

A large, light gray compass rose is centered in the background of the page. It features a circular center with radiating lines, surrounded by four main points and smaller intermediate points, all enclosed within a circular border.

fapdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 30 giugno 2018

Valore e rendimento quote



	Rendimento 2017 ⁽¹⁾	VALORE QUOTE 01/01/18	VALORE QUOTE 30/06/18	RENDIMENTO DA INIZIO 2018 ⁽¹⁾	ANDP ^(*) 30/06/18
GARANTITO ASSICURATIVO	2,57%	€ 11,440	€ 11,558	1,03%	€ 21.167.641,67
BILANCIATO	1,38%	€ 31,684	€ 31,606	-0,25%	€ 311.724.519,65
DINAMICO	3,04%	€ 32,801	€ 32,803	0,01%	€ 66.753.796,08
				TOTALE	€ 399.645.957,40
RIVALUTAZIONE TFR	1,74%			1,30%	
INDICE DI INFLAZIONE	0,80%			1,09%	

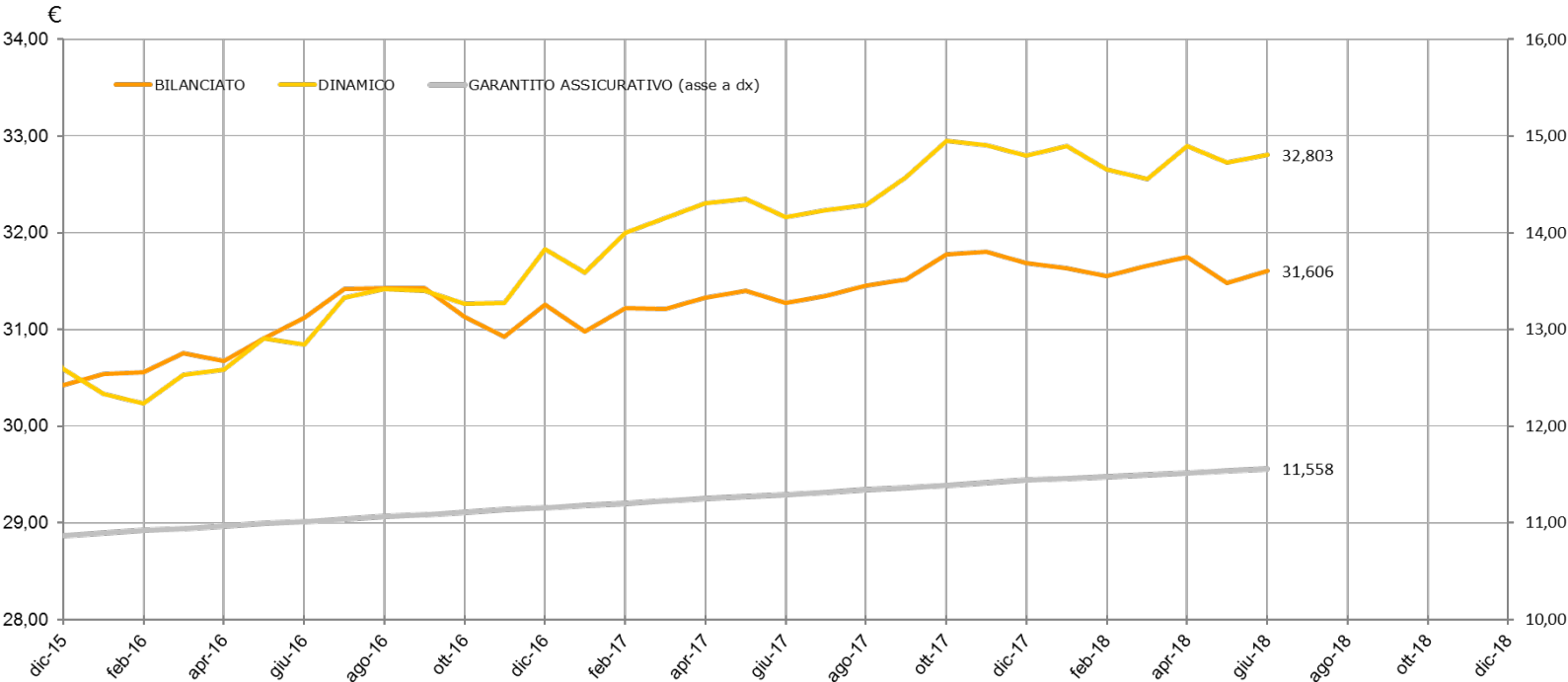
(Tabella 1)

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⁾ 30/06/18	% COMPARTO SU PORTAFOGLIO	PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno	PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno	DELTA vs BMK
BILANCIATO	€ 311.680.998	78,08%	-0,303%	0,140%	-0,443%
DINAMICO	€ 66.453.161	16,65%	0,054%	0,590%	-0,536%
TOT. COMPARTI FINANZIARI	€ 378.134.159	94,73%	-0,240%	0,219%	-0,459%
GARANTITO ASSICURATIVO	€ 21.056.918	5,27%	1,235%		
TOT. FOPDIRE	€ 399.191.078	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	-0,30%	0,14%	2,64%	2,30%	neg.	0,27%
COMPARTO DINAMICO	0,05%	0,59%	4,18%	3,88%	0,13%	0,40%

(Tabella 3)

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