

Situazione

NAV e VALORE QUOTE

AL 31/12/2015

Allegato A

al Bilancio 2015

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE				
RIEPILOGO AL 31/12/2015				
COMPARTI FINANZIARI GESTITI DA AMUNDI, ANIMA e DUEMME:				
	NAV	N° QUOTE	VALORE QUOTA AL 31/12/2015	VALORE QUOTA AL 31/12/2014
ORIZZONTE 10	108.670.853,66	6.279.180,114	17,307	16,859
ORIZZONTE 20	78.018.932,11	4.898.089,032	15,928	15,299
ORIZZONTE 30	119.982.902,74	8.480.298,728	14,148	13,493
TOTALE COMPARTI FINANZIARI	306.672.688,51	19.657.567,874		
COMPARTI ASSICURATIVI:				
OBIETTIVO CAPITALE GARANTITO (GESTITO DA CATTOLICA ASSICURAZIONI)	81.897.517,71			
Capitale garantito al 31.12.2015 (Al lordo dell'imposta sostitutiva)				
OBIETTIVO RENDITA (GESTITO DA UNIPOLSAI)	77.256.351,34			
Riserva matematica provvisoria al 31.12.2015 (Importo comunicato da Unipolsai)				
TOTALE GENERALE	465.826.557,56			

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE

Iscritto nell'apposito albo in data 28/11/2007 al n° 1645.

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE E DEL VALORE DEL PATRIMONIO

COMPARTO ORIZZONTE 10**VALORIZZAZIONE DEL 31/12/2015**

(valori espressi in €)

		31/12/2015
	Investimenti diretti	-
	Investimenti in gestione	109.081.300,38
	Attività della gestione amministrativa	-
	Proventi maturati e non riscossi	729.559,72
	Crediti d'imposta	-
(A)	TOTALE ATTIVITA'	109.810.860,10
	Passività della gestione previdenziale	637.324,65
	Passività della gestione finanziaria	15.774,67
	Passività della gestione amministrativa	-
	Oneri maturati e non liquidati	44.612,39
	Debiti d'imposta	442.294,73
(B)	TOTALE PASSIVITA'	1.140.006,44
(A - B)	ATTIVO NETTO DESTINATO ALLE PRESTAZIONI	108.670.853,66
	Numero delle quote in essere	6.279.180,114
	Valore unitario della quota	17,307

<i>den_portafoglio</i>	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZ 10 - MAIN	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - ANIMA / sottoptf	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - AMUNDI / sottoptf	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - DUEMME / sottoptf
<i>data_nav</i>	31/12/2015	31/12/2015	31/12/2015	31/12/2015
<i>data_calcolo</i>	08/01/2016	08/01/2016	08/01/2016	08/01/2016
totale_obbligazioni	98.376.911,14	30.255.709,87	29.040.498,76	39.080.702,51
rateo_titoli	729.559,72	188.441,64	215.397,02	325.721,06
totale_azioni	2.294.149,31	1.585.950,87	-	708.198,44
totale_fondi	2.562.565,93	-	2.562.565,93	-
dividendi_pending	1.468,54	1.468,54	-	-
comm_retrocessione	-	-	-	-
comm_giorno_retrocessione	-	-	-	-
totale_banche	3.873.446,31	420.108,51	787.813,84	2.665.523,96
interessi	-	-	-	-
totale_pct	-	-	-	-
totale_fwd_cambi_pos	2.529,39	-	2.529,39	-
totale_futures_pos	200.821,84	-	167.037,66	33.784,18
totale_opzioni_pos	-	-	-	-
totale_cc_margini	-	-	-	-
crediti_pending	8.630,04	-	-	8.630,04
totale_finanziamenti	-	-	-	-
totale_margini_finanziamenti	-	-	-	-
totale_immobili	-	-	-	-
totale_margini_immobili	-	-	-	-
totale_cash_deposit	-	-	-	-
totale_swap_pos	-	-	-	-
rateo_cash_deposit	-	-	-	-
attivo lordo gestito	108.050.082,22	32.451.679,43	32.775.842,60	42.822.560,19
debiti_pending	- 4.283,78	-	-	4.283,78
totale_fwd_cambi_neg	- 11.490,89	-	11.490,89	-
totale_futures_neg	- 2.659,25	-	-	2.659,25
totale_opzioni_neg	-	-	-	-
totale_swap_neg	-	-	-	-
ritenuta_cash_deposit	-	-	-	-
portafoglio netto gestito	108.031.648,30	32.451.679,43	32.764.351,71	42.815.617,16
risorse lorde gestione	108.031.648,30	32.451.679,43	32.764.351,71	42.815.617,16
comm_ges_finanziaria	- 15.538,15	- 5.463,46	- 3.591,94	- 6.482,75
comm_giorno_ges_finanziaria	- 7.689,70	- 2.703,85	- 1.774,72	- 3.211,13
comm_overperformance	- 8.042,28	-	- 8.042,28	-
comm_giorno_overperformance	-	-	-	-
comm_gar_capitale	-	-	-	-
comm_giorno_gar_capitale	-	-	-	-
risorse nette gestione	108.000.378,17	32.443.512,12	32.750.942,77	42.805.923,28
comm_compagnia	-	-	-	-
comm_giorno_compagnia	-	-	-	-
comm_rete	-	-	-	-
comm_giorno_rete	-	-	-	-
comm_revisione	-	-	-	-
comm_giorno_revisione	-	-	-	-
comm_banca_depositaria	- 4.678,12	-	-	-
comm_giorno_banca_depositaria	- 2.352,72	-	-	-
comm_clearing	- 6.311,42	- 5.452,58	- 360,11	- 498,73
comm_giorno_clearing	-	-	-	-
altre_commissioni	-	-	-	-
miscellanee	-	-	-	-
totale_margini_miscellanee	-	-	-	-
nav finanziario	107.987.035,91	32.438.059,54	32.750.582,66	42.805.424,55
totale_misc_ges_amm	-	-	-	-
crediti_previdenziali	227.629,89	75.876,63	75.876,63	75.876,63
debiti_previdenziali	- 158.837,32	- 52.945,77	- 52.945,77	- 52.945,78
patrimonio lordo ante i	108.055.828,48	32.460.990,40	32.773.513,52	42.828.355,40
crediti_imposta_oicr	-	-	-	-
totale_misc_fiscalita	-	-	-	-
imposta_sostitutiva	- 442.294,73	-	-	-
ritenute_anno_in_corso	-	-	-	-
patrimonio netto	107.613.533,75	32.460.990,40	32.773.513,52	42.828.355,40
contributi_giorno	1.535.807,24	511.935,75	511.935,75	511.935,74
rimborsi_giorno	- 478.487,33	- 159.495,78	- 159.495,78	- 159.495,77
attivo netto dest prest	108.670.853,66	32.813.430,37	33.125.953,49	43.180.795,37
totale quote	6.279.180,114			
imp prezzo nav	17,307			
contributi copertura spese	158.708,77			
contributi prestazioni acc	-			

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																					
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 10 AL 31.12.2015																					
GESTORE AMUNDI																					
den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_diviso	tasso_cambi	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pendng	saldo_margni	esposizione_globale_tramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambi_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_comp osite_blm	duration	den_categoria_strumento
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc AUD		10.514,020	AUD	1,000	10.514,02	1,49305	7,041,97	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,43385	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc CAD		11,093,960	CAD	1,000	11,093,96	1,50895	7,352,11	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,42917	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc CHF		2,184,430	CHF	1,000	2,184,43	1,08740	2,008,86	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,21819	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc EUR		710,113,000	EUR	1,000	710,113,00	1,00000	710,113,00	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc GBP		5,970,480	GBP	1,000	5,970,48	0,73705	8,100,51	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,71648	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc JPY		5,120,598,000	JPY	1,000	5,120,598,00	130,67645	39,185,32	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	129,45407	-	-	-
CARIPARMA ORIZ 10 AMUNDI cc USD		15,221,310	USD	1,000	15,221,31	1,08630	14,012,07	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,09285	-	-	-
Totale I.G - Depositi Bancari							787.813,84														
Forward su cambi: vendita USD, acquisto EUR	FWDCAMUSDEUR	8.961,500	EUR	1,000	8.961,50	1,00000	8.961,50	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-	-
Totale I.G - Forward su cambi							8.961,50														
EURO-BUND FUTURE Mar16	RXH6 Comdty	10,000	EUR	157,920	22,180,00	1,00000	22,180,00	-	-	-	-	11,180,00	1,579,200,00	Futures	160,138	160,138	1,00000	1,00000	-	-	Comdty
Totale I.G - Futures							22.180,00					11.180,00	1.579.200,00								
A-F ID EQ EUROPE-OEC	LU0557865424	800,000	EUR	1,459,230	1,167,384,00	1,00000	1,167,384,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1,459,230	1,215,543	1,00000	1,00000	NR	6,31	Equity
A-F ID EQ NTH AM-OEC	LU0557865770	171,000	EUR	1,979,830	338,550,93	1,00000	338,550,93	-	-	-	-	-	-	OICR	1,979,830	1,945,123	1,00000	1,00000	BB-	9,30	Equity
A-F EQ EURO SELT-OEC	LU0557870697	300,000	EUR	1,764,590	529,377,00	1,00000	529,377,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1,764,590	1,874,847	1,00000	1,00000	BB+	5,69	Equity
A-F EQ EURP SELT-OEC	LU0557870853	350,000	EUR	1,506,440	527,254,00	1,00000	527,254,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1,506,440	1,524,160	1,00000	1,00000	BBB+	9,86	Equity
Totale I.G - OICVM UE							2.562.565,93														
INTESA SANPAOLO SPA 05/12/2022 3,625	IT0004872328	100,000,000	EUR	118,021	118,021,00	1,00000	118,021,00	257,51	-	-	-	-	-	Obbligazioni	118,021	99,300	1,00000	1,00000	NR	6,31	Corp
ENI SPA 02/02/2026 1,5	XS1180451657	150,000,000	EUR	96,114	144,171,00	1,00000	144,171,00	2,046,58	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,114	101,150	1,00000	1,00000	AA-	9,30	Corp
AUTOSTRAD PER LITALIA 04/11/2021 1,125	XS1316567343	150,000,000	EUR	100,399	150,598,50	1,00000	150,598,50	262,81	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,399	99,540	1,00000	1,00000	BBB+	5,69	Corp
AUTOSTRAD PER LITALIA 28/06/2026 1,75	XS1327504087	100,000,000	EUR	99,757	99,757,00	1,00000	99,757,00	148,22	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,757	99,146	1,00000	1,00000	BBB+	9,86	Corp
Totale I.G - Tdebito Q IT							512.547,50	2.715,12													
PETROL ELOS MEXICANOS 27/11/2020 3,125	XS0902174044	100,000,000	EUR	109,312	109,312,00	1,00000	109,312,00	1,409,94	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,312	104,110	1,00000	1,00000	AA-	5,14	Corp
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 21/07/2022, 75	XS1171489393	200,000,000	EUR	98,270	196,540,00	1,00000	196,540,00	688,03	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,270	99,876	1,00000	1,00000	BBB+	6,40	Corp
STATOIL ASA 17/02/2023, 875	XS1190624111	200,000,000	EUR	98,825	193,650,00	1,00000	193,650,00	1,519,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,825	99,846	1,00000	1,00000	AA-	6,89	Corp
AT&T INC 15/03/2035 2,45	XS1196380031	150,000,000	EUR	88,545	132,817,50	1,00000	132,817,50	2,982,17	-	-	-	-	-	Obbligazioni	88,545	98,328	1,00000	1,00000	BBB+	14,55	Corp
APPLE INC 17/01/2024 1,375	XS1282384960	150,000,000	EUR	100,923	151,384,50	1,00000	151,384,50	593,32	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,923	99,604	1,00000	1,00000	AA+	7,65	Corp
PROCTER & GAMBLE COITHE 02/11/2023 1,125	XS1314319301	100,000,000	EUR	99,941	99,941,00	1,00000	99,941,00	181,35	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,941	99,970	1,00000	1,00000	AA+	7,54	Corp
UNITED PARCEL SERVICE 15/11/2025 1,625	XS1323463726	100,000,000	EUR	100,585	100,585,00	1,00000	100,585,00	182,53	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,585	99,708	1,00000	1,00000	AA+	9,20	Corp
Totale I.G - Tdebito Q OCSE							1.129.058,00	7.972,55													
GECINA 20/01/2025 1,5	FR0012448025	100,000,000	EUR	94,841	94,841,00	1,00000	94,841,00	1,417,81	-	-	-	-	-	Obbligazioni	94,841	99,256	1,00000	1,00000	BBB+	8,40	Corp
ENGIE 13/03/2022 5	FR0012602753	300,000,000	EUR	97,306	291,918,00	1,00000	291,918,00	1,200,82	-	-	-	-	-	Obbligazioni	97,306	95,782	1,00000	1,00000	AA	6,10	Corp
DANONE SA 30/05/2024 1,25	FR0013063609	100,000,000	EUR	98,592	98,592,00	1,00000	98,592,00	106,16	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,592	99,228	1,00000	1,00000	BBB+	8,03	Corp
MERCK FIN SERVICES GMBH 24/03/2020 4,5	XS0497186758	50,000,000	EUR	116,333	58,166,50	1,00000	58,166,50	1,733,61	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,333	105,770	1,00000	1,00000	AA-	3,86	Corp
ROLLS-ROYCE PLC 18/06/2021 2,125	XS0944838241	100,000,000	EUR	105,330	105,330,00	1,00000	105,330,00	1,137,98	-	-	-	-	-	Obbligazioni	105,330	99,557	1,00000	1,00000	AA-	5,17	Corp
CREDIT AGRICOLE LONDON 19/01/2022, 875	XS1169630602	300,000,000	EUR	98,421	295,263,00	1,00000	295,263,00	2,488,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,421	97,068	1,00000	1,00000	AA-	5,88	Corp
HEINKEN NV 10/09/2021 1,25	XS1288852939	100,000,000	EUR	100,913	100,913,00	1,00000	100,913,00	382,51	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,913	99,839	1,00000	1,00000	BBB+	5,52	Corp
BAT INTL FINANCE PLC 23/05/2022 1	XS1324928750	100,000,000	EUR	98,019	98,019,00	1,00000	98,019,00	104,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,019	99,297	1,00000	1,00000	AA-	6,22	Corp
Totale I.G - Tdebito Q UE							1.143.042,50	8.571,36													
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2025 5	IT0004513641	500,000,000	EUR	129,912	649,561,50	1,00000	649,561,50	8,310,44	-	-	-	-	-	Obbligazioni	129,912	109,118	1,00000	1,00000	NR	7,62	Govt
CCTS EU 15/04/2018 FLOATING	IT0004716319	2,000,000,000	EUR	102,056	2,041,110,00	1,00000	2,041,110,00	4,389,00	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,056	98,775	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
CCTS EU 01/11/2018 FLOATING	IT0004922909	1,000,000,000	EUR	104,702	1,047,015,00	1,00000	1,047,015,00	3,006,67	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,702	102,755	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2044 4,75	IT0004923998	250,000,000	EUR	141,069	352,673,25	1,00000	352,673,25	3,947,46	-	-	-	-	-	Obbligazioni	141,069	113,107	1,00000	1,00000	NR	17,83	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2024 4,5	IT0004953417	700,000,000	EUR	124,160	869,122,10	1,00000	869,122,10	10,471,15	-	-	-	-	-	Obbligazioni	124,160	105,625	1,00000	1,00000	NR	7,00	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2024 3,75	IT0005001547	600,000,000	EUR	118,750	712,501,20	1,00000	712,501,20	7,479,40	-	-	-	-	-	Obbligazioni	118,750	103,778	1,00000	1,00000	NR	7,53	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2019 1,5	IT0005030504	600,000,000	EUR	104,183	625,095,00	1,00000	625,095,00	3,717,39	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,183	100,626	1,00000	1,00000	NR	3,49	Govt
CCTS EU 15/12/2020 FLOATING	IT0005056541	1,200,000,000	EUR	102,339	1,228,066,80	1,00000	1,228,066,80	4,06,40	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,339	101,253	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2046 3,25	IT0005083057	200,000,000	EUR	111,745	223,489,80	1,00000	223,489,80	2,160,71	-	-	-	-	-	Obbligazioni	111,745	102,503	1,00000	1,00000	NR	20,11	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/05/2018, 25	IT0005166049	500,000,000	EUR	100,378	501,888,50	1,00000	501,888,50	157,97	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,378	99,891	1,00000	1,00000	NR	2,37	Govt
Totale I.G - Tstato Org.Int Q IT							8.250.523,15	44.046,59													
CANADIAN GOVERNMENT 01/09/2020, 75	CA135087E596	500,000,000	CAD	100,104	500,520,00																

