

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	108.786.144,32	82,20	85.710.811,00	57,44
A1. Titoli di debito	20.806.521,78	15,72	7.367.493,00	4,94
A1.1. Titoli di Stato	-	-	-	-
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili	17.537.203,35	13,25	7.367.493,00	4,94
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi	3.269.318,43	2,47	-	-
A2. Titoli azionari	87.979.622,54	66,47	75.370.198,00	50,51
A3. Parti di O.I.C.R.	-	-	2.973.120,00	1,99
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI	13.759.719,49	10,40	15.543.435,66	10,42
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.	13.759.719,49	10,40	15.543.435,66	10,42
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	-	-	5.054.305,42	3,39
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	-	-
C1.1. Warrant	-	-	-	-
C1.2. Future su indici azionari	-	-	-	-
C1.3. Opzioni Call	-	-	-	-
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)	-	-	5.054.305,42	3,39
C2.1. Strumenti finanziari derivati non negoziati	-	-	5.054.305,42	3,39
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE	-	-	-	-
E. DEPOSITI BANCARI	8.876.787,96	6,71	42.086.384,20	28,21
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare	56.418,85	0,04	148.341,87	0,10
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-	-	-	-
H. ALTRE ATTIVITA'	871.358,57	0,66	668.207,29	0,45
H1. Ratei attivi	346.246,63	0,26	68.316,13	0,05
H2. Altri attivi (da specificare)	525.111,94	0,40	599.891,16	0,40
H2.1. Crediti d'imposta	-	-	-	-
H2.2. Crediti per ritenute	525.111,94	0,40	599.891,16	0,40
H2.3. Retrocessione Commissioni	-	-	-	-
H2.4. Altre Attività Diverse	-	-	-	-
TOTALE ATTIVITA'	132.350.429,19	100,00	149.211.485,44	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'	204.251,79	100,00	228.829,26	100,00
M1. Ratei passivi	-	-	-	-
M2. Spese pubblicazione quota	-	-	-	-
M3. Spese revisione rendiconto	-	-	-	-
M4.1 Commissioni di Gestione ELIOS TREND PLUS	15.439,43	7,56	18.078,86	7,90
M4.2 Commissioni di Gestione ELIOS TREND	188.812,36	92,44	210.750,40	92,10
M5. Passività diverse	-	-	-	-
TOTALE PASSIVITA'	204.251,79	100,00	228.829,26	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO	-	132.146.177,40	-	148.982.656,18
ELIOS TREND PLUS Numero quote in circolazione	-	1.402.436,14900	-	1.823.330,74100
ELIOS TREND PLUS Valore unitario delle quote	-	7,14800	-	6,43100
ELIOS TREND Numero quote in circolazione	-	10.560.972,89500	-	13.193.666,87600
ELIOS TREND Valore unitario delle quote	-	11,56300	-	10,40300

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
ELIOS TREND PLUS Quote emesse	6.599,11900	7.310,21100	3.640,85900	3.720,84200
ELIOS TREND PLUS Quote Rimborsate	154.957,07800	102.618,24600	61.503,86100	123.086,43800
ELIOS TREND Quote emesse	101.752,07500	71.790,35600	90.008,84800	55.421,03700
ELIOS TREND Quote Rimborsate	945.084,11000	722.205,68500	590.260,34200	694.116,16000

RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) ELIOS TREND
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2009

	Rendiconto al 31-12-2009		Rendiconto esercizio precedente	
A. STRUMENTI FINANZIARI				
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	3.274.753,78		5.891.202,23	
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	764.104,41		389.319,97	
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	2.510.649,37		5.409.482,58	
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.	-		92.399,68	
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	- 409.160,72		- 51.647.155,45	
A2.1. Titoli di debito	741.154,95		34.207,63	
A2.2. Titoli azionari	- 859.177,94		- 50.258.556,77	
A2.3. Parti di O.I.C.R.	- 291.137,73		- 1.354.391,05	
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	16.508.966,72		37.220.499,60	
A3.1. Titoli di debito	1.667.549,42		174.887,15	
A3.2. Titoli di capitale	12.844.618,14		33.622.509,42	
A3.3. Parti di O.I.C.R.	1.996.799,16		3.423.103,03	
Risultato gestione strumenti finanziari		19.374.559,78		82.976.452,82
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	- 6.601.812,04			
B1. RISULTATI REALIZZATI	- 1.547.506,62		- 7.138.756,09	
B1.1. Su strumenti negoziati	- 2.039.197,10		- 411.308,75	
B1.2. Su strumenti non negoziati	491.690,48		7.550.064,84	
B2. RISULTATI NON REALIZZATI	- 5.054.305,42		5.054.305,42	
B2.1. Su strumenti negoziati	-		-	
B2.2. Su strumenti non negoziati	- 5.054.305,42		5.054.305,42	
Risultato gestione strumenti finanziari derivati		6.601.812,04		2.084.450,67
C. INTERESSI ATTIVI	306.570,17		638.268,27	
C1. SU DEPOSITI BANCARI	306.570,17		638.268,27	
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI	-		-	
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI	2.810.800,85		6.990.119,83	
D1. RISULTATI REALIZZATI	3.573.720,08		5.534.831,89	
D2. RISULTATI NON REALIZZATI	- 762.919,23		1.455.287,94	
E. PROVENTI SU CREDITI		-		-
F. ALTRI PROVENTI	11.549,96		238.714,67	
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI	-		-	
F2. PROVENTI DIVERSI	11.549,96		238.714,67	
Risultato lordo della gestione di portafoglio		15.901.668,72		77.193.800,72
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	- 23.941,82		- 17.262,09	
G1. Bolli, spese e commissioni	- 23.941,82		- 17.262,09	
Risultato netto della gestione di portafoglio		15.877.726,90		77.211.062,81
H. ONERI DI GESTIONE	- 2.646.876,11		- 4.186.562,38	
H1.1 Commissioni di Gestione ELIOS TREND PLUS	- 203.933,11		- 321.983,36	
H1.2 Commissioni di Gestione ELIOS TREND	- 2.425.821,87		- 3.848.529,43	
H2. Spese pubblicazione quota	- 2.304,00		- 2.304,00	
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	- 14.817,13		- 11.587,87	
H4. Altri oneri di gestione	-		- 2.157,72	
I. ALTRI RICAVI E ONERI	39.340,32		102.156,70	
I1. Altri ricavi	50.919,17		102.238,57	
I2. Altri costi	- 11.578,85		- 81,87	
Utile/perdita della gestione del Fondo		13.270.191,11		81.295.468,49

SEZIONE DI CONFRONTO *

ELIOS TREND PLUS			
Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
Rendimento del benchmark		Volatilità del benchmark**	
Differenza		Volatilità dichiarata***	
ELIOS TREND			
Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
Rendimento del benchmark		Volatilità del benchmark**	
Differenza		Volatilità dichiarata***	

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rend.ELIOS TREND PLUS	11,15	Volatilità della gestione	11,61
		Volatilità dichiarata	15
Rend.ELIOS TREND	11,15	Volatilità della gestione	11,61
		Volatilità dichiarata	15

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark