

A large, light gray compass rose graphic is centered in the background, with its four cardinal points pointing towards the corners of the page. The compass rose has a circular center with radiating lines and a decorative outer ring.

fap dire
Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 31 LUGLIO 2017

Valore e rendimento quote



| | Rendimento 2016 ⁽¹⁾ | VALORE QUOTE 01/01/17 | VALORE QUOTE 31/07/17 | RENDIMENTO DA INIZIO 2017 ⁽¹⁾ | ANDP ^(*) 31/07/17 |
|-------------------------------|-----------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|---------------------------------|
| GARANTITO ASSICURATIVO | 2,62% | € 11,153 | € 11,317 | 1,47% | € 17.107.395,32 |
| BILANCIATO | 2,73% | € 31,252 | € 31,345 | 0,30% | € 304.697.200,49 |
| DINAMICO | 4,05% | € 31,832 | € 32,331 | 1,57% | € 58.548.246,17 |
| | | | | TOTALE | € 380.352.841,98 |
| RIVALUTAZIONE TFR | 1,49% | | | 1,16% | |
| INDICE DI INFLAZIONE | 0,30% | | | 0,70% | |

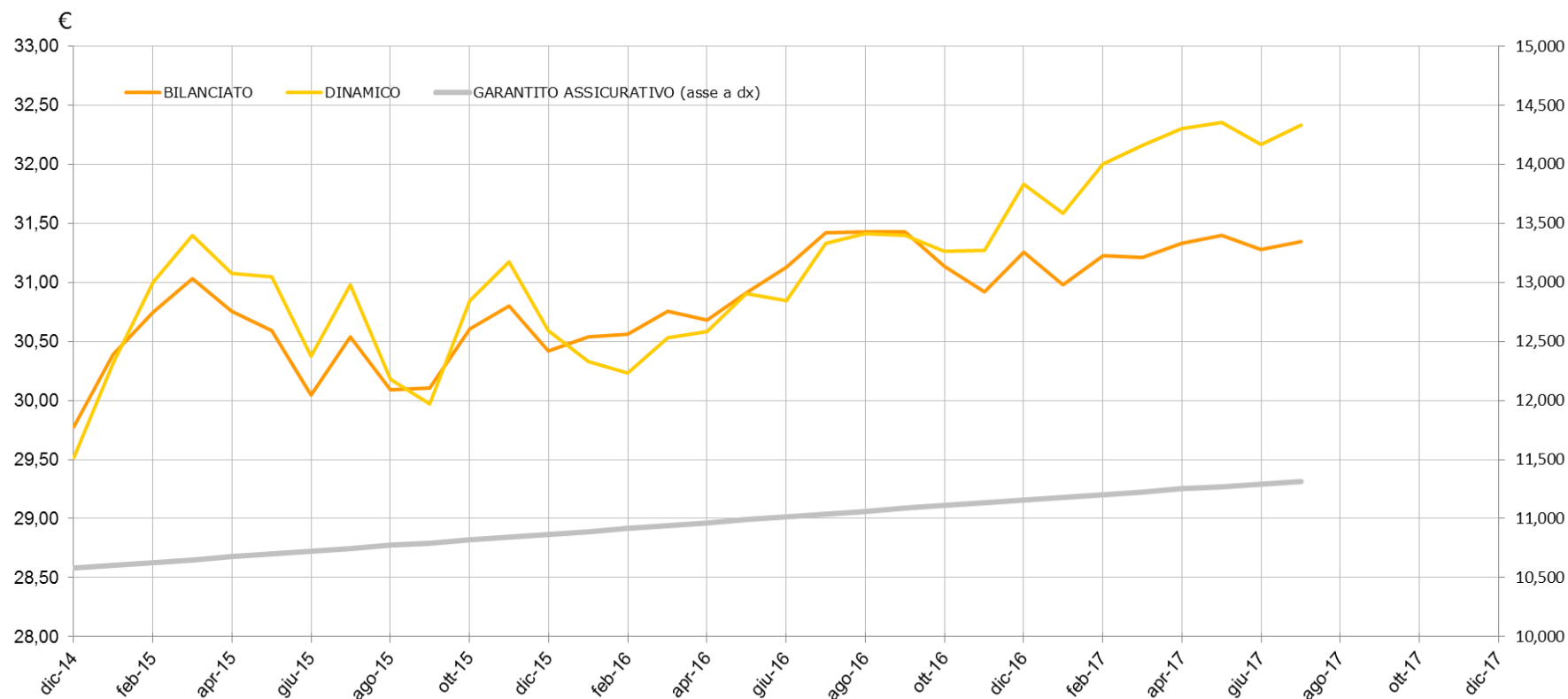
(Tabella 1)

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⁾ 31/07/17 | % COMPARTO SU PORTAFOGLIO | PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno | PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno | DELTA vs BMK |
|---------------------------------|--|------------------------------|--|--|-----------------|
| BILANCIATO | € 304.645.868 | 80,14% | 0,586% | 0,270% | 0,316% |
| DINAMICO | € 58.492.013 | 15,39% | 1,696% | 1,230% | 0,466% |
| TOT. COMPARTI FINANZIARI | € 363.137.881 | 95,53% | 0,765% | 0,425% | 0,340% |
| GARANTITO ASSICURATIVO | € 17.006.797 | 4,47% | 1,768% | | |
| TOT. FOPDIRE | € 380.144.679 | 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 | 0,59% | 0,27% | 1,82% | 2,24% | 0,75% | 0,36% |
| COMPARTO DINAMICO | 1,70% | 1,23% | 3,23% | 2,90% | 1,03% | 0,86% |

(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