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																						
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 10 AL 31.12.2015																						
GESTORE ANIMA																						
den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_to	cod_div	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pend	dividendi_p	debiti_pendin	saldo_ma	esposizione_glo	den_sezio	prezzo_caric	prezzo_stori	tasso_camb	tasso_cambio	cod_rau	den_cate		
		ale	isa						ing	ending	g	rgini	bale_tramite_futu	ne	co	co	io_carico	storico	ng_com	posita_b	duration	
													res_lc						lm		mento	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc AUD		71.948,62	AUD	1,000	71.948,62	1,49305	48.189,02	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,53833			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc CAD		5.100,920	CAD	1,000	5.100,92	1,50895	3.380,44	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,43660			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc CHF		15.987,860	CHF	1,000	15.987,86	1,08740	14.702,83	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,07899			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc DKK		11.594,440	DKK	1,000	11.594,44	7,46265	1.553,66	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	7,46265	7,46042			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc EUR		273.164,550	EUR	1,000	273.164,55	1,00000	273.164,55	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc GBP		18.273,890	GBP	1,000	18.273,89	0,73705	24.793,28	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,72428			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc JPY		120.758,000	JPY	1,000	120.758,00	130,67645	924,10	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	139,25494			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc NOK		5.728,070	NOK	1,000	5.728,07	9,61525	595,73	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,61525	8,93142			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc SEK		4.101,930	SEK	1,000	4.101,93	9,15815	447,90	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,15815	9,28032			-	
CARIPARMA ORIZ 10 ANIMA cc USD		56.875,410	USD	1,000	56.875,41	1,08630	52.357,00	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,08987			-	
Totale I.G - Depositi Bancari							420.108,51															
ASSICURAZIONI GENERALI	IT0000062072	278,000	EUR	16,920	4.703,76	1,00000	4.703,76	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,920	17,593	1,00000	1,00000			-	Equity
INTESA SANPAOLO	IT0000072618	6.563,000	EUR	3,088	20.266,54	1,00000	20.266,54	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,088	2,547	1,00000	1,00000			-	Equity
ENI SPA	IT0003132476	806,000	EUR	13,800	11.122,80	1,00000	11.122,80	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,800	15,132	1,00000	1,00000			-	Equity
SNAM SPA	IT0003153415	2.760,000	EUR	4,830	13.330,80	1,00000	13.330,80	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,830	4,489	1,00000	1,00000			-	Equity
TELECOM ITALIA SPA	IT0003497168	9.885,000	EUR	1,175	11.614,88	1,00000	11.614,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,175	1,174	1,00000	1,00000			-	Equity
ATLANTIA SPA	IT0003506190	202,000	EUR	24,500	4.949,00	1,00000	4.949,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	24,500	23,546	1,00000	1,00000			-	Equity
FINMECCANICA SPA	IT0003856405	1.075,000	EUR	12,900	13.867,50	1,00000	13.867,50	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,900	10,075	1,00000	1,00000			-	Equity
PRYSMIAN SPA	IT0004176001	359,000	EUR	20,260	7.273,34	1,00000	7.273,34	-	-	-	-	-	-	Azioni	20,260	19,903	1,00000	1,00000			-	Equity
ENEL GREEN POWER SPA	IT0004618465	6.622,000	EUR	1,883	12.469,23	1,00000	12.469,23	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,883	1,735	1,00000	1,00000			-	Equity
Totale I.G - TCapitale Q IT							99.597,85															
ACTELION LTD-REG	CH0010532478	40,000	CHF	139,600	5.584,00	1,08740	5.135,18	-	-	-	-	-	-	Azioni	139,600	117,546	1,08740	1,20269			-	Equity
NOVARTIS AG-REG	CH0012005267	498,000	CHF	86,800	43.226,40	1,08740	39.752,07	-	-	-	-	-	-	Azioni	86,800	86,292	1,08740	1,11294			-	Equity
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CH0012032048	306,000	CHF	276,400	84.578,40	1,08740	77.780,39	-	-	-	-	-	-	Azioni	276,400	261,547	1,08740	1,09697			-	Equity
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	CH0014852781	32,000	CHF	271,300	8.681,60	1,08740	7.983,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	271,300	207,072	1,08740	1,10327			-	Equity
NESTLE SA-REG	CH0038863350	682,000	CHF	74,550	50.843,10	1,08740	46.756,58	-	-	-	-	-	-	Azioni	74,550	71,759	1,08740	1,12524			-	Equity
ARYZTA AG	CH0043238366	188,000	CHF	51,000	9.588,00	1,08740	8.817,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	51,000	64,231	1,08740	1,16908			-	Equity
UBS GROUP AG-REG	CH0244767585	999,000	CHF	19,520	19.500,48	1,08740	17.933,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	19,520	17,558	1,08740	1,13751			-	Equity
NORSK HYDRO ASA	NO0000502605	2.215,000	NOK	33,130	73.382,95	9,61525	7.631,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	33,130	32,982	9,61525	9,17615			-	Equity
Totale I.G - TCapitale Q OCSE							211.790,44															
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	BE0003793107	224,000	EUR	114,400	25.625,60	1,00000	25.625,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	114,400	117,761	1,00000	1,00000			-	Equity
BEIERSDORF AG	DE0005200000	124,000	EUR	84,160	10.435,84	1,00000	10.435,84	-	-	-	-	-	-	Azioni	84,160	76,982	1,00000	1,00000			-	Equity
CONTINENTAL AG	DE0005439004	56,000	EUR	224,550	12.574,80	1,00000	12.574,80	-	-	-	-	-	-	Azioni	224,550	210,931	1,00000	1,00000			-	Equity
DEUTSCHE POST AG-REG	DE0005552004	182,000	EUR	25,955	4.723,81	1,00000	4.723,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	25,955	26,707	1,00000	1,00000			-	Equity
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DE0005575008	794,000	EUR	16,690	13.251,86	1,00000	13.251,86	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,690	15,877	1,00000	1,00000			-	Equity
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	73,000	EUR	81,390	5.941,47	1,00000	5.941,47	-	-	-	-	-	-	Azioni	81,390	77,884	1,00000	1,00000			-	Equity
HEIDELBERGCEMENT AG	DE0006047004	112,000	EUR	75,620	8.469,44	1,00000	8.469,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	75,620	73,018	1,00000	1,00000			-	Equity
INFINEON TECHNOLOGIES AG	DE0006231004	1.405,000	EUR	13,505	18.974,53	1,00000	18.974,53	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,505	10,606	1,00000	1,00000			-	Equity
MERCK KGAA	DE0006599905	180,000	EUR	89,570	16.122,60	1,00000	16.122,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,570	84,135	1,00000	1,00000			-	Equity
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	DE0007100000	307,000	EUR	77,580	23.817,06	1,00000	23.817,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,580	72,827	1,00000	1,00000			-	Equity
SAP SE	DE0007164600	440,000	EUR	73,380	32.287,20	1,00000	32.287,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	73,380	64,639	1,00000	1,00000			-	Equity
SIEMENS AG-REG	DE0007236101	225,000	EUR	89,880	20.223,00	1,00000	20.223,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,880	92,366	1,00000	1,00000			-	Equity
ALLIANZ SE-REG	DE0008404005	157,000	EUR	163,550	25.677,35	1,00000	25.677,35	-	-	-	-	-	-	Azioni	163,550	161,317	1,00000	1,00000			-	Equity
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	DE0008430026	106,000	EUR	184,560	19.562,30	1,00000	19.562,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	184,560	172,894	1,00000	1,00000			-	Equity
ADIDAS AG	DE000A1EWWW0	169,000	EUR	89,910	15.194,79	1,00000	15.194,79	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,910	83,716	1,00000	1,00000			-	Equity
BAYER AG-REG	DE000BAY0017	242,000	EUR	115,800	28.023,60	1,00000	28.023,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	115,800	121,756	1,00000	1,00000			-	Equity
CARLSBERG AS-B	DK0010181759	60,000	DKK	612,500	36.750,00	7,46265	4.924,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	612,500	614,221	7,46265	7,45980			-	Equity
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	DK0010268606	83,000	DKK	483,800	40.155,40	7,46265	5.380,85	-	-	-	-	-	-	Azioni	483,800	370,153	7,46265	7,46192			-	Equity
DANSKE BANK A/S	DK0010274414	333,000	DKK	185,200	61.671,60	7,46265	8.264,03	-	-	-	-	-	-	Azioni	185,200	159,361	7,46265	7,45784			-	Equity
NOVO NORDISK A/S-B	DK00060534915	483,000	DKK	399,900	193.151,70	7,46265	25.882,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	399,900	266,607	7,46265	7,45597			-	Equity
BANCO SANTANDER SA	ES0113900J37	3.222,000	EUR	4,558	14.685,88	1,00000	14.685,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,558	5,036	1,00000	1,00000			-	Equity
FERROVIAL SA	ES0118900010	10,000	EUR	20,855	208,55	1,00000	208,55	-	-	-	-	-	-	Azioni	20,855	16,684	1,00000	1,00000			-	Equity
ACCIONA SA	ES0125220311	139,000	EUR	79,080	10.992,12	1,00000	10.992,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	79,080	67,352	1,00000	1,00000			-	Equity
IBERDROLA SA																						

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_to tale	cod_div isa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pend ing	dividendi_p ending	debiti_pendin g	saldo_ma rgini	esposizione_glo bale_tramite_futu res_lc	den_sezio ne	prezzo_caric o	prezzo_stori co	tasso_camb io_carico	tasso_cambio_ storico	cod_rati ng_com positiv_b lm	duration	den_cate goria_stru mento
HSBC HOLDINGS PLC	GB0005405286	6.800,000	GBP	5,362	36.461,60	0,73705	49.469,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,362	5,794	0,73705	0,71820	-	-	Equity
PRUDENTIAL PLC	GB0007099541	954,000	GBP	15,310	14.605,74	0,73705	19.816,48	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,310	14,735	0,73705	0,74031	-	-	Equity
RIO TINTO PLC	GB0007188757	352,000	GBP	19,795	6.967,84	0,73705	9.453,69	-	-	-	-	-	-	Azioni	19,795	22,998	0,73705	0,72285	-	-	Equity
BP PLC	GB0007980591	3.408,000	GBP	3,540	12.064,32	0,73705	16.368,39	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,540	3,757	0,73705	0,73523	-	-	Equity
BG GROUP PLC	GB0008762899	912,000	GBP	9,850	8.983,20	0,73705	12.188,05	-	-	-	-	-	-	Azioni	9,850	10,103	0,73705	0,73225	-	-	Equity
GLAXOSMITHKLINE PLC	GB0009252882	1.393,000	GBP	13,730	19.125,89	0,73705	25.949,24	-	-	309,86	-	-	-	Azioni	13,730	13,590	0,73705	0,72899	-	-	Equity
BABCOCK INTL GROUP PLC	GB0009697037	-	GBP	10,160	-	0,73705	-	-	-	54,50	-	-	-	Azioni	-	-	-	-	-	-	Equity
ASTRAZENECA PLC	GB0009895292	459,000	GBP	46,165	21.189,74	0,73705	28.749,39	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,165	43,360	0,73705	0,71889	-	-	Equity
BT GROUP PLC	GB0030913577	2.325,000	GBP	4,717	10.967,03	0,73705	14.879,63	-	-	138,80	-	-	-	Azioni	4,717	4,915	0,73705	0,70027	-	-	Equity
ASOS PLC	GB0030927254	88,000	GBP	34,510	3.036,88	0,73705	4.120,32	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,510	33,091	0,73705	0,70770	-	-	Equity
BARCLAYS PLC	GB0031348658	2.004,000	GBP	2,189	4.386,76	0,73705	5.951,78	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,189	2,329	0,73705	0,71240	-	-	Equity
ITV PLC	GB0033986497	1.284,000	GBP	2,766	3.551,54	0,73705	4.818,59	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,766	2,694	0,73705	0,69995	-	-	Equity
RANDGOLD RESOURCES LTD	GB00B01C3S32	206,000	GBP	41,430	8.534,58	0,73705	11.579,38	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,430	40,988	0,73705	0,73652	-	-	Equity
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	1.024,000	EUR	21,095	21.601,28	1,00000	21.601,28	-	-	-	-	-	-	Azioni	21,095	23,070	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00B03MM408	694,000	GBP	15,430	10.708,42	0,73705	14.528,76	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,430	18,893	0,73705	0,73909	-	-	Equity
BRITVIC PLC	GB00B0N8QD54	1.164,000	GBP	7,275	8.468,10	0,73705	11.489,18	-	-	257,42	-	-	-	Azioni	7,275	7,300	0,73705	0,78532	-	-	Equity
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00B24CGK77	186,000	GBP	62,810	11.682,66	0,73705	15.850,57	-	-	-	-	-	-	Azioni	62,810	50,868	0,73705	0,78267	-	-	Equity
DIXONS CARPHONE PLC	GB00B4Y7R145	1.758,000	GBP	5,000	8.790,00	0,73705	11.925,92	-	-	77,51	-	-	-	Azioni	5,000	4,476	0,73705	0,72071	-	-	Equity
VODAFONE GROUP PLC	GB00BH4HKS39	9.454,000	GBP	2,210	20.893,34	0,73705	28.347,25	-	-	472,03	-	-	-	Azioni	2,210	2,248	0,73705	0,72417	-	-	Equity
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	GB00BN33FD40	184,000	GBP	26,580	4.890,72	0,73705	6.635,53	-	-	-	-	-	-	Azioni	26,580	25,103	0,73705	0,72567	-	-	Equity
INDIVIOR PLC	GB00BRSE6X63	240,000	GBP	1,878	450,72	0,73705	611,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,878	1,133	0,73705	0,78450	-	-	Equity
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	GB00BY9DDY18	1.449,000	GBP	4,075	5.904,68	0,73705	8.011,23	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,075	3,178	0,73705	0,70845	-	-	Equity
CRH PLC	IE0001827041	248,000	EUR	26,700	6.621,60	1,00000	6.621,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	26,700	26,279	1,00000	1,00000	-	-	Equity
WPP PLC	JE00BBKF9B49	789,000	GBP	15,630	12.332,07	0,73705	16.731,66	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,630	13,928	0,73705	0,76637	-	-	Equity
KONINKLIJKE KPN NV	NL0000009082	2.383,000	EUR	3,492	8.321,44	1,00000	8.321,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,492	3,381	1,00000	1,00000	-	-	Equity
HEINEKEN NV	NL0000009165	148,000	EUR	78,770	11.657,96	1,00000	11.657,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	78,770	76,648	1,00000	1,00000	-	-	Equity
UNILEVER NV-CVA	NL0000009355	672,000	EUR	40,105	26.950,56	1,00000	26.950,56	-	-	-	-	-	-	Azioni	40,105	36,265	1,00000	1,00000	-	-	Equity
KONINKLIJKE PHILIPS NV	NL0000009538	476,000	EUR	23,560	11.214,56	1,00000	11.214,56	-	-	-	-	-	-	Azioni	23,560	25,540	1,00000	1,00000	-	-	Equity
KONINKLIJKE DSM NV	NL0000009827	235,000	EUR	46,280	10.875,80	1,00000	10.875,80	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,280	52,169	1,00000	1,00000	-	-	Equity
AIRBUS GROUP SE	NL0000235190	202,000	EUR	62,000	12.524,00	1,00000	12.524,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	62,000	58,575	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ING GROEP NV-CVA	NL0000303600	1.000,000	EUR	12,450	12.450,00	1,00000	12.450,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,450	11,984	1,00000	1,00000	-	-	Equity
RELX NV	NL0006144495	796,000	EUR	15,540	12.369,84	1,00000	12.369,84	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,540	14,014	1,00000	1,00000	-	-	Equity
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV/	NL0010877643	646,000	EUR	12,920	8.346,32	1,00000	8.346,32	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,920	13,043	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	SE0000148884	1.359,000	SEK	89,400	121.494,60	9,15815	13.266,28	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,400	92,109	9,15815	9,22452	-	-	Equity
SANDVIK AB	SE0000687891	548,000	SEK	74,050	40.579,40	9,15815	4.430,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	74,050	83,245	9,15815	9,37135	-	-	Equity
ASSA ABLOY AB-B	SE0007100581	174,000	SEK	178,000	30.972,00	9,15815	3.381,91	-	-	-	-	-	-	Azioni	178,000	175,741	9,15815	9,37540	-	-	Equity
Totale IG - TCapitale Q UE							1.274.562,58			1.468,54											
UNICREDIT SPA 19/06/2019 1,5	XS1078760813	400.000,000	EUR	102,096	408.384,00	1,00000	408.384,00	3,196,72	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,096	100,911	1,00000	1,00000	BBB	3,38	Corp
INTESA SANPAOLO SPA 14/01/2020 1,125	XS1168003900	400.000,000	EUR	100,464	401.856,00	1,00000	401.856,00	4.327,40	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,464	98,726	1,00000	1,00000	BBB	3,93	Corp
Totale IG - TDebito Q UE							810.240,00	7.524,12													
GE CAPITAL EURO FUNDING 03/05/2016 FLOATING	XS0925518903	270.000,000	EUR	100,124	270.334,80	1,00000	270.334,80	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,124	100,072	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
ABN AMRO BANK NV 01/08/2016 FLOATING	XS0962536366	300.000,000	EUR	100,248	300.744,00	1,00000	300.744,00	251,73	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,248	100,273	1,00000	1,00000	NR	0,50	Corp
Totale IG - TDebito Q UE							571.078,80	417,90													
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2039 5	IT0004286966	270.000,000	EUR	142,791	385.536,24	1,00000	385.536,24	5.576,09	-	-	-	-	-	Obbligazioni	142,791	119,068	1,00000	1,00000	NR	15,53	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2020 4,25	IT0004536849	494.000,000	EUR	115,726	571.684,96	1,00000	571.684,96	6.979,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	115,726	114,773	1,00000	1,00000	NR	3,85	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2021 2,1	IT0004604671	660.000,000	EUR	120,784	797.175,91	1,00000	797.175,91	4.419,56	-	-	-	-	-	Obbligazioni	120,784	119,830	1,00000	1,00000	NR	5,42	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2026 3,1	IT0004735152	650.000,000	EUR	132,567	861.688,64	1,00000	861.688,64	6.289,39	-	-	-	-	-	Obbligazioni	132,567	129,361	1,00000	1,00000	NR	9,38	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 22/10/2016 2,55	IT0004863608	1.000.000,000	EUR	101,915	1.019.149,94	1,00000	1.019.149,94	4.870,61	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,915	102,113	1,00000	1,00000	NR	0,80	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/06/2018 3,5	IT0004907843	1.350.000,000	EUR	108,205	1.460.763,45	1,00000	1.460.763,45	3.872,95	-	-	-	-	-	Obbligazioni	108,205	108,989	1,00000	1,00000	NR	2,34	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/12/2021 2,15	IT0005028003	230.000,000	EUR	107,266	246.711,80	1,00000	246.711,80	216,17	-	-	-	-	-	Obbligazioni	107,266	104,477	1,00000	1,00000	NR	5,64	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2019 1,5	IT0005030504	980.000,000	EUR	104,183	1.020.988,50	1,00000	1.020.988,50	6.071,74	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,183	103,568	1,00000	1,00000	NR	3,49	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/01/2018 7,5	IT0005058463	970.000,000	EUR	101,473	984.291,01	1,00000	984.291,01	3.340,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,473	101,017	1,00000	1,00000	NR	2,03	Govt
BUONI ORDINARI DEL TES 14/01/2016 ZERO COUPON	IT0005075681	300.000,000	EUR	100,012	300.036,90	1,00000	300.036,90	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,012						

