

A large, light gray compass rose graphic is centered in the background. It features a central circle with radiating lines, surrounded by four larger circles with pointed, gear-like edges.

fopdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 30 settembre 2018

Valore e rendimento quote



	Rendimento 2017 ⁽¹⁾	VALORE QUOTE 01/01/18	VALORE QUOTE 30/09/18	RENDIMENTO DA INIZIO 2018 ⁽¹⁾	ANDP ^(*) 30/09/18
GARANTITO ASSICURATIVO	2,57%	€ 11,440	€ 11,618	1,56%	€ 22.648.173,60
BILANCIATO	1,38%	€ 31,684	€ 31,491	-0,61%	€ 314.788.979,24
DINAMICO	3,04%	€ 32,801	€ 32,871	0,21%	€ 69.405.377,73
				TOTALE	€ 406.842.530,57
RIVALUTAZIONE TFR	1,74%			1,73%	
INDICE DI INFLAZIONE	0,80%			1,29%	

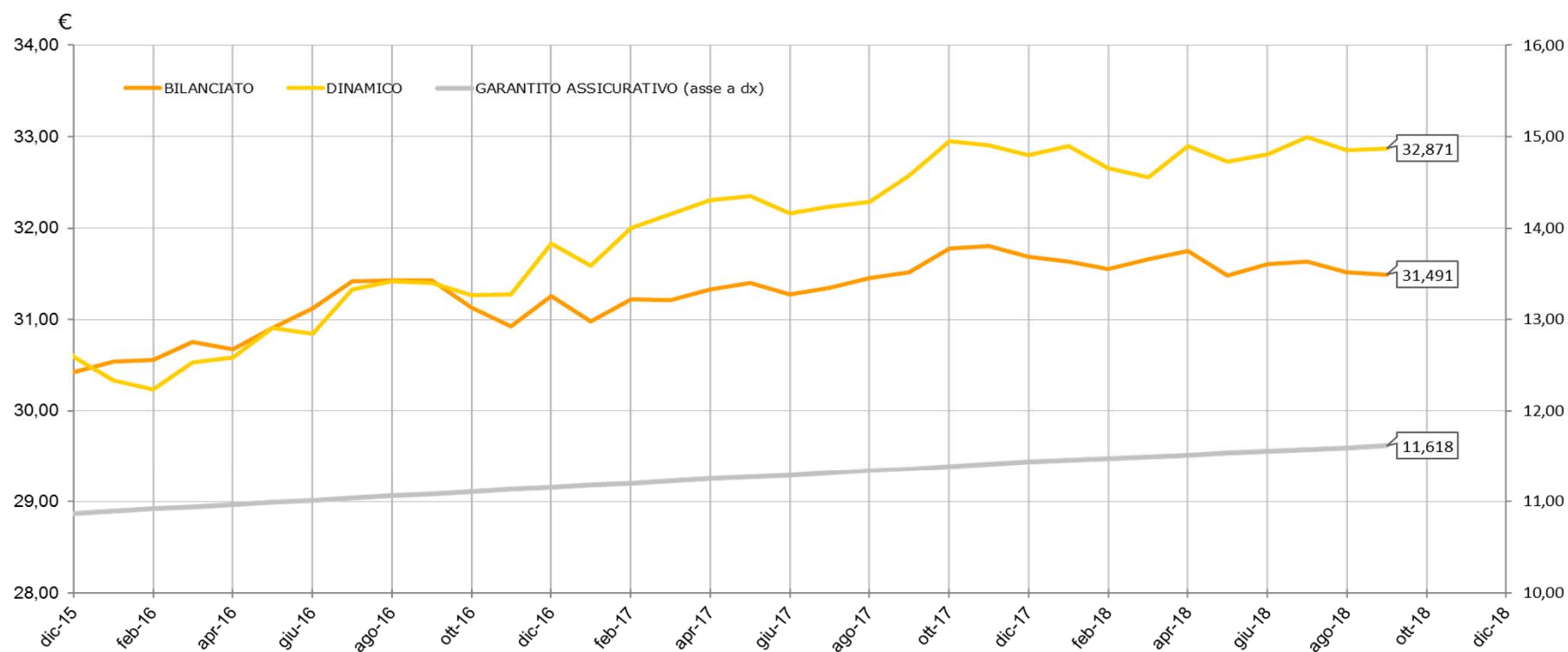
(Tabella 1)

1) I rendimenti sono calcolati al netto dell'imposta sostitutiva vigente stabilita dalla Legge di Stabilità 2015, delle commissioni dei Gestori Finanziari e della Banca Depositaria e delle spese della Gestione Amministrativa.

(*) ANDP: Attivo Netto Destinato alle Prestazioni

Nella tabella l'ANDP tiene conto degli switch tra i diversi comparti.

Andamento storico valore quote



(Grafico 1)

Valore portafoglio e performance

	VALORE PORTAFOGLIO ⁽¹⁾ 30/09/18	% COMPARTO SU PORTAFOGLIO	PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno	PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno	DELTA vs BMK
BILANCIATO	€ 313.426.222	77,40%	-0,647%	-0,280%	-0,367%
DINAMICO	€ 68.927.220	17,02%	0,383%	1,020%	-0,637%
TOT. COMPARTI FINANZIARI	€ 382.353.442	94,42%	-0,461%	-0,046%	-0,415%
GARANTITO ASSICURATIVO	€ 22.604.601	5,58%	1,868%		
TOT. FOPDIRE	€ 404.958.042	100,00%			

(Tabella 2)

(1) Valore non comprensivo di conferimenti, prelievi e commissioni liquidate nel periodo.

Performance e rischio del portafoglio



	Performance		Volatilità ⁽¹⁾		Indice di Sharpe ⁽²⁾	
	ptf	bmk	ptf	bmk	ptf	bmk
COMPARTO BILANCIATO	-0,65%	-0,28%	2,43%	2,14%	neg.	neg.
COMPARTO DINAMICO	0,38%	1,02%	3,64%	3,50%	0,26%	0,50%

(Tabella 3)

- (1) Indicatore di rischio che misura la deviazione standard delle performance dei Comparti
(2) Indicatore che rappresenta la performance dei compartimenti rispetto a un tasso risk-free (EURIBOR 3M) in rapporto alla volatilità dei compartimenti stessi