo</b>		<b>173.418,34</b>		<b>36.512,51</b>

## SEZIONE DI CONFRONTO \*

Rendimento della gestione	8,55	Volatilità della gestione	1,61
Rendimento del benchmark	4,57	Volatilità del benchmark **	
Differenza	3,98	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