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																					
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 10 AL 31.12.2015																					
GESTORE DUEMME																					
den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_div	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendin_g	dividendi_p_ending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_glo_bale_tramite_futures	den_sezio	prezzo_carico	prezzo_stori	tasso_cambio_c	tasso_cambio_st	cod_ratin_g_compo	den_cate	
den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	isa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendin_g	dividendi_p_ending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_glo_bale_tramite_futures	den_sezio	prezzo_carico	prezzo_stori	tasso_cambio_c	tasso_cambio_st	site_blm	duration	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc AUD		13.669.530	AUD	1,000	13.669,53	1,49305	9.155,44	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,48844	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc CAD		56.789,490	CAD	1,000	56.789,49	1,50895	37.635,10	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,35761	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc CHF		66.033,850	CHF	1,000	66.033,85	1,08740	60.726,37	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,07940	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc DKK		452,550	DKK	1,000	452,55	7,46265	60,64	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	7,46265	7,43225	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc EUR		1.450.437,860	EUR	1,000	1.450.437,86	1,00000	1.450.437,86	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc GBP		347.964,620	GBP	1,000	347.964,62	0,73705	472.104,50	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,72324	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc JPY		67.910.955,000	JPY	1,000	67.910.955,00	130,67645	519.687,79	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	139,47989	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc SEK		233.033,390	SEK	1,000	233.033,39	9,15815	25.445,47	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,15815	9,33399	-	-	
CARIPARMA ORIZ 10 DUEMME cc USD		98.061,160	USD	1,000	98.061,16	1,08630	90.270,79	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,10013	-	-	
Totale I.G. - Depositi Bancari							2.665.623,96														
OMXS30 IND FUTURE Jan16	QCF6 Index	3,000	SEK	1.448,000	10.850,00	9,15815	1.162,90	-	597,83	-	450,42	1.162,90	47.433,16	Futures	1.412,500	1.412,500	9,28175	9,28175	-	Index	
SWISS MKT IX FUTR Mar16	SNH6 Index	3,000	CHF	8.746,000	10.290,00	1,08740	9.462,94	-	4.138,31	-	1.269,08	9.462,94	241.291,15	Futures	8.403,000	8.403,000	1,08165	1,08165	-	Index	
EURO STOXX 50 Mar16	VGH6 Index	14,000	EUR	3.282,000	7.088,72	1,00000	7.088,72	-	-	-	-	7.088,72	459.480,00	Futures	3.231,366	3.231,366	1,00000	1,00000	-	Index	
FTSE 100 IDX FUT Mar16	ZH6 Index	7,000	GBP	6.198,000	18.760,00	0,73705	25.452,82	-	3.893,90	-	2.564,28	28.112,07	588.643,92	Futures	5.930,000	5.930,000	0,72580	0,72580	-	Index	
Totale I.G. - Futures							43.167,38		8.630,04		4.283,78	45.826,63	1.336.848,23								
ASSICURAZIONI GENERALI	IT0000062072	904,000	EUR	16,920	15.295,68	1,00000	15.295,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,920	16,597	1,00000	1,00000	-	Equity	
UNIPOLSAI SPA	IT0004827447	6.658,000	EUR	2,360	15.712,88	1,00000	15.712,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,360	2,365	1,00000	1,00000	-	Equity	
Totale I.G. - T.Capitale Q.IT							31.008,56														
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	AT0000606306	648,000	EUR	13,605	8.816,04	1,00000	8.816,04	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,605	17,243	1,00000	1,00000	-	Equity	
SOLVAY SA	BE0003470755	178,000	EUR	98,430	17.520,54	1,00000	17.520,54	-	-	-	-	-	-	Azioni	98,430	101,487	1,00000	1,00000	-	Equity	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	DE0005140008	575,000	EUR	22,525	12.951,88	1,00000	12.951,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	22,525	35,692	1,00000	1,00000	-	Equity	
LANXESS AG	DE0005470405	502,000	EUR	42,680	21.425,36	1,00000	21.425,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,680	49,187	1,00000	1,00000	-	Equity	
METRO AG	DE0007257503	637,000	EUR	29,560	18.829,72	1,00000	18.829,72	-	-	-	-	-	-	Azioni	29,560	33,202	1,00000	1,00000	-	Equity	
ALLIANZ SE-REG	DE0008404005	154,000	EUR	163,550	25.186,70	1,00000	25.186,70	-	-	-	-	-	-	Azioni	163,550	133,685	1,00000	1,00000	-	Equity	
BAF SE	DE0008AS1111	153,000	EUR	70,720	10.820,16	1,00000	10.820,16	-	-	-	-	-	-	Azioni	70,720	79,583	1,00000	1,00000	-	Equity	
APPLUS SERVICES SA	ES0105022000	2.567,000	EUR	8,350	21.434,45	1,00000	21.434,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	8,350	10,438	1,00000	1,00000	-	Equity	
BANCO SANTANDER SA	ES0113900317	1.578,000	EUR	4,558	7.192,52	1,00000	7.192,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,558	6,032	1,00000	1,00000	-	Equity	
OBRASCON HUARTE LAIN S.A.	ES0142090317	1.710,000	EUR	5,270	9.011,70	1,00000	9.011,70	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,270	9,328	1,00000	1,00000	-	Equity	
REPSOL SA	ES0173516115	922,000	EUR	10,120	9.330,64	1,00000	9.330,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	10,120	18,571	1,00000	1,00000	-	Equity	
REPSOL SA-RTS 21/12/2015	ES0673516979	922,000	EUR	0,459	423,20	1,00000	423,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	0,459	0,375	1,00000	1,00000	-	Equity	
NOKIAN RENKAAT OYJ	FI0009005318	988,000	EUR	33,100	32.702,80	1,00000	32.702,80	-	-	-	-	-	-	Azioni	33,100	24,133	1,00000	1,00000	-	Equity	
FORTUM OYJ	FI0009007132	1.117,000	EUR	13,920	15.548,64	1,00000	15.548,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,920	18,553	1,00000	1,00000	-	Equity	
NEXANS SA	FR0000044448	599,000	EUR	33,700	20.186,30	1,00000	20.186,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	33,700	35,986	1,00000	1,00000	-	Equity	
SNAMFI	FR0000120578	209,000	EUR	78,600	16.427,40	1,00000	16.427,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	78,600	87,673	1,00000	1,00000	-	Equity	
AXA SA	FR0000120628	1.044,000	EUR	25,230	26.340,12	1,00000	26.340,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	25,230	19,877	1,00000	1,00000	-	Equity	
NATIXIS	FR0000120685	2.014,000	EUR	5,217	10.507,04	1,00000	10.507,04	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,217	5,529	1,00000	1,00000	-	Equity	
PEUGEOT SA	FR0000121501	1.579,000	EUR	16,205	25.587,69	1,00000	25.587,69	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,205	9,892	1,00000	1,00000	-	Equity	
VINCI SA	FR0000125486	244,000	EUR	59,140	14.430,16	1,00000	14.430,16	-	-	-	-	-	-	Azioni	59,140	48,153	1,00000	1,00000	-	Equity	
REMY COINTREAU	FR0000130395	308,000	EUR	66,010	20.199,06	1,00000	20.199,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	66,010	55,710	1,00000	1,00000	-	Equity	
ELI LILLY	FR0000130452	219,000	EUR	59,530	13.037,07	1,00000	13.037,07	-	-	-	-	-	-	Azioni	59,530	41,153	1,00000	1,00000	-	Equity	
SOEITE GENERALE SA	FR0000130809	413,000	EUR	42,570	17.581,41	1,00000	17.581,41	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,570	44,060	1,00000	1,00000	-	Equity	
BNP PARIBAS	FR0000131104	316,000	EUR	52,230	16.504,68	1,00000	16.504,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	52,230	56,389	1,00000	1,00000	-	Equity	
TENARIS SA	FR0000131708	473,000	EUR	45,735	21.632,66	1,00000	21.632,66	-	-	-	-	-	-	Azioni	45,735	51,526	1,00000	1,00000	-	Equity	
ARKEMA	FR0010313833	279,000	EUR	64,590	18.020,61	1,00000	18.020,61	-	-	-	-	-	-	Azioni	64,590	49,373	1,00000	1,00000	-	Equity	
EDENRED	FR0010908533	653,000	EUR	17,450	11.394,85	1,00000	11.394,85	-	-	-	-	-	-	Azioni	17,450	15,178	1,00000	1,00000	-	Equity	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00B03MLX29	200,000	EUR	21,095	4.219,00	1,00000	4.219,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	21,095	28,535	1,00000	1,00000	-	Equity	
C&C GROUP PLC	IE00B010D183	3.422,000	EUR	3,713	12.705,89	1,00000	12.705,89	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,713	4,254	1,00000	1,00000	-	Equity	
TENARIS SA	LU0156801721	1.910,000	EUR	10,940	20.895,40	1,00000	20.895,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	10,940	12,515	1,00000	1,00000	-	Equity	
ARCELORMITTAL	LU0323134006	2.113,000	EUR	3,897	8.234,36	1,00000	8.234,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,897	11,777	1,00000	1,00000	-	Equity	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	NL0000009538	956,000	EUR	23,560	22.523,36	1,00000	22.523,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	23,560	26,494	1,00000	1,00000	-	Equity	
ING GROEP NV-CVA	NL0000303600	1.208,000	EUR	12,450	15.039,60	1,00000	15.039,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,450	10,824	1,00000	1,00000	-	Equity	
INVESTOR AB-B SHS	SE0000107419	4.410,000	SEK	312,600	1.378.566,00	9,15815	150.528,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	312,600	194,491	9,15815	8,77613	-	Equity	
Totale I.G. - T.Capitale Q UE							677.189,88														
MEDIOBANCA SPA 31/03/2017 FLOATING	IT0004689755	50.000,000	EUR	103,261	51.630,50	1,00000	51.630,50	-	-	-	-	-	-	Obbligazion	103,261	103,800	1,00000	1,00000	NR	0,50	Corp
MEDIOBANCA SPA 17/10/2023 3,625	IT0004966716	200.000,000	EUR	118,791	237.582,00	1,00000	237.582,00	-	1,485,6												

Dividendi Pending

den_portafoglio_op	den_sezione	den_categoria_bilancio	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_di visa	data_operazione	data_valuta	data_banca	data_contabilizzazione	imp_valore_nominale	imp_prezzo_lordo	imp_prezzo_netto	tasso_cambio	tasso_cambio_banca	imp_valore_pending_lc
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	FR0000120271	TOTAL SA	EUR	21/12/2015	14/01/2016	14/01/2016	21/12/2015	371,00	0,427000	0,427000	1,000000	1,000000	158,42
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	12/11/2015	14/01/2016	14/01/2016	12/11/2015	1.202,00	0,190000	0,190000	0,707800	0,707800	309,86
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB0009697037	BABCOCK INTL GROUP PLC	GBP	10/12/2015	14/01/2016	14/01/2016	10/12/2015	664,00	0,060500	0,060500	0,721300	0,721300	54,50
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB0030913577	BT GROUP PLC	GBP	24/12/2015	08/02/2016	08/02/2016	24/12/2015	2.325,00	0,044000	0,044000	0,733500	0,733500	138,80
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB00B0N8QD54	BRITVIC PLC	GBP	03/12/2015	05/02/2016	05/02/2016	03/12/2015	1.164,00	0,163000	0,163000	0,721600	0,721600	257,42
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB00B4Y7R145	DIXONS CARPHONE PLC	GBP	31/12/2015	22/01/2016	22/01/2016	31/12/2015	1.758,00	0,032500	0,032500	0,737050	0,737050	77,51
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q UE	GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	GBP	19/11/2015	03/02/2016	03/02/2016	19/11/2015	9.454,00	0,036800	0,036800	0,702000	0,702000	472,03
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - ANIMA / sottoptf															
1.468,54															

Vendite Pending

den_portafoglio_op	den_sezione	den_categoria_bilancio	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_di visa	data_operazione	data_valuta	data_banca	data_contabilizzazione	imp_valore_nominale	imp_prezzo_lordo	imp_prezzo_netto	tasso_cambio	tasso_cambio_banca	imp_valore_pending_lc
AMUNDI / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	4.385,17	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	75.876,63
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - AMUNDI / sottoptf															
75.876,63															
ANIMA / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	4.385,17	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	75.876,63
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - ANIMA / sottoptf															
75.876,63															
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	5.475,00	1,000000	1,000000	9,196500	9,196500	597,83
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	SMH6 Index	SWISS MKT IX FUTR Mar16	CHF	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	4.500,00	1,000000	1,000000	1,080700	1,080700	4.138,31
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	2.870,00	1,000000	1,000000	0,735800	0,735800	3.893,90
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	4.385,17	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	75.876,63
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - DUEMME / sottoptf															
84.506,67															

Acquisti Pending

den_portafoglio_op	den_sezione	den_categoria_bilancio	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_di visa	data_operazione	data_valuta	data_banca	data_contabilizzazione	imp_valore_nominale	imp_prezzo_lordo	imp_prezzo_netto	tasso_cambio	tasso_cambio_banca	imp_valore_pending_lc
AMUNDI / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	519,88	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	8.995,56
AMUNDI / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.540,03	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	43.950,21
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - AMUNDI / sottoptf															
52.945,77															
ANIMA / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	519,88	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	8.995,56
ANIMA / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.540,03	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	43.950,21
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - ANIMA / sottoptf															
52.945,77															
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	29/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	29/12/2015	3.000,00	1,000000	1,000000	9,150750	9,150750	327,58
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	1.125,00	1,000000	1,000000	9,158150	9,158150	122,84
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	SMH6 Index	SWISS MKT IX FUTR Mar16	CHF	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	1.380,00	1,000000	1,000000	1,087400	1,087400	1.269,08
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	1.890,00	1,000000	1,000000	0,737050	0,737050	2.564,28
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	519,89	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	8.995,56
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ10	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - OR	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.540,04	17,303000	17,303000	1,000000	1,000000	43.950,22
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 10 - DUEMME / sottoptf															
57.229,56															

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE

Iscritto nell'apposito albo in data 28/11/2007 al n° 1645.

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE E DEL VALORE DEL PATRIMONIO

COMPARTO ORIZZONTE 20**VALORIZZAZIONE DEL 31/12/2015**

(valori espressi in €)

		31/12/2015
	Investimenti diretti	-
	Investimenti in gestione	79.443.715,39
	Attività della gestione amministrativa	-
	Proventi maturati e non riscossi	484.579,18
	Crediti d'imposta	-
(A)	TOTALE ATTIVITA'	79.928.294,57
	Passività della gestione previdenziale	1.214.328,47
	Passività della gestione finanziaria	32.465,07
	Passività della gestione amministrativa	-
	Oneri maturati e non liquidati	60.833,02
	Debiti d'imposta	601.735,90
(B)	TOTALE PASSIVITA'	1.909.362,46
(A - B)	ATTIVO NETTO DESTINATO ALLE PRESTAZIONI	78.018.932,11
	Numero delle quote in essere	4.898.089,032
	Valore unitario della quota	15,928

	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZ 20- MAIN	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - DUEMME / sottoptf	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - ANIMA / sottoptf	CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - AMUNDI / sottoptf
den_portafoglio				
data_nav	31/12/2015	31/12/2015	31/12/2015	31/12/2015
data_calcolo	08/01/2016	08/01/2016	08/01/2016	08/01/2016
totale_obbligazioni	57.650.397,46	25.852.716,68	16.172.394,04	15.625.286,74
rateo_titoli	484.579,18	262.419,75	117.752,82	104.406,61
totale_azioni	9.988.243,32	3.067.368,77	6.920.874,55	-
totale_fondi	7.578.816,10	-	-	7.578.816,10
dividendi_pending	8.714,51	2.157,98	6.556,53	-
comm_retrocessione	-	-	-	-
comm_giorno_retrocessione	-	-	-	-
totale_banche	1.752.642,72	1.180.730,89	426.629,98	145.281,85
interessi	-	-	-	-
totale_pct	-	-	-	-
totale_fwd_cambi_pos	1.391,30	126,60	-	1.264,70
totale_futures_pos	740.402,95	367.731,65	-	372.671,30
totale_opzioni_pos	-	-	-	-
totale_cc_margini	-	-	-	-
crediti_pending	325.183,21	47.199,24	26.898,12	251.085,85
totale_finanziamenti	-	-	-	-
totale_margini_finanziamenti	-	-	-	-
totale_immobili	-	-	-	-
totale_margini_immobili	-	-	-	-
totale_cash_deposit	-	-	-	-
totale_swap_pos	-	-	-	-
rateo_cash_deposit	-	-	-	-
attivo lordo gestito	78.530.370,75	30.780.451,56	23.671.106,04	24.078.813,15
debiti_pending	- 27.445,37	- 27.445,37	-	-
totale_fwd_cambi_neg	- 5.019,70	-	-	5.019,70
totale_futures_neg	- 22.330,11	- 22.330,11	-	-
totale_opzioni_neg	-	-	-	-
totale_swap_neg	-	-	-	-
ritenuta_cash_deposit	-	-	-	-
portafoglio netto gestito	78.475.575,57	30.730.676,08	23.671.106,04	24.073.793,45
risorse lorde gestione	78.475.575,57	30.730.676,08	23.671.106,04	24.073.793,45
comm_ges_finanziaria	- 12.149,90	- 4.679,96	- 4.002,73	- 3.467,21
comm_giorno_ges_finanziaria	- 5.981,57	- 2.304,62	- 1.971,74	- 1.705,21
comm_overperformance	- 24.691,75	-	- 5.925,85	- 18.765,90
comm_giorno_overperformance	-	-	-	-
comm_gar_capitale	-	-	-	-
comm_giorno_gar_capitale	-	-	-	-
risorse nette gestione	78.432.752,35	30.723.691,50	23.659.205,72	24.049.855,13
comm_compagnia	-	-	-	-
comm_giorno_compagnia	-	-	-	-
comm_rete	-	-	-	-
comm_giorno_rete	-	-	-	-
comm_revisione	-	-	-	-
comm_giorno_revisione	-	-	-	-
comm_banca_depositaria	- 3.412,43	-	-	-
comm_giorno_banca_depositaria	- 1.708,43	-	-	-
comm_clearing	- 12.888,94	- 2.447,45	- 10.202,48	- 239,01
comm_giorno_clearing	-	-	-	-
altre_commissioni	-	-	-	-
miscellanee	-	-	-	-
totale_margini_miscellanee	-	-	-	-
nav finanziario	78.414.742,55	30.721.244,05	23.649.003,24	24.049.616,12
totale_misc_ges_amm	-	-	-	-
crediti_previdenziali	136.213,94	45.404,64	45.404,65	45.404,65
debiti_previdenziali	- 909.417,23	- 303.139,07	- 303.139,08	- 303.139,08
patrimonio lordo ante i	77.641.539,26	30.463.509,62	23.391.268,81	23.791.881,69
crediti_imposta_oicr	-	-	-	-
totale_misc_fiscalita	-	-	-	-
imposta_sostitutiva	- 601.735,90	-	-	-
ritenute_anno_in_corso	-	-	-	-
patrimonio netto	77.039.803,36	30.463.509,62	23.391.268,81	23.791.881,69
contributi_giorno	1.284.039,99	428.013,33	428.013,33	428.013,33
rimborsi_giorno	- 304.911,24	- 101.637,08	- 101.637,08	- 101.637,08
attivo netto dest prest	78.018.932,11	30.789.885,87	23.717.645,06	24.118.257,94
totale quote	4.898.089,032			
imp prezzo nav	15,928			
contributi copertura spese	121.340,19			
contributi prestazioni acc	-			

