

A large, light gray, stylized compass rose or sunburst graphic is centered in the background. It features a central circle with radiating lines, surrounded by concentric circles and pointed, gear-like shapes.

fapdire

Fondo Pensione Dirigenti Gruppo Eni

Report gestionale al 30 GIUGNO 2017

Valore e rendimento quote



	Rendimento 2016 ⁽¹⁾	VALORE QUOTE 01/01/17	VALORE QUOTE 30/06/17	RENDIMENTO DA INIZIO 2017 ⁽¹⁾	ANDP ^(*) 30/06/17
GARANTITO ASSICURATIVO	2,62%	€ 11,153	€ 11,293	1,26%	€ 17.236.463,74
BILANCIATO	2,73%	€ 31,252	€ 31,275	0,07%	€ 302.118.806,37
DINAMICO	4,05%	€ 31,832	€ 32,165	1,05%	€ 57.896.505,02
				TOTALE	€ 377.251.775,13
RIVALUTAZIONE TFR	1,49%			1,06%	
INDICE DI INFLAZIONE	0,30%			0,70%	

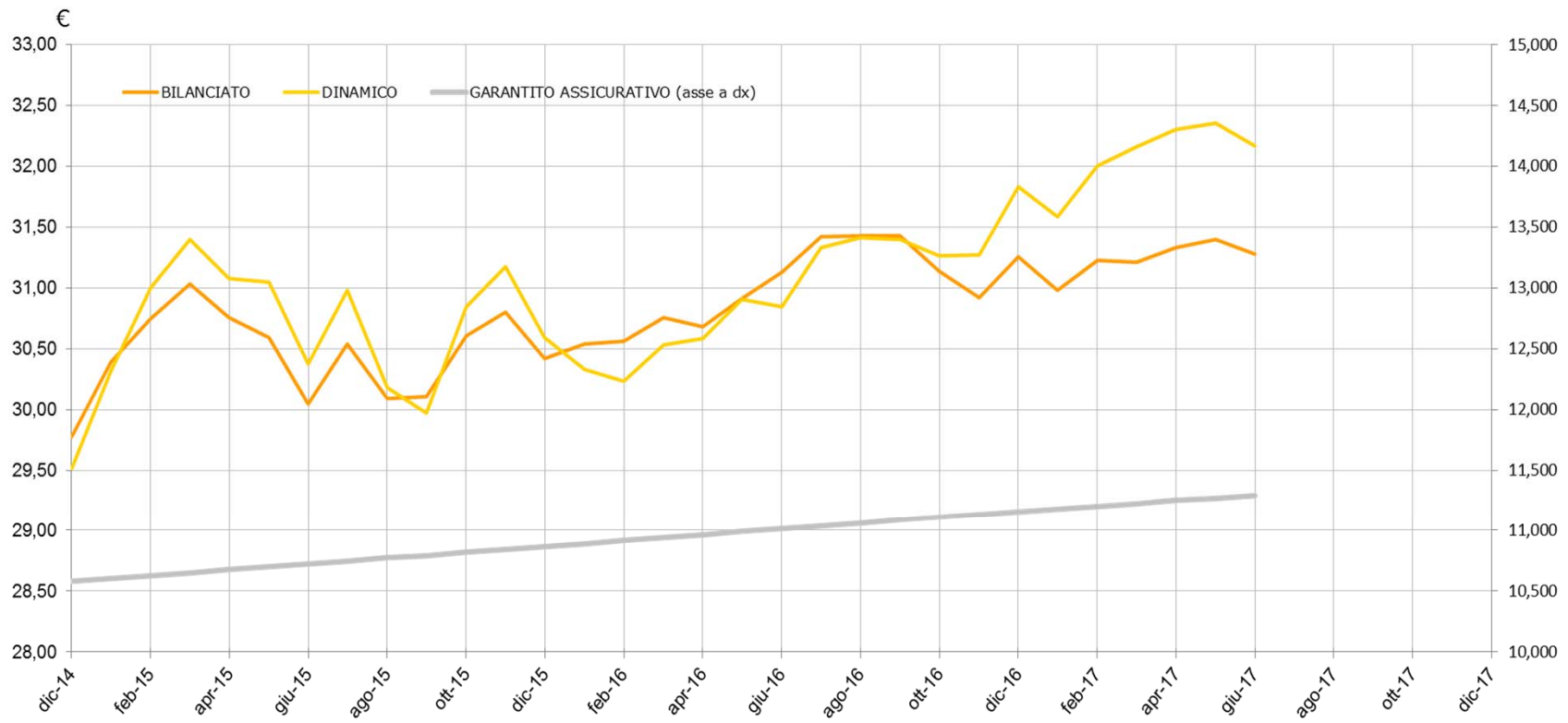
(Tabella 1)

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⁾ 30/06/17	% COMPARTO SU PORTAFOGLIO	PERFORMANCE PORTAFOGLIO da inizio anno	PERFORMANCE BENCHMARK da inizio anno	DELTA vs BMK
BILANCIATO	€ 302.866.281	80,16%	0,295%	0,040%	0,255%
DINAMICO	€ 57.780.941	15,29%	1,459%	1,140%	0,319%
TOT. COMPARTI FINANZIARI	€ 360.647.221	95,45%	0,482%	0,216%	0,265%
GARANTITO ASSICURATIVO	€ 17.174.036	4,55%	1,515%		
TOT. FOPDIRE	€ 377.821.258	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%	0,04%	1,77%	2,16%	0,52%	0,20%
COMPARTO DINAMICO	1,46%	1,14%	3,05%	2,75%	1,06%	0,96%

(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