

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) Quadrif. Portafoglio Protetto
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2006

Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2006		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI				
A1. Titoli di debito				
A1.1. Titoli di Stato				
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.				
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI				
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.				
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI	27.536.058,98	99,89	34.015.666,30	99,93
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	27.536.058,98	99,89	34.015.666,30	99,93
C1.1. Opzione - Call Asiatica su Fondi Comuni di Investimento				
C1.2. Contratto swap	27.536.058,98	99,89	34.015.666,30	99,93
C1.3. Opzione su basket titoli azionari internazionali Acquistate				
C1.4. Opzione call su titoli obbligazionari				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	30.380,83	0,11	22.663,88	0,07
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare				
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	381,43		300,94	
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	381,43		300,94	
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	381,43		300,94	
H2.3. Crediti diversi				
TOTALE ATTIVITA'	27.566.821,24	100,00	34.038.631,12	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2006		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
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'	-7.751,19	100,00	-8.509,29	100,00
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto	-4.108,00	53,00	-4.015,00	47,18
M4. Commissione di gestione	-3.624,68	46,76	-4.475,78	52,60
M5. Passività diverse	-18,51	0,24	-18,51	0,22
TOTALE PASSIVITA'	-7.751,19	100,00	-8.509,29	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		27.559.070,05		34.030.121,83
Numero delle quote in circolazione		274.002,54500		335.990,51500
Valore unitario delle quote		100,58		101,283

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	532,69000	83,24900	770,02900	327,00400
Quote rimborsate	17.736,11500	6.113,70100	10.040,16800	29.810,95800

Data: 28 febbraio 2007

Firma:

QUADRIFOGLIO VITA SPA
 DIRETTORE GENERALE

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) Quadrif. Portafoglio Protetto
SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2006

Allegato 2

	Rendiconto al 31-12-2006	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
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		
A2.1. Titoli di debito		
A2.2. Titoli azionari		
A2.3. Parti di O.I.C.R.		
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE		
A3.1. Titoli di debito		
A3.2. Titoli di capitale		
A3.3. Parti di O.I.C.R.		
Risultato gestione strumenti finanziari		
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		
B1. RISULTATI REALIZZATI	205.361,35	255.183,24
B1.1. Su strumenti negoziati	205.361,35	255.183,24
B1.2. Su strumenti non negoziati		
B2. RISULTATI NON REALIZZATI	80.320,43	68.628,40
B2.1. Su strumenti negoziati	80.320,43	68.628,40
B2.2. Su strumenti non negoziati		
Risultato gestione strumenti finanziari derivati	285.681,78	323.811,64
C. INTERESSI ATTIVI	1.031,35	813,62
C1. SU DEPOSITI BANCARI	1.031,35	813,62
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	381,43	300,94
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI	381,43	300,94
Risultato lordo della gestione di portafoglio	287.094,56	324.926,20
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)		-196,40
G1. Bolli, spese e commissioni		-196,40
Risultato netto della gestione di portafoglio	287.094,56	324.729,80
H. ONERI DI GESTIONE	-507.399,17	-580.590,56
H1. Commissione di gestione	-502.065,37	-575.354,27
H2. Spese pubblicazione quota	-1.152,00	-1.152,00
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-4.181,80	-4.015,00
H4. Altri oneri di gestione		-69,29
I. ALTRI RICAVI E ONERI	-266,60	
I1. Altri ricavi		
I2. Altri costi	-266,60	
Utile/perdita della gestione del Fondo	-220.571,21	-255.860,76

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

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	-0,69	Volatilità della gestione	2,09
		Volatilità dichiarata	8,381

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Data: 28 febbraio 2007

Firma.

QUADRIFOGLIO VITA SPA
 DIRETTORE GENERALE