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																						
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 20 AL 31.12.2015																						
GESTORE AMUNDI																						
den	strumento finanziario	cod isin	imp nominale totale	cod di visa	prezzo	valore divisa	tasso cambio	imp valore	rateo	crediti pending	dividendi pending	debiti pending	saldo margin	esposizione_glo bale_tramite_futures_lc	den sezione	prezzo carico	prezzo storico	tasso cambio carico	tasso cambio storico	cod_ratin g_compos ite_blm	duration	den_cate goria_strumento
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc AUD		53.971.800	AUD	1,000	53.971,80	1,49305	36.148,69	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,44650	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc CAD		10.822.090	CAD	1,000	10.822,09	1,50895	7.171,93	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,42776	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc CHF		2.585.660	CHF	1,000	2.585,66	1,08740	2.377,84	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,26366	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc EUR		40.733.640	EUR	1,000	40.733,64	1,00000	40.733,64	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc GBP		9.529.510	GBP	1,000	9.529,51	0,73705	12.929,26	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,72079	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc JPY		5.395.279.000	JPY	1,000	5.395.279,00	130,67645	41.287,31	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	132,74940	-	-	-
	CARIPARMA ORIZ 20 AMUNDI cc USD		5.033.020	USD	1,000	5.033,02	1,08630	4.633,18	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,09282	-	-	-
	Totale I.G - Depositi Bancari							145.281,65														
	Forward su cambi: vendita USD, acquisto EUR	FWDCAMUSDEUR	3.755,000	EUR	1,000	3.755,00	1,00000	3.755,00	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-	-
	Totale I.G - Forward su cambi							3.755,00														
	EURO-BUND FUTURE Mar16	RXH6 Comdty	5,000	EUR	157,920	11,100,00	1,00000	11,100,00	-	-	-	-	5.600,00	789.600,00	Futures	160,140	160,140	1,00000	1,00000	-	-	Comdty
	TOPIX INDX FUTR Mar16	TPH6 Index	3,000	JPY	1.547,500	1.341,000,00	130,67645	10.261,99	-	-	-	-	15.427,42	355.266,76	Futures	1.592,200	1.592,200	133,76790	133,76790	-	-	Index
	SPI 200 FUTURES Mar16	XPH6 Index	2,000	AUD	5.257,000	14,775,00	1,49305	9.895,85	-	-	-	-	3.600,01	176.049,03	Futures	4.961,500	4.961,500	1,52115	1,52115	-	-	Index
	Totale I.G - Futures							10.733,86					6.227,41	258.284,21								
	A-F ID EO EUROPE-OEC	LU0557865424	2.730,000	EUR	1.459,230	3.983.697,90	1,00000	3.983.697,90	-	-	-	-	-	-	OICR	1.459,230	1.029.843	1,00000	1,00000	-	-	Equity
	A-F ID EO NTH AM-OEC	LU0557865770	1.300,000	EUR	1.979,830	2.573.779,00	1,00000	2.573.779,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1.979,830	1.172,033	1,00000	1,00000	-	-	Equity
	A-F EO EURO SELT-OEC	LU0557870697	280,000	EUR	1.764,590	494.085,20	1,00000	494.085,20	-	-	-	-	-	-	OICR	1.764,590	1.913,650	1,00000	1,00000	-	-	Equity
	A-F EO EURP SELT-OEC	LU0557870853	350,000	EUR	1.506,440	527.254,00	1,00000	527.254,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1.506,440	1.524,160	1,00000	1,00000	-	-	Equity
	Totale I.G - OICVM UE							7.578.816,10														
	ENI SPA 02/02/2026 1,5	XS1180451657	100,000,000	EUR	96,114	96,114,00	1,00000	96,114,00	1,364,38	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,114	101,150	1,00000	1,00000	A-	9,30	Corp
	AUTOSTRADE PER LITALIA 04/11/2021 1,125	XS1316567343	100,000,000	EUR	100,399	100,399,00	1,00000	100,399,00	175,20	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,399	100,380	1,00000	1,00000	BBB+	5,69	Corp
	AUTOSTRADE PER LITALIA 26/06/2026 1,75	XS1327504087	100,000,000	EUR	99,757	99,757,00	1,00000	99,757,00	148,22	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,757	99,146	1,00000	1,00000	BBB+	9,66	Corp
	Totale I.G - Tdebito Q IT							296.270,00	1.687,80													
	AMERICA MOVIL SAB DE CV 12/07/2021 3	XS0802174044	100,000,000	EUR	109,312	109,312,00	1,00000	109,312,00	1,409,84	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,312	104,110	1,00000	1,00000	A-	5,14	Corp
	PETROLEOS MEXICANOS 27/11/2020 3,125	XS0997448430	100,000,000	EUR	96,552	96,552,00	1,00000	96,552,00	290,30	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,552	99,358	1,00000	1,00000	BBB+	4,61	Corp
	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 21/07/2022, 75	XS1171489393	100,000,000	EUR	98,270	98,270,00	1,00000	98,270,00	334,02	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,270	99,876	1,00000	1,00000	A+	6,40	Corp
	STATOIL ASA 17/02/2023, 875	XS1190624111	150,000,000	EUR	96,825	145,237,50	1,00000	145,237,50	1,139,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,825	99,846	1,00000	1,00000	AA-	6,89	Corp
	AT&T INC 15/03/2035 2,45	XS1196380031	100,000,000	EUR	88,545	88,545,00	1,00000	88,545,00	1,988,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	88,545	99,328	1,00000	1,00000	BBB+	14,95	Corp
	APPLE INC 17/01/2024 1,375	XS1292384960	150,000,000	EUR	100,923	151,384,50	1,00000	151,384,50	593,32	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,923	99,604	1,00000	1,00000	AA+	7,65	Corp
	UNITED PARCEL SERVICE 15/11/2025 1,625	XS1323463726	100,000,000	EUR	100,585	100,585,00	1,00000	100,585,00	182,53	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,585	99,708	1,00000	1,00000	A+	9,20	Corp
	Totale I.G - Tdebito Q OCSE							789.886,00	5.938,02													
	ENGIE 13/03/2022, 5	FR0012602753	200,000,000	EUR	97,306	194,612,00	1,00000	194,612,00	800,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	97,306	95,782	1,00000	1,00000	A	6,10	Corp
	DANONE SA 30/05/2024 1,25	FR0013063809	100,000,000	EUR	98,592	98,592,00	1,00000	98,592,00	106,16	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,592	99,228	1,00000	1,00000	BBB+	8,03	Corp
	KFV 16/02/2026 2,05	US0070789N36	500,000,000	JPY	119,264	596,320,00	130,67645	4.563,33	29,44	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,264	95,350	130,67645	127,55510	AAA	9,24	Corp
	ROLLS-ROYCE PLC 18/06/2021 2,125	XS0944838241	100,000,000	EUR	105,330	105,330,00	1,00000	105,330,00	1,137,98	-	-	-	-	-	Obbligazioni	105,330	99,557	1,00000	1,00000	A-	5,17	Corp
	CREDIT AGRICOLE LONDON 19/01/2022, 875	XS1169630602	200,000,000	EUR	98,421	196,842,00	1,00000	196,842,00	1,658,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,421	97,068	1,00000	1,00000	A	5,88	Corp
	HEINCKEN NV 10/09/2021 1,25	XS1288852939	100,000,000	EUR	100,913	100,913,00	1,00000	100,913,00	382,51	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,913	99,839	1,00000	1,00000	BBB+	5,52	Corp
	BAT INTL FINANCE PLC 23/05/2022 1	XS1324928750	100,000,000	EUR	98,019	98,019,00	1,00000	98,019,00	104,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,019	99,297	1,00000	1,00000	A-	6,22	Corp
	Totale I.G - Tdebito Q UE							798.871,33	4.219,65													
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2025 5	IT0004513641	250,000,000	EUR	129,912	324,780,75	1,00000	324,780,75	4,155,22	-	-	-	-	-	Obbligazioni	129,912	109,118	1,00000	1,00000	NR	7,62	Govt
	CCTS EU 15/04/2018 FLOATING	IT0004716319	800,000,000	EUR	102,056	816,444,00	1,00000	816,444,00	1,755,60	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,056	98,775	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2044 4,75	IT0004923998	200,000,000	EUR	141,069	282,138,60	1,00000	282,138,60	3,157,97	-	-	-	-	-	Obbligazioni	141,069	113,107	1,00000	1,00000	NR	17,83	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2024 4,5	IT0004953417	500,000,000	EUR	124,160	620,801,50	1,00000	620,801,50	7,479,40	-	-	-	-	-	Obbligazioni	124,160	105,625	1,00000	1,00000	NR	7,00	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2024 4,75	IT0005001547	300,000,000	EUR	118,750	356,250,60	1,00000	356,250,60	3,739,70	-	-	-	-	-	Obbligazioni	118,750	103,778	1,00000	1,00000	NR	7,53	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2019 1,5	IT0005030504	300,000,000	EUR	104,183	312,547,50	1,00000	312,547,50	1,858,70	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,183	100,626	1,00000	1,00000	NR	3,49	Govt
	CCTS EU 15/12/2020 FLOATING	IT0005056541	750,000,000	EUR	102,339	767,541,75	1,00000	767,541,75	254,00	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,339	101,617	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2046 3,25	IT0005083057	50,000,000	EUR	111,745	55,872,45	1,00000	55,872,45	540,18	-	-	-	-	-	Obbligazioni	111,745	102,503	1,00000	1,00000	NR	20,11	Govt
	BUONI POLIENNALI DEL TES 15/05/2018, 25	IT0005106049	200,000,000	EUR	100,378	200,755,40	1,00000	200,755,40	56,32	251,085,85	-	-	-	-	Obbligazioni	100,378	99,865	1,00000	1,00000	NR	2,37	Govt
	Totale I.G - Tstato Org.Int Q IT							3.737.132,55	22.997,09													
	CANADIAN GOVERNMENT 01/09/2020, 75	CA135087E596	400,000,000	CAD	100,104	400,416,00	1,50895	265,360,68	660,89	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,104	99,095	1,50895	1,43220	AAA	4,59	Govt
	CANADIAN GOVERNMENT 01/06/2016 4	CA135087YB43	100,000,000	CAD	101,430	101,430,00	1,50895	67,218,93	217,28	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,430	110,193	1,50895	1,48018	AAA	0,42	Govt
	USY INFL IX NB 15/01/2028 1,75	US912810PV44	200,000,000	USD	124,213	248,426,70	1,08630	228,690,69	1,679,84	-	-	-	-	-	Obbligazioni	124,213	128,185	1,08630	1,11025	AAA	10,99	Govt
	US TREASURY N/B 15/02/2039 3,5	US912810QA97	50,000,000	USD	110,609	55,304,69	1,08630	50,911,07	604,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	110,609	111,105	1,08630	1,05615	AAA	16,25	Govt
	US TREASURY N/B 15/11/2044 3	US912810RJ97	120,000,000	USD	99,633	119,659,38	1,08630	110,061,11	418,81	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,633	113,129	1,08630	1,14975	AAA	19,43	Govt
	US TREASURY N/B 15/02/2018 1	US912828H946	600,000,000	USD	99,723	598,335,94	1,08630	550,801,75	2,071,25	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,723	99,930	1,08630	1,07415	AAA	2,10	Govt
	US TREASURY N/B 15/11/2018 3,75																					

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_to_tale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures_lc	den_sezion	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_com_blim	duration	den_categoria
ALPHABET INC-CL C	US02079K1079	51,000	USD	758,880	38.702,88	1,06630	35.628,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	758,880	550,165	1,06630	1,11937	-	-	Equity
ALPHABET INC-CL C	US02079K3059	66,000	USD	778,010	51.348,66	1,06630	47.269,32	-	-	-	-	-	-	Azioni	778,010	633,125	1,06630	1,11949	-	-	Equity
ALTRIA GROUP INC	US02209S1033	135,000	USD	58,210	7.858,35	1,06630	7.234,05	-	-	59,68	-	-	-	Azioni	58,210	51,726	1,06630	1,09153	-	-	Equity
AMAZON.COM INC	US0231351067	71,000	USD	675,890	47.988,19	1,06630	44.175,82	-	-	-	-	-	-	Azioni	675,890	481,209	1,06630	1,15621	-	-	Equity
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	US0268747849	609,000	USD	61,970	37.739,73	1,06630	34.741,54	-	-	-	-	-	-	Azioni	61,970	56,591	1,06630	1,13519	-	-	Equity
AMGEN INC	US0311621009	46,000	USD	162,330	7.467,18	1,06630	6.873,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	162,330	164,001	1,06630	1,06020	-	-	Equity
APPLE INC	US0378331005	762,000	USD	105,260	80.208,12	1,06630	73.836,07	-	3.959,62	-	-	-	-	Azioni	105,260	98,169	1,06630	1,23264	-	-	Equity
APPLIED MATERIALS INC	US0382221051	804,000	USD	18,670	15.010,68	1,06630	13.818,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	18,670	18,673	1,06630	1,05869	-	-	Equity
ARAMARK	US03852U1060	260,000	USD	32,250	8.385,00	1,06630	7.718,86	-	-	-	-	-	-	Azioni	32,250	26,181	1,06630	1,33742	-	-	Equity
BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	3.369,000	USD	16,830	56.700,27	1,06630	52.195,77	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,830	16,693	1,06630	1,22205	-	-	Equity
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	US0640581007	892,000	USD	41,220	36.768,24	1,06630	33.847,22	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,220	37,368	1,06630	1,20133	-	-	Equity
BECTON DICKINSON AND CO	US0758871091	110,000	USD	154,090	16.949,90	1,06630	15.603,33	-	-	-	-	-	-	Azioni	154,090	141,554	1,06630	1,21295	-	-	Equity
BLACKROCK INC	US09247X1019	55,000	USD	340,520	18.728,60	1,06630	17.240,73	-	-	-	-	-	-	Azioni	340,520	340,574	1,06630	1,11195	-	-	Equity
BOEING CO/THE	US0970231058	215,000	USD	144,590	31.086,85	1,06630	28.617,19	-	-	-	-	-	-	Azioni	144,590	143,215	1,06630	1,11300	-	-	Equity
BOSTON SCIENTIFIC CORP	US1011371077	924,000	USD	18,440	17.038,56	1,06630	15.684,95	-	-	-	-	-	-	Azioni	18,440	12,864	1,06630	1,26963	-	-	Equity
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	US1101221083	201,000	USD	68,790	13.826,79	1,06630	12.728,33	-	-	59,76	-	-	-	Azioni	68,790	67,270	1,06630	1,08393	-	-	Equity
BROADCOM CORP-CL A	US1113201073	302,000	USD	57,820	17.461,64	1,06630	16.074,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	57,820	29,137	1,06630	1,35105	-	-	Equity
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	US1156372096	128,000	USD	99,280	12.707,84	1,06630	11.698,28	-	-	-	-	-	-	Azioni	99,280	78,728	1,06630	1,36855	-	-	Equity
CVS HEALTH CORP	US1266501006	160,000	USD	97,770	15.643,20	1,06630	14.400,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	97,770	98,370	1,06630	1,10805	-	-	Equity
CELGENE CORP	US1510201049	95,000	USD	119,760	11.377,20	1,06630	10.473,35	-	-	-	-	-	-	Azioni	119,760	122,352	1,06630	1,12930	-	-	Equity
CHEVRON CORP	US1667641005	456,000	USD	89,960	41.021,76	1,06630	37.762,83	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,960	84,300	1,06630	1,22474	-	-	Equity
CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	873,000	USD	27,155	23.706,32	1,06630	21.823,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	27,155	25,889	1,06630	1,12290	-	-	Equity
CITIGROUP INC	US1729674242	1.126,000	USD	51,750	58.270,50	1,06630	53.641,26	-	-	-	-	-	-	Azioni	51,750	53,188	1,06630	1,18529	-	-	Equity
CITRIX SYSTEMS INC	US1737761002	150,000	USD	75,650	11.347,50	1,06630	10.446,01	-	-	-	-	-	-	Azioni	75,650	76,262	1,06630	1,11904	-	-	Equity
COCA-COLA CO/THE	US1912161007	825,000	USD	42,960	35.442,00	1,06630	32.626,35	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,960	41,918	1,06630	1,18438	-	-	Equity
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	US1924461023	117,000	USD	60,020	7.022,34	1,06630	6.464,46	-	-	-	-	-	-	Azioni	60,020	64,241	1,06630	1,11205	-	-	Equity
COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	461,000	USD	56,430	26.014,23	1,06630	23.947,56	-	-	-	-	-	-	Azioni	56,430	60,620	1,06630	1,11895	-	-	Equity
CONCOPhillips	US2025C1045	214,000	USD	46,690	9.991,66	1,06630	9.197,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,690	54,780	1,06630	1,12630	-	-	Equity
COSTCO WHOLESALE CORP	US22160K1051	71,000	USD	161,500	11.466,50	1,06630	10.555,56	-	-	-	-	-	-	Azioni	161,500	145,584	1,06630	1,10785	-	-	Equity
DANAHER CORP	US2358511028	103,000	USD	92,860	9.566,64	1,06630	8.806,63	-	-	10,88	-	-	-	Azioni	92,860	93,689	1,06630	1,10465	-	-	Equity
DARDEN RESTAURANTS INC	US2371941053	184,000	USD	63,640	11.709,78	1,06630	10.779,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	63,640	59,935	1,06630	1,12926	-	-	Equity
WALT DISNEY CO/THE	US2546871060	464,000	USD	105,080	48.575,12	1,06630	44.883,66	-	-	-	-	-	-	Azioni	105,080	95,631	1,06630	1,16916	-	-	Equity
DOW CHEMICAL CO/THE	US2805431038	457,000	USD	51,490	23.526,36	1,06630	21.657,33	-	-	164,49	-	-	-	Azioni	51,490	47,516	1,06630	1,11766	-	-	Equity
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	US2835341090	146,000	USD	66,600	9.723,60	1,06630	8.951,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	66,600	60,220	1,06630	1,11566	-	-	Equity
EOG RESOURCES INC	US28675P1012	269,000	USD	70,790	19.042,51	1,06630	17.529,70	-	-	-	-	-	-	Azioni	70,790	84,687	1,06630	1,09383	-	-	Equity
ENERGIZER HOLDINGS INC	US28272W1099	287,000	USD	34,080	9.775,22	1,06630	8.998,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,080	40,997	1,06630	1,12155	-	-	Equity
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	US30219G1085	227,000	USD	87,410	18.842,07	1,06630	18.265,74	-	-	-	-	-	-	Azioni	87,410	86,410	1,06630	1,12125	-	-	Equity
EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	777,000	USD	77,950	60.567,15	1,06630	56.755,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,950	89,178	1,06630	1,22841	-	-	Equity
FACEBOOK INC-A	US30303M1027	286,000	USD	104,660	29.932,78	1,06630	27.554,78	-	-	-	-	-	-	Azioni	104,660	91,652	1,06630	1,18148	-	-	Equity
FISERV INC	US3377381088	101,000	USD	91,460	9.237,46	1,06630	8.503,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	91,460	86,042	1,06630	1,12155	-	-	Equity
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	US35086T1097	81,000	USD	24,160	1.473,76	1,06630	1.356,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	24,160	21,126	1,06630	1,06935	-	-	Equity
GENERAL ELECTRIC CO	US3696041033	2.737,000	USD	31,150	85.257,55	1,06630	78.484,35	-	7.169,40	537,57	-	-	-	Azioni	31,150	27,018	1,06630	1,20711	-	-	Equity
GENERAL MOTORS CO	US37045V1008	501,000	USD	34,010	17.039,01	1,06630	15.685,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,010	35,482	1,06630	1,12464	-	-	Equity
GILEAD SCIENCES INC	US3755581036	265,000	USD	101,190	26.815,35	1,06630	24.685,03	-	-	-	-	-	-	Azioni	101,190	106,705	1,06630	1,12759	-	-	Equity
HALLIBURTON CO	US4062161017	370,000	USD	34,040	12.594,80	1,06630	11.594,22	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,040	41,937	1,06630	1,09335	-	-	Equity
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	US42824C1099	897,000	USD	15,200	13.634,40	1,06630	12.551,23	-	-	38,60	-	-	-	Azioni	15,200	14,292	1,06630	1,05849	-	-	Equity
HOME DEPOT INC	US4370761029	158,000	USD	132,250	20.895,50	1,06630	19.235,48	-	-	-	-	-	-	Azioni	132,250	113,692	1,06630	1,10652	-	-	Equity
INTEL CORP	US4581401001	521,000	USD	34,450	17.948,45	1,06630	16.522,55	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,450	30,423	1,06630	1,12034	-	-	Equity
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	US45866F1049	67,000	USD	256,260	17.169,42	1,06630	15.805,41	-	-	-	-	-	-	Azioni	256,260	225,658	1,06630	1,12585	-	-	Equity
INTL BUSINESS MACHINES CORP	US4592001014	79,000	USD	137,620	10.871,98	1,06630	10.008,27	-	-	-	-	-	-	Azioni	137,620	177,629	1,06630	1,18128	-	-	Equity
JPMORGAN CHASE & CO	US46625H1005	900,000	USD	66,030	59.427,00	1,06630	54.705,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	66,030	64,302	1,06630	1,09605	-	-	Equity
JOHNSON & JOHNSON	US4781601046	472,000	USD	102,720	48.483,84	1,06630	44.632,09	-	-	-	-	-	-	Azioni	102,720	97,679	1,06630	1,18868	-	-	Equity
JOHNSON CONTROLS INC	US4783661071	212,000	USD	39,490	8.371,88	1,06630	7.706,78	-	-	48,11	-	-	-	Azioni	39,490	45,191	1,06630	1,07415	-	-	Equity
JUNIPER NETWORKS INC	US48203R1041	283,000	USD	27,600	7.810,80	1,06630	7.190,28	-	-	-	-	-	-	Azioni	27,600	27,486	1,06630	1,11015	-	-	Equity
KEYCORP	US4932671088	923,000	USD	13,190	12.147,99	1,06630	11.182,91	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,190	13,470	1,06630	1,13415	-	-	Equity
ELI LILLY & CO	US5324571083	204,000	USD	84,260	17.189,04	1,06630	15.823,47	-	-	-	-	-	-	Azioni	84,260	82,020	1,06630	1,08762	-	-	Equity
LINEAR TECHNOLOGY CORP	US5356781063	627,000	USD	42,470	26.373,87	1,06630	24.278,62	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,470	44,545	1,06630	1,13133	-	-	Equity
MASTERCARD INC-CLASS A	US57636Q1040	135,000	USD	97,360	13.143,60	1,06630	12.099,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	97,360	86,425	1,06630	1,20255	-	-	Equity
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	US57772K1016	205,000	USD	38,000	7.790,00	1,06630	7.171,13	-	-	-	-	-	-	Azioni	38,000	38,835	1,06630	1,13865	-	-	Equity
MCDONALDS CORP	US5801351017	306,000	USD	118,140	36.150,84	1,06630	33.278,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	118,140	104,716	1,06630	1,10983	-	-	Equity
MERCK & CO. INC.	US58933Y10																				

