

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

fapdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 31 luglio 2018

Valore e rendimento quote



	Rendimento 2017 ⁽¹⁾	VALORE QUOTE 01/01/18	VALORE QUOTE 31/07/18	RENDIMENTO DA INIZIO 2018 ⁽¹⁾	ANDP ^(*) 31/07/18
GARANTITO ASSICURATIVO	2,57%	€ 11,440	€ 11,577	1,20%	€ 21.340.978,11
BILANCIATO	1,38%	€ 31,684	€ 31,631	-0,17%	€ 312.617.789,57
DINAMICO	3,04%	€ 32,801	€ 32,998	0,60%	€ 67.900.553,84
				TOTALE	€ 401.859.321,52
RIVALUTAZIONE TFR	1,74%			1,59%	
INDICE DI INFLAZIONE	0,80%			1,38%	

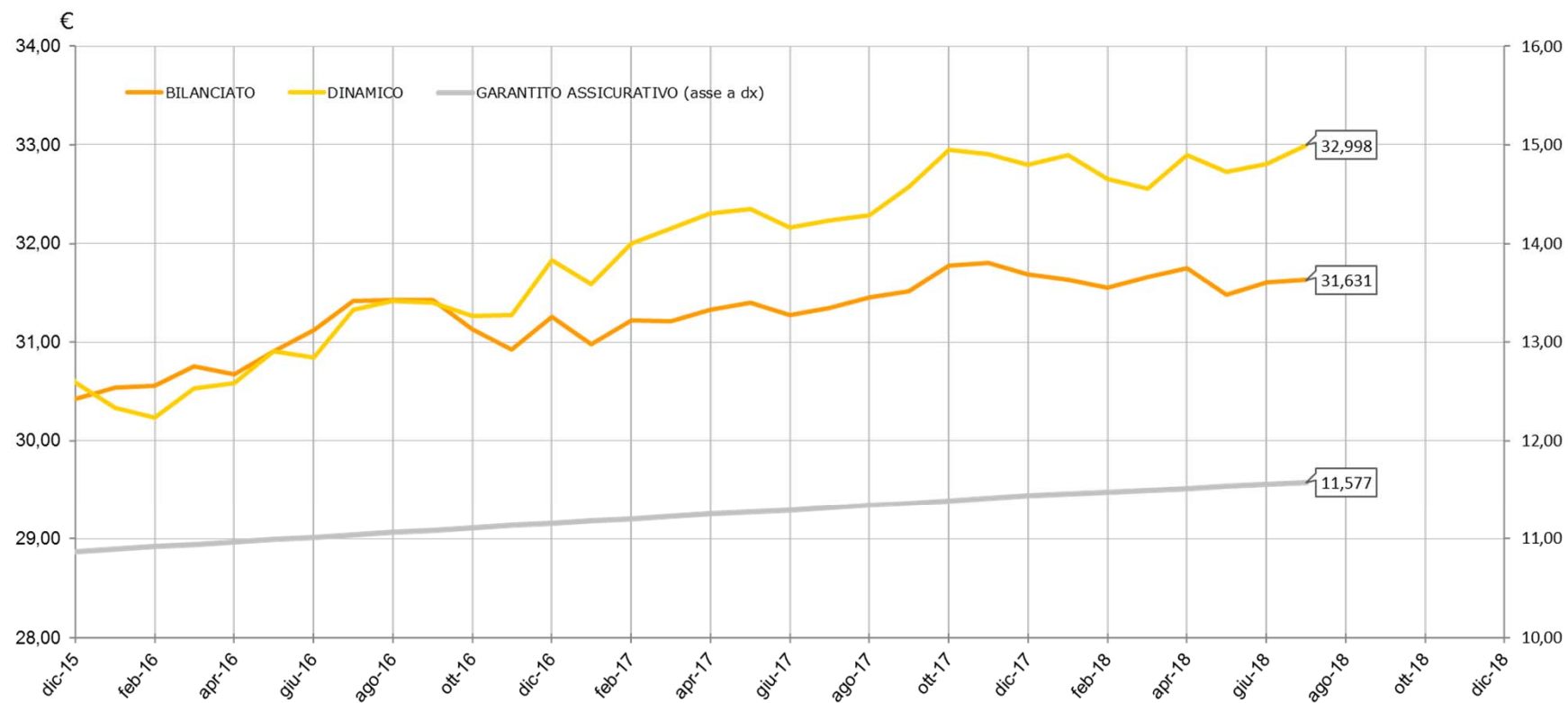
(Tabella 1)

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⁾ 31/07/18	% COMPARTO SU PORTAFOGLIO	PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno	PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno	DELTA vs BMK
BILANCIATO	€ 312.555.229	77,85%	-0,143%	0,210%	-0,353%
DINAMICO	€ 67.663.277	16,85%	0,861%	1,370%	-0,509%
TOT. COMPARTI FINANZIARI	€ 380.218.506	94,71%	0,036%	0,416%	-0,380%
GARANTITO ASSICURATIVO	€ 21.247.783	5,29%	1,435%		
TOT. FOPDIRE	€ 401.466.289	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	-0,14%	0,21%	2,54%	2,25%	0,04%	0,32%
COMPARTO DINAMICO	0,86%	1,37%	4,01%	3,76%	0,45%	0,72%

(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