

A large, light gray compass rose is centered in the background of the slide. It features a circular center with radiating lines, surrounded by four pointed lobes, each containing a smaller circular pattern.

fapdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 31 marzo 2018

Valore e rendimento quote



	Rendimento 2017 ⁽¹⁾	VALORE QUOTE 01/01/18	VALORE QUOTE 31/03/18	RENDIMENTO DA INIZIO 2018 ⁽¹⁾	ANDP ^(*) 31/03/18
GARANTITO ASSICURATIVO	2,57%	€ 11,440	€ 11,498	0,51%	€ 18.183.941,10
BILANCIATO	1,38%	€ 31,684	€ 31,658	-0,08%	€ 308.973.631,93
DINAMICO	3,04%	€ 32,801	€ 32,558	-0,74%	€ 63.810.848,90
				TOTALE	€ 390.968.421,93
RIVALUTAZIONE TFR	1,74%			0,68%	
INDICE DI INFLAZIONE	0,80%			0,59%	

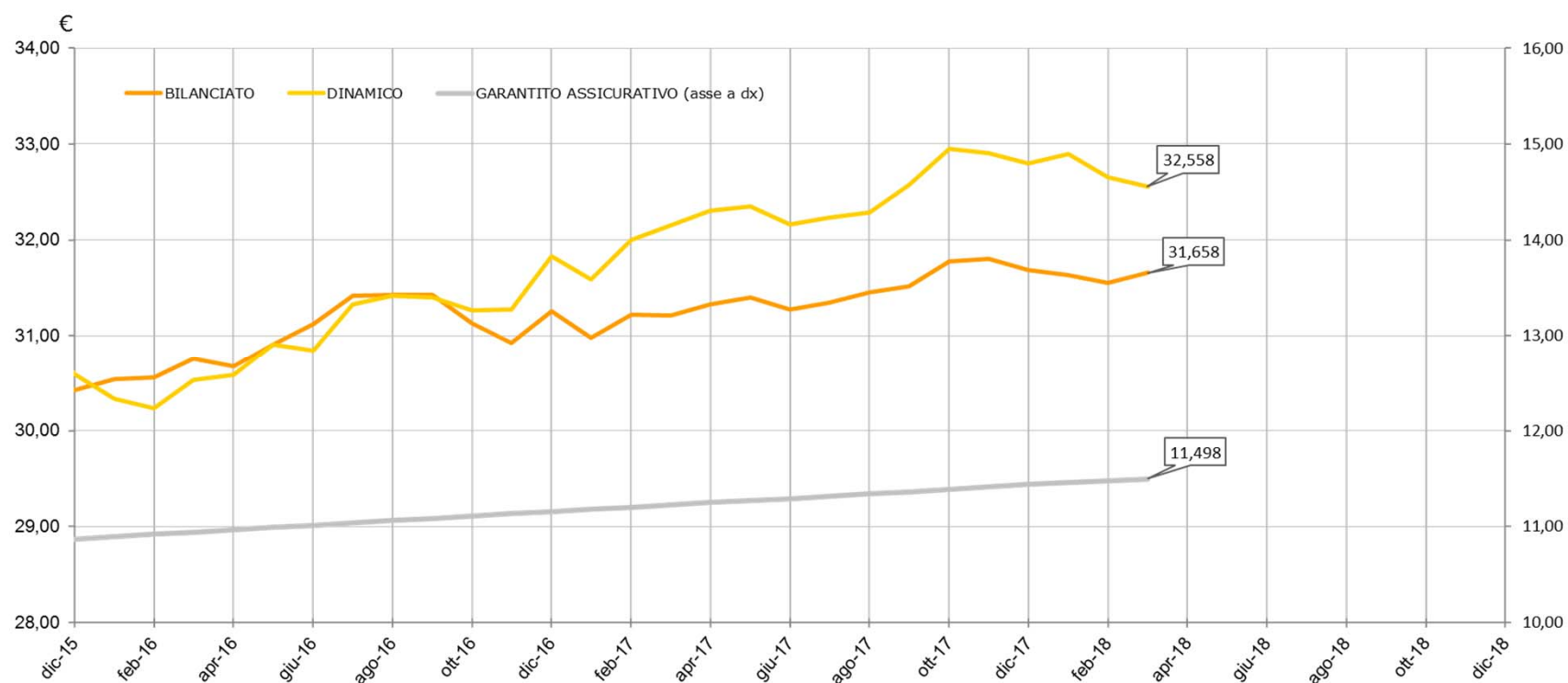
(Tabella 1)

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⁾ 31/03/18	% COMPARTO SU PORTAFOGLIO	PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno	PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno	DELTA vs BMK
BILANCIATO	€ 310.558.963	79,30%	-0,119%	0,100%	-0,219%
DINAMICO	€ 62.940.899	16,07%	-0,917%	-0,570%	-0,347%
TOT. COMPARTI FINANZIARI	€ 373.499.862	95,38%	-0,253%	-0,013%	-0,240%
GARANTITO ASSICURATIVO	€ 18.105.845	4,62%	0,613%		
TOT. FOPDIRE	€ 391.605.708	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	bnk	ptf	bnk	ptf	bnk
COMPARTO BILANCIATO	-0,12%	0,10%	2,01%	2,17%	neg.	0,35%
COMPARTO DINAMICO	-0,92%	-0,57%	4,44%	4,30%	neg.	neg.

(Tabella 3)

(1) Indicatore di rischio che misura la deviazione standard delle performance dei Comparti

(2) Indicatore che rappresenta la performance dei compartii rispetto a un tasso risk-free (EURIBOR 3M) in rapporto alla volatilità dei compartii stessi