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_to_tale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures_lc	den_sezion	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_bim	duration	den_categoria_strumento
UNITED TECHNOLOGIES CORP	US9130171096	142,000	USD	96,070	13.641,94	1,08630	12.558,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	96,070	97,313	1,08630	1,13425	-	-	Equity
UNITEDHEALTH GROUP INC	US91324P1021	115,000	USD	117,640	13.528,60	1,08630	13.528,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	117,640	123,024	1,08630	1,11064	-	-	Equity
VERIZON COMMUNICATIONS INC	US92343V1044	435,000	USD	46,220	20.105,70	1,08630	18.508,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,220	45,463	1,08630	1,13425	-	-	Equity
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	US92532F1003	71,000	USD	125,830	8.933,93	1,08630	8.224,18	-	-	-	-	-	-	Azioni	125,830	132,909	1,08630	1,06185	-	-	Equity
VISA INC-CLASS A SHARES	US92826C8394	395,000	USD	77,550	30.632,25	1,08630	28.198,70	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,550	71,055	1,08630	1,11758	-	-	Equity
WELLS FARGO & CO	US9497461015	1.159,000	USD	54,360	63.003,24	1,08630	57.998,01	-	-	-	-	-	-	Azioni	54,360	51,144	1,08630	1,21313	-	-	Equity
Totale I.G. - T.Capitale Q OCSE							2.995.617,13		26.898,12	2.311,32											
ANHEUSER-BUSCH INBEV SANV	BE0003793107	638,000	EUR	114,400	72.987,20	1,00000	72.987,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	114,400	117,789	1,00000	1,00000	-	-	Equity
BEIERSDORF AG	DE0005200000	353,000	EUR	84,160	29.708,48	1,00000	29.708,48	-	-	-	-	-	-	Azioni	84,160	77,110	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CONTINENTAL AG	DE0005439004	160,000	EUR	224,550	35.928,00	1,00000	35.928,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	224,550	211,062	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE POST AG-REG	DE0005552004	521,000	EUR	25,955	13.522,55	1,00000	13.522,55	-	-	-	-	-	-	Azioni	25,955	26,722	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DE0005557508	2.250,000	EUR	16,690	37.552,50	1,00000	37.552,50	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,690	15,882	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	207,000	EUR	81,390	16.847,73	1,00000	16.847,73	-	-	-	-	-	-	Azioni	81,390	77,884	1,00000	1,00000	-	-	Equity
HEIDELBERGCEMENT AG	DE0006047004	317,000	EUR	75,620	23.971,54	1,00000	23.971,54	-	-	-	-	-	-	Azioni	75,620	73,018	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INFINEON TECHNOLOGIES AG	DE0006231004	4.035,000	EUR	13,505	54.492,68	1,00000	54.492,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,505	10,607	1,00000	1,00000	-	-	Equity
MERCK KGAA	DE0006599905	512,000	EUR	89,570	45.859,84	1,00000	45.859,84	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,570	84,200	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DANIEL AG-REGISTERED SHARES	DE0007100000	877,000	EUR	77,580	68.037,66	1,00000	68.037,66	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,580	72,913	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SAP SE	DE0007164600	1.122,000	EUR	73,380	82.332,36	1,00000	82.332,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	73,380	64,773	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SIEMENS AG-REG	DE0007236101	644,000	EUR	89,880	57.882,72	1,00000	57.882,72	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,880	92,620	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ALLIANZ SE-REG	DE0008404005	447,000	EUR	163,550	73.106,85	1,00000	73.106,85	-	-	-	-	-	-	Azioni	163,550	161,327	1,00000	1,00000	-	-	Equity
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	DE0008430026	300,000	EUR	184,550	55.365,00	1,00000	55.365,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	184,550	173,313	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ADIDAS AG	DE000A1EWWW0	479,000	EUR	89,910	43.066,89	1,00000	43.066,89	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,910	83,604	1,00000	1,00000	-	-	Equity
BAYER AG-REG	DE000BAY0017	688,000	EUR	115,800	79.670,40	1,00000	79.670,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	115,800	121,836	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CARLSBERG AS-B	DK0010181759	171,000	DKK	612,500	104.737,50	7,46265	14.034,89	-	-	-	-	-	-	Azioni	612,500	614,221	7,46265	7,45980	-	-	Equity
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	DK0010268606	235,000	DKK	483,800	113.693,00	7,46265	15.234,94	-	-	-	-	-	-	Azioni	483,800	370,479	7,46265	7,46190	-	-	Equity
DANSKE BANK A/S	DK0010274414	953,000	DKK	185,200	176.495,60	7,46265	23.650,53	-	-	-	-	-	-	Azioni	185,200	161,114	7,46265	7,45752	-	-	Equity
NOVO NORDISK A/S-B	DK00060534915	1.357,000	DKK	399,900	542.664,30	7,46265	72.717,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	399,900	269,377	7,46265	7,45595	-	-	Equity
BANCO SANTANDER SA	ES0113900J37	9.259,000	EUR	4,558	42.202,52	1,00000	42.202,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,558	5,037	1,00000	1,00000	-	-	Equity
FERROVIAL SA	ES0118900010	29,000	EUR	20,855	604,79	1,00000	604,79	-	-	-	-	-	-	Azioni	20,855	16,174	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ACCIONA SA	ES01125220311	395,000	EUR	79,080	31.236,60	1,00000	31.236,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	79,080	67,433	1,00000	1,00000	-	-	Equity
IBERDROLA SA	ES0144580Y14	2.199,000	EUR	6,550	14.403,45	1,00000	14.403,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	6,550	5,647	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	ES0148396007	1.011,000	EUR	31,690	32.038,59	1,00000	32.038,59	-	-	-	-	-	-	Azioni	31,690	27,407	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	ES0177542018	5.264,000	GBP	6,105	32.136,72	0,73705	43.691,82	-	-	-	-	-	-	Azioni	6,105	5,694	0,73705	0,71876	-	-	Equity
TELEFONICA SA	ES0178430E18	56,000	EUR	10,236	57,16	1,00000	57,16	-	-	-	-	-	-	Azioni	10,236	9,233	1,00000	1,00000	-	-	Equity
NOKIA OYJ	FI0009000681	12.181,000	EUR	6,595	80.333,69	1,00000	80.333,69	-	-	-	-	-	-	Azioni	6,595	6,388	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	1.222,000	EUR	10,880	13.295,36	1,00000	13.295,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	10,880	11,492	1,00000	1,00000	-	-	Equity
TOTAL SA	FR0000120271	1.055,000	EUR	41,265	43.534,58	1,00000	43.534,58	-	-	450,49	-	-	-	Azioni	41,265	45,738	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ACCOR SA	FR0000120404	484,000	EUR	40,005	19.362,42	1,00000	19.362,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	40,005	38,452	1,00000	1,00000	-	-	Equity
AXA SA	FR0000120628	2.792,000	EUR	25,230	70.442,16	1,00000	70.442,16	-	-	-	-	-	-	Azioni	25,230	22,427	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DANONE	FR0000120644	646,000	EUR	62,280	40.232,88	1,00000	40.232,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	62,280	59,523	1,00000	1,00000	-	-	Equity
NATIXIS	FR0000120685	3.926,000	EUR	5,217	20.481,94	1,00000	20.481,94	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,217	5,442	1,00000	1,00000	-	-	Equity
PERNOD RICARD SA	FR0000120693	261,000	EUR	105,200	27.457,20	1,00000	27.457,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	105,200	100,211	1,00000	1,00000	-	-	Equity
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	FR0000121014	181,000	EUR	144,900	26.226,90	1,00000	26.226,90	-	-	-	-	-	-	Azioni	144,900	150,293	1,00000	1,00000	-	-	Equity
THALES SA	FR0000121329	544,000	EUR	69,100	37.590,40	1,00000	37.590,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	69,100	50,450	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SCHNEIDER ELECTRIC SE	FR0000121972	260,000	EUR	52,560	13.665,60	1,00000	13.665,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	52,560	55,641	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CAP GEMINI	FR0000125338	647,000	EUR	85,600	55.383,20	1,00000	55.383,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	85,600	68,667	1,00000	1,00000	-	-	Equity
VINCI SA	FR0000125486	807,000	EUR	59,140	47.725,98	1,00000	47.725,98	-	-	-	-	-	-	Azioni	59,140	53,519	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SOCIETE GENERALE SA	FR0000130809	1.328,000	EUR	42,570	56.532,96	1,00000	56.532,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,570	44,173	1,00000	1,00000	-	-	Equity
BNP PARIBAS	FR0000131104	1.513,000	EUR	52,230	79.023,99	1,00000	79.023,99	-	-	-	-	-	-	Azioni	52,230	54,807	1,00000	1,00000	-	-	Equity
RENAULT SA	FR0000131906	675,000	EUR	92,630	62.525,25	1,00000	62.525,25	-	-	-	-	-	-	Azioni	92,630	91,738	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ORANGE	FR0000133308	3.346,000	EUR	15,485	51.812,81	1,00000	51.812,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,485	15,193	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ENGIE	FR0010208488	3.451,000	EUR	16,325	56.337,58	1,00000	56.337,58	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,325	15,691	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ARM HOLDINGS PLC	GB0000595859	2.047,000	GBP	10,390	21.268,33	0,73705	28.856,02	-	-	-	-	-	-	Azioni	10,390	10,652	0,73705	0,71723	-	-	Equity
SKY PLC	GB0001411924	2.572,000	GBP	11,120	28.600,64	0,73705	38.804,21	-	-	-	-	-	-	Azioni	11,120	10,667	0,73705	0,72492	-	-	Equity
AVIVA PLC																					

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_to	cod_divis	prezzo	valore_divisa	tasso_cambi	imp_valore	rateo	crediti_pendi	dividendi_pe	debiti_pendi	saldo_ma	esposizione	den_sezion	prezzo_caric	prezzo_storic	tasso_cambio_c	tasso_cambio	cod_rati	den_cate		
		tale	a			o			ng	nding	g	rgini	globale_trami	e	o	o	arico	storico	ng_com	den_cate		
													futures_lc						positi	goria_str		
																			blm	umento		
																			duration			
UNILEVER NV-CVA	NL0000009355	1.897.000	EUR	40,105	76.079,19	1,00000	76.079,19	-	-	-	-	-	-	-	-	-	20,105	36,476	1,00000	1,00000	-	Equity
KONINKLIJKE PHILIPS NV	NL0000009538	1.366.000	EUR	23,560	32.182,96	1,00000	32.182,96	-	-	-	-	-	-	-	-	-	23,560	25,541	1,00000	1,00000	-	Equity
KONINKLIJKE DSM NV	NL0000009827	676.000	EUR	46,280	31.285,28	1,00000	31.285,28	-	-	-	-	-	-	-	-	-	46,280	52,167	1,00000	1,00000	-	Equity
AIRBUS GROUP SE	NL0000235190	572.000	EUR	62,000	35.464,00	1,00000	35.464,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	62,000	58,596	1,00000	1,00000	-	Equity
ING GROEP NV-CVA	NL0000303600	2.833.000	EUR	12,450	35.270,85	1,00000	35.270,85	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450	11,878	1,00000	1,00000	-	Equity
RELX NV	NL0006144495	2.240.000	EUR	15,540	34.809,60	1,00000	34.809,60	-	-	-	-	-	-	-	-	-	15,540	14,014	1,00000	1,00000	-	Equity
NXP SEMICONDUCTORS NV	NL0009538784	224.000	USD	84,250	18.872,00	1,08630	17.372,73	-	-	-	-	-	-	-	-	-	84,250	74,015	1,08630	1,24291	-	Equity
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	NL0010877643	1.829.000	EUR	12,920	23.630,68	1,00000	23.630,68	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12,920	13,046	1,00000	1,00000	-	Equity
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	SE0000148884	3.870.000	SEK	89,400	345.978,00	9,15815	37.778,15	-	-	-	-	-	-	-	-	-	89,400	92,351	9,15815	9,23341	-	Equity
SANDVIK AB	SE0000667891	1.562.000	SEK	74,050	115.666,10	9,15815	12.629,85	-	-	-	-	-	-	-	-	-	74,050	83,245	9,15815	9,37135	-	Equity
ASSA ABLQY AB-B	SE0007100581	496.000	SEK	178,000	88.288,00	9,15815	9.640,37	-	-	-	-	-	-	-	-	-	178,000	175,741	9,15815	9,37540	-	Equity
Totale IG - TCapitale Q UE							3.642.495,35			4.245,21												
UNICREDIT SPA 19/06/2019 1,5	XS1078760813	200.000,000	EUR	102,096	204.192,00	1,00000	204.192,00	1.598,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,096	100,911	1,00000	1,00000	BBB	3,38	Corp	
INTESA SANPAOLO SPA 14/01/2020 1,125	XS1168003900	300.000,000	EUR	100,464	301.392,00	1,00000	301.392,00	3.245,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,464	99,624	1,00000	1,00000	BBB	3,93	Corp	
Totale IG - TDebito Q IT							505.584,00	4.843,91														
MERCK FIN SERVICES GMBH 24/03/2020 4,5	XS0497186758	100.000,000	EUR	116,333	116.333,00	1,00000	116.333,00	3.467,21	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,333	114,041	1,00000	1,00000	A-	3,86	Corp	
TELEFONICA EMISIONES SAU 03/02/2016 4,967	XS0696856847	100.000,000	EUR	100,385	100.385,00	1,00000	100.385,00	4.504,32	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,385	107,522	1,00000	1,00000	BBB	0,09	Corp	
Totale IG - TDebito Q UE							216.718,00	7.971,53														
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2027 6,5	IT0001174611	500,000	EUR	148,970	744,85	1,00000	744,85	5,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	148,970	120,530	1,00000	1,00000	NR	9,06	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2034 5	IT0003535157	18.500,000	EUR	140,034	25.906,29	1,00000	25.906,29	382,07	-	-	-	-	-	Obbligazioni	140,034	103,533	1,00000	1,00000	NR	13,20	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2020 4,5	IT0003644769	500,000	EUR	116,478	582,39	1,00000	582,39	9,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,478	107,166	1,00000	1,00000	NR	3,75	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2039 5	IT0004286966	180.000,000	EUR	142,791	257.024,16	1,00000	257.024,16	3.717,39	-	-	-	-	-	Obbligazioni	142,791	123,302	1,00000	1,00000	NR	15,53	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2020 4,25	IT0004536949	280.000,000	EUR	115,726	324.031,96	1,00000	324.031,96	3.955,77	-	-	-	-	-	Obbligazioni	115,726	115,012	1,00000	1,00000	NR	3,85	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2021 2,1	IT0004604671	400.000,000	EUR	120,784	483.136,92	1,00000	483.136,92	2.678,52	-	-	-	-	-	Obbligazioni	120,784	119,830	1,00000	1,00000	NR	5,42	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2026 3,1	IT0004735152	380.000,000	EUR	132,567	503.756,44	1,00000	503.756,44	3.676,87	-	-	-	-	-	Obbligazioni	132,567	129,361	1,00000	1,00000	NR	9,38	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2028 4,75	IT0004889033	240.000,000	EUR	131,762	316.229,52	1,00000	316.229,52	3.789,56	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,762	129,174	1,00000	1,00000	NR	10,00	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/06/2018 3,5	IT0004907843	680.000,000	EUR	108,205	735.791,96	1,00000	735.791,96	1.950,82	-	-	-	-	-	Obbligazioni	108,205	108,987	1,00000	1,00000	NR	2,34	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/12/2021 2,15	IT0005028003	30.000,000	EUR	107,266	32.179,80	1,00000	32.179,80	29,20	-	-	-	-	-	Obbligazioni	107,266	103,757	1,00000	1,00000	NR	5,64	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2019 1,5	IT0005030504	570.000,000	EUR	104,183	593.840,25	1,00000	593.840,25	3.531,52	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,183	103,614	1,00000	1,00000	NR	3,49	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/01/2018 7,5	IT0005058463	270.000,000	EUR	101,473	273.977,91	1,00000	273.977,91	929,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,473	101,193	1,00000	1,00000	NR	2,03	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 14/01/2016 ZERO COUPO	IT0005076581	100.000,000	EUR	100,012	100.012,30	1,00000	100.012,30	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,012	99,929	1,00000	1,00000	NR	0,04	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 12/02/2016 ZERO COUPO	IT0005089688	580.000,000	EUR	100,019	580.107,88	1,00000	580.107,88	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,019	99,940	1,00000	1,00000	NR	0,12	Govt	
CERT D CREDITO DEL TES 27/02/2017 ZERO COUPO	IT0005089955	1.840.000,000	EUR	100,043	1.840.794,88	1,00000	1.840.794,88	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,043	99,976	1,00000	1,00000	NR	1,16	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 14/03/2016 ZERO COUPO	IT0005091472	900.000,000	EUR	100,040	900.360,00	1,00000	900.360,00	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,040	99,979	1,00000	1,00000	NR	0,20	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 14/09/2016 ZERO COUPO	IT0005127375	400.000,000	EUR	100,059	400.237,20	1,00000	400.237,20	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,059	99,955	1,00000	1,00000	NR	0,71	Govt	
Totale IG - TStato Org.Int Q IT							7.368.714,71	24.655,33														
US TREASURY N/B 15/08/2041 3,75	US912810C0S6	160.000,000	USD	114,914	183.862,50	1,08630	169.255,73	2.071,25	-	-	-	-	-	Obbligazioni	114,914	110,923	1,08630	1,17688	AAA	17,15	Govt	
US TREASURY N/B 31/03/2022 1,75	US912828J769	80.000,000	USD	98,492	78.793,75	1,08630	72.534,06	323,95	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,492	97,704	1,08630	1,11450	NR	5,92	Govt	
US TREASURY N/B 31/01/2016 2	US912828PS31	450.000,000	USD	100,133	450.597,66	1,08630	414.800,39	3.444,58	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,133	100,456	1,08630	1,09589	AAA	0,08	Govt	
TSY INFL IX N/B 15/07/2021 8,25	US912828QV50	220.000,000	USD	106,351	233.973,15	1,08630	215.385,39	613,41	-	-	-	-	-	Obbligazioni	106,351	108,426	1,08630	1,08955	AAA	5,44	Govt	
US TREASURY N/B 30/11/2017 3,75	US912828JA67	80.000,000	USD	99,195	79.356,25	1,08630	73.051,87	38,99	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,195	99,832	1,08630	1,12775	AAA	1,91	Govt	
TSY INFL IX N/B 15/07/2025 3,75	US912828XL95	110.000,000	USD	97,199	106.918,89	1,08630	98.424,83	174,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	97,199	98,046	1,08630	1,10465	AAA	9,37	Govt	
Totale IG - TStato Org.Int Q OCSE							1.043.452,27	6.667,08														
REPUBLIC OF AUSTRIA 15/09/2021 3,5	AT0000A001X2	230.000,000	EUR	119,190	274.137,00	1,00000	274.137,00	2.353,42	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,190	112,884	1,00000	1,00000	AA+	5,28	Govt	
REPUBLIC OF AUSTRIA 20/10/2025 1,5	AT0000A1FAP5	200.000,000	EUR	102,835	205.670,00	1,00000	205.670,00	1.252,46	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,835	103,316	1,00000	1,00000	AA+	9,27	Govt	
BELGIUM KINGDOM 28/09/2020 3,75	BE0000318270	450.000,000	EUR	117,625	529.312,50	1,00000	529.312,50	4.334,02	-	-	-	-	-	Obbligazioni	117,625	114,531	1,00000	1,00000	AA-	4,43	Govt	
BELGIUM KINGDOM 22/06/2034 3	BE0000333428	160.000,000	EUR	119,883	191.812,80	1,00000	191.812,80	2.478,03	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,883	115,681	1,00000	1,00000	NR	14,67	Govt	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/01/2018 4	DE0001135341	29.500,000	EUR	108,725	32.073,88	1,00000	32.073,88	1.167,07	-	-	-	-										

