

A large, light gray compass rose is centered in the background. It features a central circle with radiating lines, surrounded by concentric circles and four main points with decorative, pointed ends.

fapdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 31 AGOSTO 2017

Valore e rendimento quote



| | Rendimento 2016 ⁽¹⁾ | VALORE QUOTE 01/01/17 | VALORE QUOTE 31/08/17 | RENDIMENTO DA INIZIO 2017 ⁽¹⁾ | ANDP ^(*) 31/08/17 |
|-------------------------------|-----------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|---------------------------------|
| GARANTITO ASSICURATIVO | 2,62% | € 11,153 | € 11,340 | 1,68% | € 17.194.869,56 |
| BILANCIATO | 2,73% | € 31,252 | € 31,455 | 0,65% | € 306.886.565,54 |
| DINAMICO | 4,05% | € 31,832 | € 32,288 | 1,43% | € 59.004.591,78 |
| | | | | TOTALE | € 383.086.026,88 |
| RIVALUTAZIONE TFR | 1,49% | | | 1,51% | |
| INDICE DI INFLAZIONE | 0,30% | | | 1,10% | |

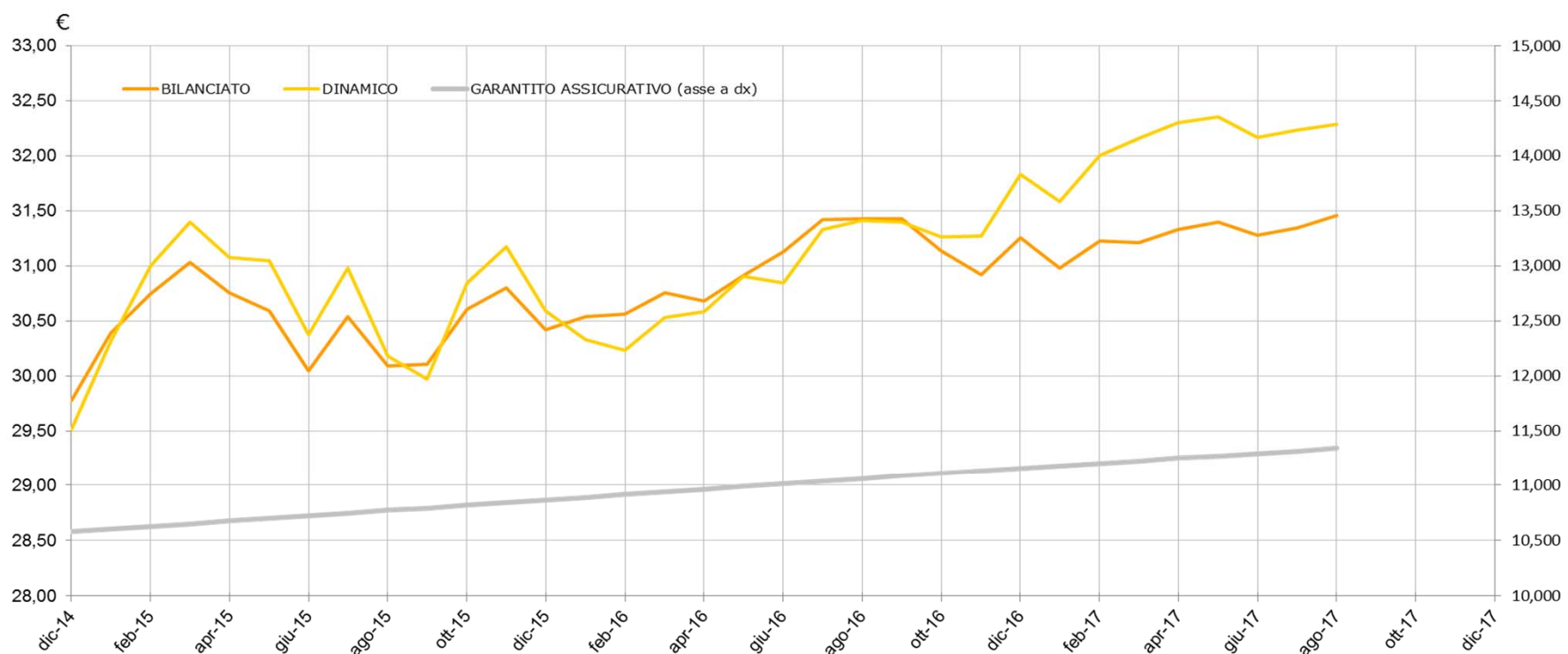
(Tabella 1)

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⁾ 31/08/17 | % COMPARTO SU PORTAFOGLIO | PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno | PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno | DELTA vs BMK |
|---------------------------------|--|------------------------------|--|--|-----------------|
| BILANCIATO | € 307.381.512 | 80,13% | 1,005% | 0,770% | 0,235% |
| DINAMICO | € 59.047.050 | 15,39% | 1,910% | 1,500% | 0,410% |
| TOT. COMPARTI FINANZIARI | € 366.428.562 | 95,52% | 1,151% | 0,888% | 0,263% |
| GARANTITO ASSICURATIVO | € 17.169.704 | 4,48% | 2,013% | | |
| TOT. FOPDIRE | € 383.598.266 | 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 | 1,00% | 0,77% | 1,75% | 2,15% | 1,04% | 0,70% |
| COMPARTO DINAMICO | 1,91% | 1,50% | 3,21% | 2,89% | 1,00% | 0,90% |

(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