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																					
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 20 AL 31.12.2015																					
GESTORE DUEMME																					
den strumento finanziario	cod isin	imp_nominale_tot	cod_di	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendin	dividendi_pen	debiti_pendin	saldo_margini	esposizione_glob	ale_tramite_futur	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_stori	tasso_cambi	tasso_cambio	cod_rati	den_cat
		ale	visa						g	ding	g		es	lc			co	o_carico	storico	ng_com	den_cat
																				posite_	oria_stru
																				blm	mento
																				duration	
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc AUD		20.862,830	AUD	1,000	20.862,83	1,49305	13.973,30	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,51214	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc CAD		53.269,980	CAD	1,000	53.269,98	1,50895	35.302,68	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,48513	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc CHF		185.269,810	CHF	1,000	185.269,81	1,08740	170.378,71	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,08578	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc DKK		15.069,900	DKK	1,000	15.069,90	7,46265	2.019,38	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	7,46265	7,44225	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc EUR		639.012,660	EUR	1,000	639.012,66	1,00000	639.012,66	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc GBP		104.333,480	GBP	1,000	104.333,48	0,73705	141.555,50	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,73705	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc JPY		2.811.791,000	JPY	1,000	2.811.791,00	130,67645	21.517,20	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	132,35946	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc NOK		2.433,500	NOK	1,000	2.433,50	9,61525	253,09	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,61525	8,76813	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc SEK		1.326.013,230	SEK	1,000	1.326.013,23	9,15815	144.790,51	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,15815	9,35753	-	-
CARIPARMA ORIZ 20 DUEMME cc USD		12.957,230	USD	1,000	12.957,23	1,08630	11.927,86	-	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,09626	-	-
Totale LG - Depositi Bancari							1.180.730,89														
Forward su cambi vendita EUR, acquisto CHF	FWDCAMEURCHF	126,600	EUR	1,000	126,60	1,00000	126,60	-	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-
Totale LG - Forward su cambi							126,60														
S&P500 EMINI FUT Mar16	ESH6 Index	14,000	USD	2,035,400	28.304,58	1,08630	26.055,95	-	15.465,34	-	11.727,88	38.428,22	1.311.589,80	Futures	1,994,965	1,994,965	1,10275	1,10275	-	-	Index
S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	PTH6 Index	2,000	CAD	760,900	4.768,00	1,50895	3.159,81	-	-	-	2.968,95	5.174,46	201.703,17	Futures	748,980	748,980	1,51615	1,51615	-	-	Index
OMXS30 IND FUTURE Jan16	QCF6 Index	10,000	SEK	1.448,000	35.500,00	9,15815	3.876,33	-	1.992,76	-	1.501,39	3.876,33	158.110,54	Futures	1.412,500	1.412,500	9,28175	9,28175	-	-	Index
SWISS MKT IX FUTR Mar16	SMH6 Index	11,000	CHF	8.746,000	37.730,00	1,08740	34.697,44	-	15.173,81	-	4.653,30	34.697,44	884.734,23	Futures	8.403,000	8.403,000	1,08165	1,08165	-	-	Index
EURO STOXX 50 Mar16	VGH6 Index	45,000	EUR	3.282,000	22.785,18	1,00000	22.785,18	-	-	-	-	22.785,18	1.476.900,00	Futures	3.231,366	3.231,366	1,00000	1,00000	-	-	Index
SPI 200 FUTURES Mar16	XPH6 Index	2,000	AUD	5.257,000	15.850,00	1,49305	10.615,85	-	4.554,44	-	-	11.720,97	176.049,03	Futures	4.940,000	4.940,000	1,52325	1,52325	-	-	Index
FTSE 100 IDX FUT Mar16	Z H6 Index	18,000	GBP	6.198,000	48.240,00	0,73705	65.450,11	-	10.012,89	-	6.593,85	72.288,18	1.513.655,79	Futures	5.930,000	5.930,000	0,72580	0,72580	-	-	Index
Totale LG - Futures							166.640,67		47.199,24		27.445,37	188.970,78	5.722.742,56								
ASSICURAZIONI GENERALI	IT0000062072	1.904,000	EUR	16,920	32.215,68	1,00000	32.215,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,920	16,580	1,00000	1,00000	-	-	Equity
UNIPOLSAI SPA	IT0004827447	14.089,000	EUR	2,360	33.250,04	1,00000	33.250,04	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,360	2,334	1,00000	1,00000	-	-	Equity
Totale LG - TCapitale Q IT							65.465,72														
SCHLUMBERGER LTD	AN8068571086	145,000	USD	69,750	10.113,75	1,08630	9.310,27	-	-	66,74	-	-	-	Azioni	69,750	82,690	1,08630	1,17983	-	-	Equity
GARMIN LTD	CH0114405324	707,000	USD	37,170	26.279,19	1,08630	24.191,47	-	-	-	-	-	-	Azioni	37,170	37,876	1,08630	1,06935	-	-	Equity
NIELSEN HOLDINGS PLC	G800BWFV5505	231,000	USD	46,600	10.764,60	1,08630	9.909,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,600	45,837	1,08630	1,12502	-	-	Equity
AININ SEIKI CO LTD	JP3102000001	300,000	JPY	5.240,000	1.572.000,00	130,67645	12.029,71	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.240,000	5.634,915	130,67645	138,67305	-	-	Equity
SMC CORP	JP3162600005	100,000	JPY	31.770,000	3.177.000,00	130,67645	24.311,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	31.770,000	23.335,000	130,67645	141,25095	-	-	Equity
NTT DATA CORP	JP3165700000	200,000	JPY	5.880,000	1.176.000,00	130,67645	8.999,33	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.880,000	5.376,525	130,67645	135,93015	-	-	Equity
OTSUKA CORP	JP3188200004	300,000	JPY	5.960,000	1.788.000,00	130,67645	13.682,65	-	-	184,69	-	-	-	Azioni	5.960,000	4.736,768	130,67645	135,11480	-	-	Equity
KAJIMA CORP	JP3210200006	3.000,000	JPY	724,000	2.172.000,00	130,67645	16.621,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	724,000	575,120	130,67645	138,67305	-	-	Equity
KOITO MANUFACTURING CO LTD	JP3284600008	500,000	JPY	5.010,000	2.505.000,00	130,67645	19.169,48	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.010,000	4.369,900	130,67645	135,60815	-	-	Equity
JTEKT CORP	JP3292200007	900,000	JPY	2.005,000	1.804.500,00	130,67645	13.808,92	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.005,000	2.272,320	130,67645	131,48575	-	-	Equity
KONAMI HOLDINGS CORP	JP3300200007	600,000	JPY	2.888,000	1.732.800,00	130,67645	13.260,23	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.888,000	2.002,734	130,67645	136,95475	-	-	Equity
CRYBERDYNE INC	JP3311530004	600,000	JPY	2.046,000	1.227.600,00	130,67645	9.394,19	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.046,000	1.594,622	130,67645	139,29522	-	-	Equity
NIPPON STEEL & SUMITOMO META	JP3381000003	300,000	JPY	2.416,000	724.800,00	130,67645	5.346,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.416,000	553,019	130,67645	140,22522	-	-	Equity
NIFE HOLDINGS INC	JP3398030005	600,000	JPY	1.920,000	1.152.000,00	130,67645	8.546,51	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.920,000	2.147,983	130,67645	135,53115	-	-	Equity
SONY CORP	JP3435000009	400,000	JPY	3.002,000	1.200.800,00	130,67645	9.189,11	-	-	-	-	-	-	Azioni	3.002,000	3.096,920	130,67645	135,53115	-	-	Equity
DAI-ICHI LIFE INSURANCE	JP3478480003	1.000,000	JPY	2.035,000	2.035.000,00	130,67645	15.572,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.035,000	2.134,120	130,67645	132,90610	-	-	Equity
DAIKIN INDUSTRIES LTD	JP3481800005	100,000	JPY	8.901,000	890.100,00	130,67645	6.811,48	-	-	-	-	-	-	Azioni	8.901,000	8.051,608	130,67645	136,95475	-	-	Equity
DAIFUKU CO LTD	JP3497400006	900,000	JPY	2.075,000	1.867.500,00	130,67645	14.291,02	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.075,000	1.292,145	130,67645	139,29520	-	-	Equity
DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	JP3505000004	700,000	JPY	3.503,000	2.452.100,00	130,67645	18.764,67	-	-	-	-	-	-	Azioni	3.503,000	3.106,140	130,67645	135,60815	-	-	Equity
DENSO CORP	JP3551500006	400,000	JPY	5.818,000	2.327.200,00	130,67645	17.808,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.818,000	5.602,860	130,67645	135,60815	-	-	Equity
NISSAN MOTOR CO LTD	JP3672400003	1.100,000	JPY	1.279,500	1.407.450,00	130,67645	10.770,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.279,500	1.050,107	130,67645	139,29520	-	-	Equity
JAPAN STEEL WORKS LTD	JP3721400004	4.000,000	JPY	427,000	1.708.000,00	130,67645	13.070,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	427,000	405,265	130,67645	135,84226	-	-	Equity
NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	JP3762800005	220,000	JPY	4.670,000	1.027.400,00	130,67645	7.862,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	4.670,000	3.240,091	130,67645	141,40308	-	-	Equity
HITACHI LTD	JP3786600009	3.000,000	JPY	691,500	2.074.500,00	130,67645	15.875,09	-	-	-	-	-	-	Azioni	691,500	728,040	130,67645	131,48575	-	-	Equity
FUJITSU LTD	JP3818000006	2.000,000	JPY	606,900	1.213.800,00	130,67645	9.288,59	-	-	-	-	-	-	Azioni	606,900	584,610	130,67645	135,53115	-	-	Equity
MAZDA MOTOR CORP	JP3868400007	400,000	JPY	2.524,000	1.009.600,00	130															

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_di_visa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_blm	duration	den_categoria_strumento
DELTA AIR LINES INC	US2473617023	489.000	USD	50,690	24.787,41	1,08630	22.818,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	50,690	43,223	1,08630	1,12712	-	-	Equity
DOLLAR TREE INC	US2567461080	331.000	USD	77,220	25.559,82	1,08630	23.529,25	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,220	63,237	1,08630	1,18292	-	-	Equity
DUKE ENERGY CORP	US26441C2044	168.000	USD	71,390	11.993,52	1,08630	11.040,71	-	-	-	-	-	-	Azioni	71,390	75,166	1,08630	1,13161	-	-	Equity
ENTERGY CORP	US29364G1031	365.000	USD	68,360	24.951,40	1,08630	22.969,16	-	-	-	-	-	-	Azioni	68,360	64,031	1,08630	1,12955	-	-	Equity
EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	160.000	USD	77,950	12.472,00	1,08630	11.481,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,950	82,156	1,08630	1,06935	-	-	Equity
FACEBOOK INC-A	US30303M1027	114.000	USD	104,660	11.931,24	1,08630	10.983,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	104,660	63,506	1,08630	1,36150	-	-	Equity
FIFTH THIRD BANCORP	US3167731005	578.000	USD	20,100	11.617,80	1,08630	10.694,84	-	-	58,80	-	-	-	Azioni	20,100	19,982	1,08630	1,12955	-	-	Equity
FORUM MOTOR CO	US3453708600	1.664.000	USD	14,090	23.445,76	1,08630	21.583,14	-	-	-	-	-	-	Azioni	14,090	15,376	1,08630	1,10479	-	-	Equity
FRANKLIN RESOURCES INC	US3546131018	270.000	USD	36,820	9.941,40	1,08630	9.151,62	-	-	38,03	-	-	-	Azioni	36,820	46,526	1,08630	1,23643	-	-	Equity
GAP INC/THE	US3647601083	329.000	USD	24,700	8.126,30	1,08630	7.480,71	-	-	-	-	-	-	Azioni	24,700	37,294	1,08630	1,20890	-	-	Equity
GENERAL MOTORS CO	US37045V1008	311.000	USD	34,010	12.685,73	1,08630	11.677,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,010	32,139	1,08630	1,17053	-	-	Equity
HALLIBURTON CO	US4062161017	311.000	USD	34,040	10.586,44	1,08630	9.745,41	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,040	32,282	1,08630	1,12955	-	-	Equity
HERSHEY CO/THE	US4278661081	254.000	USD	89,270	22.674,58	1,08630	20.873,22	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,270	93,033	1,08630	1,12955	-	-	Equity
HESS CORP	US42809H1077	203.000	USD	48,480	9.841,44	1,08630	9.059,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	48,480	54,076	1,08630	1,13304	-	-	Equity
HOME DEPOT INC	US4370761029	200.000	USD	132,250	26.450,00	1,08630	24.348,71	-	-	-	-	-	-	Azioni	132,250	116,527	1,08630	1,12955	-	-	Equity
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	US4385161066	116.000	USD	103,570	12.014,12	1,08630	11.059,67	-	-	-	-	-	-	Azioni	103,570	100,751	1,08630	1,12955	-	-	Equity
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	US45866F1049	49.000	USD	256,260	12.556,74	1,08630	11.559,18	-	-	-	-	-	-	Azioni	256,260	230,215	1,08630	1,12227	-	-	Equity
KEYCORP	US4932671088	843.000	USD	13,190	11.119,17	1,08630	10.235,82	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,190	13,381	1,08630	1,24844	-	-	Equity
KIMBERLY-CLARK CORP	US4943681035	102.000	USD	127,300	12.984,60	1,08630	11.953,05	-	-	70,24	-	-	-	Azioni	127,300	109,984	1,08630	1,18297	-	-	Equity
KOHL'S CORP	US5002551043	469.000	USD	47,630	22.338,47	1,08630	20.563,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	47,630	48,139	1,08630	1,09370	-	-	Equity
KROGER CO	US5010441013	282.000	USD	41,830	11.796,06	1,08630	10.858,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,830	18,910	1,08630	1,19446	-	-	Equity
LAM RESEARCH CORP	US5128071082	341.000	USD	79,420	27.082,22	1,08630	24.930,70	-	-	80,05	-	-	-	Azioni	79,420	76,846	1,08630	1,06935	-	-	Equity
LEGG MASON INC	US5249011058	341.000	USD	39,230	13.377,43	1,08630	12.314,67	-	-	53,36	-	-	-	Azioni	39,230	43,442	1,08630	1,12630	-	-	Equity
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	US52729N3089	519.000	USD	54,360	28.212,84	1,08630	25.971,50	-	-	-	-	-	-	Azioni	54,360	50,812	1,08630	1,06935	-	-	Equity
ELI LILLY & CO	US5324571083	280.000	USD	84,260	23.592,80	1,08630	21.718,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	84,260	85,803	1,08630	1,10880	-	-	Equity
LOCKHEED MARTIN CORP	US5398301094	51.000	USD	217,150	11.074,65	1,08630	10.194,84	-	-	-	-	-	-	Azioni	217,150	124,575	1,08630	1,33600	-	-	Equity
MACERICH CO/THE	US5543821012	154.000	USD	80,690	12.426,26	1,08630	11.439,07	-	-	482,00	-	-	-	Azioni	80,690	76,014	1,08630	1,12955	-	-	Equity
MASTERCARD INC-CLASS A	US57636Q1040	155.000	USD	97,360	15.090,80	1,08630	13.891,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	97,360	94,453	1,08630	1,12630	-	-	Equity
MICRON TECHNOLOGY INC	US5951121038	634.000	USD	14,160	8.977,44	1,08630	8.264,24	-	-	-	-	-	-	Azioni	14,160	13,636	1,08630	1,13971	-	-	Equity
NORTHROP GRUMMAN CORP	US6688071029	118.000	USD	188,810	22.279,58	1,08630	20.509,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	188,810	187,378	1,08630	1,09370	-	-	Equity
OREILLY AUTOMOTIVE INC	US67103H1077	97.000	USD	253,420	24.581,74	1,08630	22.628,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	253,420	272,624	1,08630	1,06935	-	-	Equity
PPG INDUSTRIES INC	US6935061076	112.000	USD	98,820	11.067,84	1,08630	10.188,57	-	-	-	-	-	-	Azioni	98,820	97,722	1,08630	1,25247	-	-	Equity
PARKER HANNIFIN CORP	US7010941042	226.000	USD	96,980	21.917,48	1,08630	20.176,27	-	-	-	-	-	-	Azioni	96,980	98,240	1,08630	1,09370	-	-	Equity
PAYCHEX INC	US7043261079	602.000	USD	52,890	31.839,78	1,08630	29.310,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	52,890	48,936	1,08630	1,12630	-	-	Equity
T ROWE PRICE GROUP INC	US74144T1088	302.000	USD	71,490	21.589,98	1,08630	19.874,79	-	-	-	-	-	-	Azioni	71,490	73,644	1,08630	1,09370	-	-	Equity
PUBLIC STORAGE	US74460D1090	52.000	USD	247,700	12.880,40	1,08630	11.857,13	-	-	-	-	-	-	Azioni	247,700	183,728	1,08630	1,24091	-	-	Equity
QUEST DIAGNOSTICS INC	US74834L1008	347.000	USD	71,140	24.685,58	1,08630	22.724,46	-	-	-	-	-	-	Azioni	71,140	67,614	1,08630	1,12955	-	-	Equity
REPUBLIC SERVICES INC	US7607591002	503.000	USD	43,990	22.126,97	1,08630	20.369,12	-	-	118,08	-	-	-	Azioni	43,990	44,211	1,08630	1,09370	-	-	Equity
REYNOLDS AMERICAN INC	US7617131062	327.000	USD	46,150	15.091,05	1,08630	13.892,16	-	-	92,11	-	-	-	Azioni	46,150	45,234	1,08630	1,12630	-	-	Equity
SOUTHWEST AIRLINES CO	US8447411088	497.000	USD	43,060	21.400,82	1,08630	19.700,65	-	-	-	-	-	-	Azioni	43,060	45,145	1,08630	1,09370	-	-	Equity
SPECTRA ENERGY CORP	US8475601097	925.000	USD	23,940	22.144,50	1,08630	20.385,25	-	-	-	-	-	-	Azioni	23,940	24,103	1,08630	1,09370	-	-	Equity
STAINLESS CORP	US8552441084	198.000	USD	60,030	11.285,64	1,08630	10.389,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	60,030	39,525	1,08630	1,32088	-	-	Equity
GM CO	US85679Y1010	75.000	USD	150,640	11.200,44	1,08630	10.400,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	150,640	140,782	1,08630	1,06989	-	-	Equity
TIME WARNER CABLE	US88732J2078	56.000	USD	185,590	10.383,04	1,08630	9.567,38	-	-	32,86	-	-	-	Azioni	185,590	91,476	1,08630	1,27174	-	-	Equity
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	US90130A2006	765.000	USD	27,230	20.830,95	1,08630	19.176,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	27,230	29,086	1,08630	1,09370	-	-	Equity
UNITEDHEALTH GROUP INC	US91324P1021	192.000	USD	117,640	22.586,88	1,08630	20.792,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	117,640	115,907	1,08630	1,09370	-	-	Equity
VENTAS INC	US92276F1003	217.000	USD	56,430	12.245,31	1,08630	11.272,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	56,430	54,561	1,08630	1,12955	-	-	Equity
VERIZON COMMUNICATIONS INC	US92343V1044	580.000	USD	46,220	26.807,60	1,08630	24.677,90	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,220	45,135	1,08630	1,06935	-	-	Equity
VIACOM INC-CLASS B	US92553P2011	506.000	USD	41,160	20.826,96	1,08630	19.172,38	-	-	158,37	-	-	-	Azioni	41,160	44,317	1,08630	1,09370	-	-	Equity
WELLS FARGO & CO	US9497461015	474.000	USD	54,360	25.766,64	1,08630	23.719,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	54,360	55,569	1,08630	1,06935	-	-	Equity
YUM BRANDS INC	US9884981013	130.000	USD	73,050	9.496,50	1,08630	8.742,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	73,050	78,357	1,08630	1,18933	-	-	Equity
Totale LG - TCapitale Q OCSE							1.702.020,47				2.114,88										
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	AT0000606306	1.379.000	EUR	13,605	18.761,30	1,00000	18.761,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,605	17,243	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SOLVAY SA	BE0003470755	381.000	EUR	98,430	37.501,83	1,00000	37.501,83	-	-	-	-	-	-	Azioni	98,430	101,471	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	DE																				

den strumento finanziario	cod isin	imp_nominale_tot_ale	cod_di_visa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_blm	duration	den_categoria_strumento
MEDIOBANCA 11/10/2016 4.625	XS0615801742	100.000.000	EUR	103,330	103.330,00	1,00000	103.330,00	1.023,57	-	-	-	-	-	Obbligazioni	103,330	103,959	1,00000	1,00000	AAA-	0,78	Corp
Totale LG - T-Debito Q IT							423.520,80	2.509,23													
MICROSOFIT CORP 12/02/2055 4	US954918BE30	200.000.000	USD	90,879	181.758,00	1,08630	167.318,42	2.823,04	-	-	-	-	-	Obbligazioni	90,879	97,342	1,08630	1,13615	AA+	19,14	Corp
GENERAL ELEC CAP CORP 30/01/2043 4.625	X5080289292	200.000.000	USD	100,097	200.194,00	1,08630	184.289,79	3.547,98	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,097	98,950	1,08630	1,09395	AA-	15,64	Corp
JPMORGAN CHASE & CO 03/05/2016 FLOATING	X50926823070	200.000.000	EUR	100,084	200.168,00	1,00000	200.168,00	90,87	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,084	100,292	1,00000	1,00000	A-	0,50	Corp
NATIONAL AUSTRALIA BANK 19/07/2016 FLOATING	X509540266661	300.000.000	EUR	100,112	300.336,00	1,00000	300.336,00	150,87	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,112	100,096	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
JPMORGAN CHASE & CO 19/07/2017 FLOATING	X51034975588	1.000.000.000	EUR	100,214	1.002.140,00	1,00000	1.002.140,00	359,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,214	100,215	1,00000	1,00000	A-	0,50	Corp
Totale LG - T-Debito Q OCSE							1.854.252,21	6.972,09													
LANDWIRTSCH. RENTENBANK 27/01/2016 6	AU3CB0188789	170.000.000	AUD	100,208	170.353,60	1,49305	114.097,72	2.914,59	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,208	103,004	1,49305	1,38330	AAA	0,07	Corp
GE CAPITAL INTL FUNDING 15/04/2016. 364	US36164PFES1	448.000.000	USD	100,042	448.188,16	1,08630	412.582,31	706,78	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,042	101,491	1,08630	1,10485	AA-	0,29	Corp
KFW 14/03/2026 2.05	US5007698N36	19.500.000.000	JPY	119,264	23.256.480,00	1,08630	177.969,94	1.148,20	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,264	95,350	130,67645	127,55510	AAA	9,24	Corp
KFW 14/03/2016 5.125	US5007698P83	700.000.000	USD	100,885	706.195,00	1,08630	650.092,06	9.724,01	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,885	104,255	1,08630	1,07415	AAA	0,21	Corp
GE CAPITAL EURO FUNDING 22/02/2016 FLOATING	X50245166367	80.000.000	EUR	100,016	80.012,80	1,00000	80.012,80	4,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,016	98,300	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
KFW 07/09/2016 3.75	X50433107041	1.350.000.000	GBP	102,194	1.379.619,00	0,73705	1.871.811,95	21.681,66	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,194	102,652	0,73705	0,72712	AAA	0,69	Corp
BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 20/01/2016 3	X50577454951	120.000.000	CAD	100,082	120.098,40	1,50895	79.590,71	2.255,04	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,082	98,619	1,50895	1,35720	AA+	0,05	Corp
LANDWIRTSCH. RENTENBANK 07/12/2016 3.25	X50587975961	150.000.000	GBP	102,432	153.648,00	0,73705	208.463,47	433,72	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,432	103,405	0,73705	0,70980	AAA	0,94	Corp
KFW 05/07/2016 7.5	X50800582339	250.000.000	USD	99,986	249.965,00	1,08630	230.106,78	839,05	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,986	100,120	1,08630	1,07315	AAA	0,52	Corp
Totale LG - T-Debito Q UE							3.824.727,74	39.607,95													
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2029 5.25	IT0001278511	170.000.000	EUR	138,728	235.837,77	1,00000	235.837,77	1.471,15	-	-	-	-	-	Obbligazioni	138,728	134,329	1,00000	1,00000	NR	10,60	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2034 5	IT0003535157	500.000	EUR	140,034	700,17	1,00000	700,17	10,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	140,034	99,250	1,00000	1,00000	NR	13,20	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2017 4	IT0004164775	550.000.000	EUR	104,339	573.862,30	1,00000	573.862,30	9.086,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,339	106,136	1,00000	1,00000	NR	1,06	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2021 3.75	IT0004634132	200.000.000	EUR	115,447	230.893,00	1,00000	230.893,00	2.493,13	-	-	-	-	-	Obbligazioni	115,447	110,786	1,00000	1,00000	NR	4,73	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2016 2.1	IT0004682107	1.860.000.000	EUR	108,717	2.022.143,94	1,00000	2.022.143,94	12.307,13	-	-	-	-	-	Obbligazioni	108,717	109,827	1,00000	1,00000	NR	0,70	Govt
CCTS EU 15/04/2018 FLOATING	IT0004716319	700.000.000	EUR	102,056	714.388,50	1,00000	714.388,50	1.536,15	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,056	102,444	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 26/03/2016 2.45	IT0004806888	900.000.000	EUR	100,546	904.910,18	1,00000	904.910,18	5.814,11	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,546	103,355	1,00000	1,00000	NR	0,24	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2022 5.5	IT0004848831	820.000.000	EUR	128,911	1.057.069,38	1,00000	1.057.069,38	7.434,07	-	-	-	-	-	Obbligazioni	128,911	107,406	1,00000	1,00000	NR	5,90	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 22/10/2016 2.55	IT0004863608	490.000.000	EUR	101,915	499.383,47	1,00000	499.383,47	2.386,60	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,915	100,000	1,00000	1,00000	NR	0,80	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2028 4.75	IT0004889033	270.000.000	EUR	131,762	355.758,21	1,00000	355.758,21	4.263,26	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,762	113,965	1,00000	1,00000	NR	10,00	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/05/2023 4.5	IT0004898034	700.000.000	EUR	123,359	863.513,00	1,00000	863.513,00	5.192,31	-	-	-	-	-	Obbligazioni	123,359	97,290	1,00000	1,00000	NR	6,41	Govt
CCTS EU 01/11/2018 FLOATING	IT0004922909	250.000.000	EUR	104,702	261.753,75	1,00000	261.753,75	751,67	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,702	105,094	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
CERT DI CREDITO DEL TES 27/02/2017 ZERO COUPON	IT0005089955	350.000.000	EUR	100,043	350.151,20	1,00000	350.151,20	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,043	99,900	1,00000	1,00000	NR	1,16	Govt
CCTS EU 15/06/2022 FLOATING	IT0005104473	50.000.000	EUR	100,749	50.374,70	1,00000	50.374,70	11,38	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,749	99,257	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
ITALY GOVT INT BOND 15/06/2033 5.375	US465410BG26	112.000.000	USD	114,050	127.736,00	1,08630	117.588,14	230,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	114,050	101,335	1,08630	1,41445	NR	12,10	Govt
ITALY GOVT INT BOND 14/11/2016 3.7	X50070731194	50.000.000.000	JPY	102,939	51.469.500,00	1,08630	393.869,74	1.808,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,939	106,220	130,67645	136,95475	BBB	0,89	Govt
Totale LG - T-Stato Org.Int Q IT							8.632.197,45	54.798,11													
EXPORT DEVELOPMNT CANADA 18/02/2016 6	AU3CB0170009	100.000.000	AUD	100,417	100.417,00	1,49305	67.256,29	1.474,22	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,417	102,280	1,49305	1,47260	AAA	0,13	Govt
CANADIAN GOVERNMENT 01/08/2016 1	CA135087B295	100.000.000	CAD	100,302	100.302,00	1,50895	66.471,39	273,73	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,302	100,547	1,50895	1,43735	AAA	0,58	Govt
INTL BK RECON & DEVELOP 15/02/2035 4.75	US48905CAA27	250.000.000	USD	122,391	305.977,50	1,08630	281.669,43	4.099,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	122,391	97,578	1,08630	1,36040	AAA	13,45	Corp
TSY INFL IX NIB 15/01/2029 2.5	US912810P257	200.000.000	USD	131,407	262.814,52	1,08630	241.935,49	2.341,62	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,407	115,180	1,08630	1,36040	AAA	11,40	Govt
Totale LG - T-Stato Org.Int Q OCSE							657.332,60	8.188,93													
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/01/2037 4	DE0001135275	75.000.000	EUR	148,460	111.345,00	1,00000	111.345,00	2.967,12	-	-	-	-	-	Obbligazioni	148,460	171,150	1,00000	1,00000	NR	15,46	Govt
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/07/2039 4.25	DE0001135235	40.000.000	EUR	157,420	62.968,00	1,00000	62.968,00	836,07	-	-	-	-	-	Obbligazioni	157,420	137,030	1,00000	1,00000	NR	16,89	Govt
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/01/2018 4	DE0001136341	3.000.000	EUR	108,725	3.261,75	1,00000	3.261,75	118,68	-	-	-	-	-	Obbligazioni	108,725	108,365	1,00000	1,00000	NR	1,91	Govt
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 30/07/2018 4.1	ES00000121A5	500.000.000	EUR	110,100	550.500,00	1,00000	550.500,00	8.625,68	-	-	-	-	-	Obbligazioni	110,100	110,834	1,00000	1,00000	BBB+	2,47	Govt
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 30/04/2017 2.1	ES00000124I2	100.000.000	EUR	102,783	102.783,00	1,00000	102.783,00	1.405,74	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,783	103,520	1,00000	1,00000	BBB+	1,31	Govt
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 31/10/2017 5	ES00000126V0	290.000.000	EUR	100,910	292.639,00	1,00000	292.639,00	241,67	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,910	100,578	1,00000	1,00000	BBB+	1,83	Govt
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 30/04/2018 2.25	ES00000127D6	1.200.000.000	EUR	100,263	1.203.156,00	1,00000	1.203.156,00	1.795,08	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,263	100,178	1,00000	1,00000	BBB	2,32	Govt
EFSE 05/07/2021 3.375	EU000A1G0AB2	780.000.000	EUR	117,610	917.358,00	1,00000	917.358,00	12.874,80	-	-	-	-	-	Obbligazioni	117,610	109,665	1,00000	1,00000	AA	5,09	Corp
EFSE 0																					

Dividendi Pending														
<i>den_portafoglio_op</i>	<i>den_sezio</i> <i>ne</i>	<i>cod_isin</i>	<i>den_strumento_finanziario</i>	<i>cod</i> <i>divis</i> <i>a</i>	<i>data_operazio</i> <i>ne</i>	<i>data_valuta</i>	<i>data_banca</i>	<i>data_contabiliz</i> <i>zazione</i>	<i>imp_valore</i> <i>nominale</i>	<i>imp_prezzo_lor</i> <i>do</i>	<i>imp_prezzo_ne</i> <i>tto</i>	<i>tasso_cambio</i>	<i>tasso_cambio_</i> <i>banca</i>	<i>imp_valore_pe</i> <i>nding_lc</i>
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3188220002	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	200,00	42,342500	42,342500	131,992600	131,992600	64,81
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3205800000	KAO CORP	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	100,00	32,180300	32,180300	131,992600	131,992600	24,63
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3351600006	SHISEIDO CO LTD	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	300,00	8,468500	8,468500	131,992600	131,992600	19,44
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3726800000	JAPAN TOBACCO INC	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	200,00	54,198400	54,198400	131,992600	131,992600	82,95
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	200,00	50,811000	50,811000	131,992600	131,992600	77,76
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3942800008	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	200,00	18,630700	18,630700	131,992600	131,992600	28,51
ANIMA / sottotpf	Azioni	US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	USD	22/12/2015	11/01/2016	11/01/2016	22/12/2015	135,00	0,480250	0,480250	1,096650	1,096650	59,68
ANIMA / sottotpf	Azioni	US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	30/12/2015	01/02/2016	01/02/2016	30/12/2015	201,00	0,323000	0,323000	1,091350	1,091350	59,76
ANIMA / sottotpf	Azioni	US2358511028	DANAHER CORP	USD	17/12/2015	29/01/2016	29/01/2016	17/12/2015	103,00	0,114750	0,114750	1,083400	1,083400	10,88
ANIMA / sottotpf	Azioni	US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	USD	10/12/2015	11/01/2016	11/01/2016	10/12/2015	464,00	0,603500	0,603500	1,093700	1,093700	257,77
ANIMA / sottotpf	Azioni	US2605431038	DOW CHEMICAL CO/THE	USD	29/12/2015	29/01/2016	29/01/2016	29/12/2015	457,00	0,391000	0,391000	1,090600	1,090600	164,49
ANIMA / sottotpf	Azioni	US3696041033	GENERAL ELECTRIC CO	USD	17/12/2015	25/01/2016	25/01/2016	17/12/2015	2.987,00	0,195500	0,195500	1,083400	1,083400	537,57
ANIMA / sottotpf	Azioni	US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	USD	07/12/2015	06/01/2016	06/01/2016	07/12/2015	897,00	0,046750	0,046750	1,085250	1,085250	38,60
ANIMA / sottotpf	Azioni	US4783661071	JOHNSON CONTROLS INC	USD	09/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	09/12/2015	212,00	0,246500	0,246500	1,096250	1,096250	48,11
ANIMA / sottotpf	Azioni	US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	USD	11/12/2015	08/01/2016	08/01/2016	11/12/2015	780,00	0,391000	0,391000	1,099700	1,099700	280,75
ANIMA / sottotpf	Azioni	US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	USD	29/12/2015	14/01/2016	14/01/2016	29/12/2015	456,00	0,144500	0,144500	1,090600	1,090600	60,66
ANIMA / sottotpf	Azioni	US6541061031	NIKE INC -CL B	USD	07/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	07/12/2015	159,00	0,272000	0,272000	1,085250	1,085250	39,81
ANIMA / sottotpf	Azioni	US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	USD	08/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	08/12/2015	246,00	0,637500	0,637500	1,087100	1,087100	144,36
ANIMA / sottotpf	Azioni	US7134481081	PEPSICO INC	USD	02/12/2015	07/01/2016	07/01/2016	02/12/2015	199,00	0,597125	0,597125	1,057300	1,057300	109,39
ANIMA / sottotpf	Azioni	US7181721090	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	USD	21/12/2015	08/01/2016	08/01/2016	21/12/2015	180,00	0,867000	0,867000	1,091750	1,091750	143,66
ANIMA / sottotpf	Azioni	US8574771031	STATE STREET CORP	USD	30/12/2015	19/01/2016	19/01/2016	30/12/2015	217,00	0,289000	0,289000	1,091350	1,091350	57,73
ANIMA / sottotpf	Azioni	FR0000120271	TOTAL SA	EUR	21/12/2015	14/01/2016	14/01/2016	21/12/2015	1.055,00	0,427000	0,427000	1,000000	1,000000	450,49
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	12/11/2015	14/01/2016	14/01/2016	12/11/2015	3.415,00	0,190000	0,190000	0,707800	0,707800	880,33
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB0009697037	BABCOCK INTL GROUP PLC	GBP	10/12/2015	14/01/2016	14/01/2016	10/12/2015	1.876,00	0,060500	0,060500	0,721300	0,721300	153,99
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB0030913577	BT GROUP PLC	GBP	24/12/2015	08/02/2016	08/02/2016	24/12/2015	6.673,00	0,044000	0,044000	0,733500	0,733500	398,36
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB00B0N8QD54	BRITVIC PLC	GBP	03/12/2015	05/02/2016	05/02/2016	03/12/2015	3.134,00	0,163000	0,163000	0,721600	0,721600	693,09
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB00B4Y7R145	DIXONS CARPHONE PLC	GBP	31/12/2015	22/01/2016	22/01/2016	31/12/2015	4.963,00	0,032500	0,032500	0,737050	0,737050	218,85
ANIMA / sottotpf	Azioni	GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	GBP	19/11/2015	03/02/2016	03/02/2016	19/11/2015	27.009,00	0,036800	0,036800	0,702000	0,702000	1.348,52
ANIMA / sottotpf	Azioni	IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	USD	22/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	22/12/2015	363,00	0,304000	0,304000	1,096650	1,096650	101,58
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - ANIMA / sottotpf														
6.556,53														
DUEMME / sottotpf	Azioni	AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	USD	30/11/2015	08/01/2016	08/01/2016	30/11/2015	145,00	0,500000	0,500000	1,056150	1,056150	66,74
DUEMME / sottotpf	Azioni	JP3188200004	OTSUKA CORP	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	300,00	80,450750	80,450750	131,992600	131,992600	184,69
DUEMME / sottotpf	Azioni	JP3924800000	DMG MORI CO LTD	JPY	28/12/2015	28/03/2016	28/03/2016	28/12/2015	800,00	11,009050	11,009050	131,992600	131,992600	67,40
DUEMME / sottotpf	Azioni	US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	USD	22/12/2015	08/01/2016	08/01/2016	22/12/2015	134,00	0,051000	0,051000	1,096650	1,096650	6,29
DUEMME / sottotpf	Azioni	US0534841012	AVALONBAY COMMUNITIES INC	USD	29/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	29/12/2015	154,00	1,062500	1,062500	1,090600	1,090600	150,63
DUEMME / sottotpf	Azioni	US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	30/12/2015	01/02/2016	01/02/2016	30/12/2015	194,00	0,323000	0,323000	1,091350	1,091350	57,68
DUEMME / sottotpf	Azioni	US1248572026	CBS CORP-CLASS B NON VOTING	USD	09/12/2015	01/01/2016	01/01/2016	09/12/2015	352,00	0,127500	0,127500	1,096250	1,096250	41,31
DUEMME / sottotpf	Azioni	US12572Q1058	CME GROUP INC	USD	23/12/2015	12/01/2016	12/01/2016	23/12/2015	122,00	2,465000	2,465000	1,087950	1,087950	276,84
DUEMME / sottotpf	Azioni	US2333311072	DTE ENERGY COMPANY	USD	17/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	17/12/2015	139,00	0,620500	0,620500	1,083400	1,083400	79,40
DUEMME / sottotpf	Azioni	US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	USD	29/12/2015	21/01/2016	21/01/2016	29/12/2015	578,00	0,110500	0,110500	1,090600	1,090600	58,80
DUEMME / sottotpf	Azioni	US3546131018	FRANKLIN RESOURCES INC	USD	24/12/2015	13/01/2016	13/01/2016	24/12/2015	270,00	0,153000	0,153000	1,095850	1,095850	38,03
DUEMME / sottotpf	Azioni	US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	USD	02/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	02/12/2015	102,00	0,748000	0,748000	1,057300	1,057300	70,24
DUEMME / sottotpf	Azioni	US5128071082	LAM RESEARCH CORP	USD	07/12/2015	06/01/2016	06/01/2016	07/12/2015	341,00	0,255000	0,255000	1,085250	1,085250	80,05
DUEMME / sottotpf	Azioni	US5249011058	LEGG MASON INC	USD	14/12/2015	11/01/2016	11/01/2016	14/12/2015	341,00	0,170000	0,170000	1,102750	1,102750	53,36
DUEMME / sottotpf	Azioni	US5543821012	MACERICH CO/THE	USD	09/11/2015	06/01/2016	06/01/2016	09/11/2015	308,00	1,700000	1,700000	1,074500	1,074500	482,00
DUEMME / sottotpf	Azioni	US7607591002	REPUBLIC SERVICES INC	USD	30/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	30/12/2015	503,00	0,255000	0,255000	1,091350	1,091350	118,08
DUEMME / sottotpf	Azioni	US7617131062	REYNOLDS AMERICAN INC	USD	10/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	10/12/2015	327,00	0,306000	0,306000	1,093700	1,093700	92,11
DUEMME / sottotpf	Azioni	US88732J2078	TIME WARNER CABLE	USD	30/12/2015	25/01/2016	25/01/2016	30/12/2015	56,00	0,637500	0,637500	1,091350	1,091350	32,86
DUEMME / sottotpf	Azioni	US92553P2011	VIACOM INC-CLASS B	USD	11/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	11/12/2015	506,00	0,340000	0,340000	1,099700	1,099700	158,37
DUEMME / sottotpf	Azioni	IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	USD	22/12/2015	15/01/2016	15/01/2016	22/12/2015	154,00	0,304000	0,304000	1,096650	1,096650	43,10
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - DUEMME / sottotpf														
2.157,98														
Vendite Pending														
<i>den_portafoglio_op</i>	<i>den_sezio</i> <i>ne</i>	<i>cod_isin</i>	<i>den_strumento_finanziario</i>	<i>cod</i> <i>divis</i> <i>a</i>	<i>data_operazio</i> <i>ne</i>	<i>data_valuta</i>	<i>data_banca</i>	<i>data_contabiliz</i> <i>zazione</i>	<i>imp_valore</i> <i>nominale</i>	<i>imp_prezzo_lor</i> <i>do</i>	<i>imp_prezzo_ne</i> <i>tto</i>	<i>tasso_cambio</i>	<i>tasso_cambio_</i> <i>banca</i>	<i>imp_valore_pe</i> <i>nding_lc</i>
AMUNDI / sottotpf	Obbligazion	IT0005106049	BUONI POLIENNALI DEL TES 15/05/2018	EUR	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	250.000,00	100,400000	100,400000	1,000000	1,000000	251.085,85
AMUNDI / sottotpf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.862,48	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	45.404,65
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - AMUNDI / sottotpf														
296.490,50														
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3351600006	SHISEIDO CO LTD	JPY	29/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	29/12/2015	300,00	2.470,270100	2.468,293433	131,395500	131,395500	5.666,58
ANIMA / sottotpf	Azioni	JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JPY	29/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	29/12/2015	200,00	6.606,088700	6.600,803700	131,395500	131,395500	10.102,52

den_portafoglio_op	den_sezio ne	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_ divis a	data_operazio ne	data_valuta	data_banca	data_contabiliz zazione	imp_valore_ nominale	imp_prezzo_lor do	imp_prezzo_ne tto	tasso_cambio	tasso_cambio_ banca	imp_valore_pe nding_lc
ANIMA / sottoptf	Azioni	US0378331005	APPLE INC	USD	29/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	29/12/2015	40,00	107,600000	107,535500	1,090600	1,090600	3.959,62
ANIMA / sottoptf	Azioni	US3696041033	GENERAL ELECTRIC CO	USD	29/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	29/12/2015	250,00	31,171800	31,153080	1,090600	1,090600	7.169,40
ANIMA / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.862,48	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	45.404,65
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - ANIMA / sottoptf														72.302,77
DUEMME / sottoptf	Futures	ESH6 Index	S&P500 EMINI FUT Mar16	USD	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	16.800,00	1,000000	1,000000	1,091350	1,091350	15.465,34
DUEMME / sottoptf	Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	18.250,00	1,000000	1,000000	9,196500	9,196500	1.992,76
DUEMME / sottoptf	Futures	SMH6 Index	SWISS MKT IX FUTR Mar16	CHF	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	16.500,00	1,000000	1,000000	1,080700	1,080700	15.173,81
DUEMME / sottoptf	Futures	XPH6 Index	SPI 200 FUTURES Mar16	AUD	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	4.750,00	1,000000	1,000000	1,496550	1,496550	3.181,41
DUEMME / sottoptf	Futures	XPH6 Index	SPI 200 FUTURES Mar16	AUD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	2.050,00	1,000000	1,000000	1,493050	1,493050	1.373,03
DUEMME / sottoptf	Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	7.380,00	1,000000	1,000000	0,735800	0,735800	10.012,89
DUEMME / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.862,48	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	45.404,64
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - DUEMME / sottoptf														92.603,88
Acquisti Pending														
den_portafoglio_op	den_sezio ne	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_ divis a	data_operazio ne	data_valuta	data_banca	data_contabiliz zazione	imp_valore_ nominale	imp_prezzo_lor do	imp_prezzo_ne tto	tasso_cambio	tasso_cambio_ banca	imp_valore_pe nding_lc
AMUNDI / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	1.076,97	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	17.082,90
AMUNDI / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	18.034,06	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	286.056,18
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - AMUNDI / sottoptf														303.139,08
ANIMA / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	1.076,97	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	17.082,90
ANIMA / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	18.034,06	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	286.056,18
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - ANIMA / sottoptf														303.139,08
DUEMME / sottoptf	Futures	ESH6 Index	S&P500 EMINI FUT Mar16	USD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	12.740,00	1,000000	1,000000	1,086300	1,086300	11.727,88
DUEMME / sottoptf	Futures	PTH6 Index	S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	CAD	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	1.280,00	1,000000	1,000000	1,515600	1,515600	848,27
DUEMME / sottoptf	Futures	PTH6 Index	S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	CAD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	3.200,00	1,000000	1,000000	1,508950	1,508950	2.120,68
DUEMME / sottoptf	Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	29/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	29/12/2015	10.000,00	1,000000	1,000000	9,150750	9,150750	1.091,92
DUEMME / sottoptf	Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	3.750,00	1,000000	1,000000	9,158150	9,158150	409,47
DUEMME / sottoptf	Futures	SMH6 Index	SWISS MKT IX FUTR Mar16	CHF	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	5.060,00	1,000000	1,000000	1,087400	1,087400	4.653,30
DUEMME / sottoptf	Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	4.860,00	1,000000	1,000000	0,737050	0,737050	6.593,85
DUEMME / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	1.076,97	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	17.082,89
DUEMME / sottoptf	Quote di pr	QUOCARIPORIZZ20	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA - ORI	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	18.034,06	15,862000	15,862000	1,000000	1,000000	286.056,18
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 20 - DUEMME / sottoptf														330.584,44

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE

Iscritto nell'apposito albo in data 28/11/2007 al n° 1645.

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE E DEL VALORE DEL PATRIMONIO

COMPARTO ORIZZONTE 30**VALORIZZAZIONE DEL 31/12/2015**

(valori espressi in €)

		31/12/2015
	Investimenti diretti	-
	Investimenti in gestione	123.145.406,61
	Attività della gestione amministrativa	-
	Proventi maturati e non riscossi	569.061,98
	Crediti d'imposta	-
(A)	TOTALE ATTIVITA'	123.714.468,59
	Passività della gestione previdenziale	2.171.842,30
	Passività della gestione finanziaria	121.476,12
	Passività della gestione amministrativa	-
	Oneri maturati e non liquidati	122.499,71
	Debiti d'imposta	1.315.747,72
(B)	TOTALE PASSIVITA'	3.731.565,85
(A - B)	ATTIVO NETTO DESTINATO ALLE PRESTAZIONI	119.982.902,74
	Numero delle quote in essere	8.480.298,728
	Valore unitario della quota	14,148

<i>den_portafoglio</i>	<i>CARIPARMA CREDIT</i>	<i>CARIPARMA CREDIT</i>	<i>CARIPARMA CREDIT</i>	<i>CARIPARMA CREDIT</i>
	<i>AGRICOLE - ORIZZ 30-</i>	<i>AGRICOLE -</i>	<i>AGRICOLE -</i>	<i>AGRICOLE -</i>
	<i>MAIN</i>	<i>ORIZZONTE 30 -</i>	<i>ORIZZONTE 30 -</i>	<i>ORIZZONTE 30 -</i>
<i>data_nav</i>	<i>31/12/2015</i>	<i>31/12/2015</i>	<i>31/12/2015</i>	<i>31/12/2015</i>
<i>data_calcolo</i>	<i>08/01/2016</i>	<i>08/01/2016</i>	<i>08/01/2016</i>	<i>08/01/2016</i>
<i>totale_obbligazioni</i>	71.182.404,67	17.385.358,44	16.794.925,66	37.002.120,57
<i>rateo_titoli</i>	569.061,98	133.562,26	131.321,73	304.177,99
<i>totale_azioni</i>	26.733.891,29	17.837.741,70	-	8.896.149,59
<i>totale_fondi</i>	18.567.274,20	-	18.567.274,20	-
<i>dividendi_pending</i>	22.840,45	17.219,45	-	5.621,00
<i>comm_retrocessione</i>	-	-	-	-
<i>comm_giorno_retrocessione</i>	-	-	-	-
<i>totale_banche</i>	2.390.810,85	925.780,40	158.478,47	1.306.551,98
<i>interessi</i>	-	-	-	-
<i>totale_pct</i>	-	-	-	-
<i>totale_fwd_cambi_pos</i>	713,00	430,01	-	282,99
<i>totale_futures_pos</i>	1.643.293,07	-	773.841,09	869.451,98
<i>totale_opzioni_pos</i>	-	-	-	-
<i>totale_cc_margini</i>	-	-	-	-
<i>crediti_pending</i>	726.865,52	98.843,44	502.181,70	125.840,38
<i>totale_finanziamenti</i>	-	-	-	-
<i>totale_margini_finanziamenti</i>	-	-	-	-
<i>totale_immobili</i>	-	-	-	-
<i>totale_margini_immobili</i>	-	-	-	-
<i>totale_cash_deposit</i>	-	-	-	-
<i>totale_swap_pos</i>	-	-	-	-
<i>rateo_cash_deposit</i>	-	-	-	-
<i>attivo lordo gestito</i>	121.837.155,03	36.398.935,70	36.928.022,85	48.510.196,48
<i>debiti_pending</i>	- 113.483,80	- 37.284,70	-	- 76.199,10
<i>totale_fwd_cambi_neg</i>	- 7.992,32	- 1.158,27	- 6.834,05	-
<i>totale_futures_neg</i>	- 69.753,03	-	-	- 69.753,03
<i>totale_opzioni_neg</i>	-	-	-	-
<i>totale_swap_neg</i>	-	-	-	-
<i>ritenuta_cash_deposit</i>	-	-	-	-
<i>portafoglio netto gestito</i>	121.645.925,88	36.360.492,73	36.921.188,80	48.364.244,35
<i>risorse lorde gestione</i>	121.645.925,88	36.360.492,73	36.921.188,80	48.364.244,35
<i>comm_ges_finanziaria</i>	- 20.268,48	- 6.204,96	- 6.626,58	- 7.436,94
<i>comm_giorno_ges_finanziaria</i>	- 9.886,90	- 3.029,19	- 3.230,58	- 3.627,13
<i>comm_overperformance</i>	- 71.367,76	- 23.245,20	- 42.595,68	- 5.526,88
<i>comm_giorno_overperformance</i>	-	-	-	-
<i>comm_gar_capitale</i>	-	-	-	-
<i>comm_giorno_gar_capitale</i>	-	-	-	-
<i>risorse nette gestione</i>	121.544.402,74	36.328.013,38	36.868.735,96	48.347.653,40
<i>comm_compagnia</i>	-	-	-	-
<i>comm_giorno_compagnia</i>	-	-	-	-
<i>comm_rete</i>	-	-	-	-
<i>comm_giorno_rete</i>	-	-	-	-
<i>comm_revisione</i>	-	-	-	-
<i>comm_giorno_revisione</i>	-	-	-	-
<i>comm_banca_depositaria</i>	- 5.341,20	-	-	-
<i>comm_giorno_banca_depositaria</i>	- 2.647,64	-	-	-
<i>comm_clearing</i>	- 12.987,73	- 10.229,56	- 280,44	- 2.477,73
<i>comm_giorno_clearing</i>	-	-	-	-
<i>altre_commissioni</i>	-	-	-	-
<i>miscellanee</i>	-	-	-	-
<i>totale_margini_miscellanee</i>	-	-	-	-
<i>nav finanziario</i>	121.523.426,17	36.317.783,82	36.868.455,52	48.345.175,67
<i>totale_misc_ges_amm</i>	-	-	-	-
<i>crediti_previdenziali</i>	2.988,80	996,27	996,27	996,26
<i>debiti_previdenziali</i>	- 1.498.011,22	- 499.337,08	- 499.337,08	- 499.337,06
<i>patrimonio lordo ante i</i>	120.028.403,75	35.819.443,01	36.370.114,71	47.846.834,87
<i>crediti_imposta_oicr</i>	-	-	-	-
<i>totale_misc_fiscalita</i>	-	-	-	-
<i>imposta_sostitutiva</i>	- 1.315.747,72	-	-	-
<i>ritenute_anno_in_corso</i>	-	-	-	-
<i>patrimonio netto</i>	118.712.656,03	35.819.443,01	36.370.114,71	47.846.834,87
<i>contributi_giorno</i>	1.944.077,79	648.025,93	648.025,93	648.025,93
<i>rimborsi_giorno</i>	- 673.831,08	- 224.610,36	- 224.610,36	- 224.610,36
<i>attivo netto dest prest</i>	119.982.902,74	36.242.858,58	36.793.530,28	48.270.250,44
<i>totale quote</i>	8.480.298,728			
<i>imp_prezzo_nav</i>	14,148			
<i>contributi_copertura_spese</i>	181.422,82			
<i>contributi_prestazioni_acc</i>	-			

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																				
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 30 AL 31.12.2015																				
GESTORE AMUNDI																				
den strumento finanziario	cod isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globaletramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_ratin_g_compo_site_blm	den_cat_ogoria_s_trument_o
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc AUD		42.099.470	AUD	1,000	42.099,47	1,49305	28.196,96	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,49393	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc CAD		7.412.420	CAD	1,000	7.412,42	1,50895	4.912,30	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,43031	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc CHF		2.591.150	CHF	1,000	2.591,15	1,08740	2.382,89	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,23318	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc EUR		49.201.910	EUR	1,000	49.201,91	1,00000	49.201,91	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc GBP		9.801.490	GBP	1,000	9.801,49	0,73705	13.298,27	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,71474	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc JPY		6.668.028.000	JPY	1,000	6.668.028,00	130,67645	51.027,01	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	131,14520	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 AMUNDI cc USD		10.275.450	USD	1,000	10.275,45	1,08630	9.459,13	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,09284	-	-
Totale I.G - Depositi Bancari							158.478,47													
Forward su cambi: vendita USD, acquisto EUR	FWDCAMUSDEUR	6.834.050	EUR	1,000	6.834,05	1,00000	6.834,05	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-
Totale I.G - Forward su cambi							6.834,05													
EURO-BUND FUTURE Mar16	RXH6 Comdty	9,000	EUR	157,920	19.960,00	1,00000	19.960,00	-	-	-	-	-	-	Futures	160,138	160,138	1,00000	1,00000	-	Comdty
TOPIX INDEX FUTURE Mar16	TPH6 Index	9,000	JPY	1.547,500	4.023.000,00	130,67645	30.785,96	-	-	-	-	-	-	Futures	1.592,200	1.592,200	133,63180	133,63180	-	Index
SP1 200 FUTURES Mar16	XPHE Index	6,000	AUD	5.257,000	48.450,00	1,49305	33.120,12	-	-	-	-	-	-	Futures	4.927,333	4.927,333	1,52184	1,52184	-	Index
Totale I.G - Futures							22.294,16													
A-F ID EQ EUROPE-OEC	LU0557865424	6.600.000	EUR	1.459.230	9.630.918,00	1,00000	9.630.918,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1.459.230	1.270.739	1,00000	1,00000	-	Equity
A-F ID EQ NTH AM-OEC	LU0557865770	3.750.000	EUR	1.979.830	7.424.362,50	1,00000	7.424.362,50	-	-	-	-	-	-	OICR	1.979.830	1.456.815	1,00000	1,00000	-	Equity
A-F EQ EURO SELT-OEC	LU0557870697	430.000	EUR	1.764.590	758.773,70	1,00000	758.773,70	-	-	-	-	-	-	OICR	1.764.590	1.847.224	1,00000	1,00000	-	Equity
A-F EQ EURP SELT-OEC	LU0557870853	500.000	EUR	1.506.440	753.220,00	1,00000	753.220,00	-	-	-	-	-	-	OICR	1.506.440	1.523.744	1,00000	1,00000	-	Equity
Totale I.G - OICVM UE							18.567.274,20													
ENI SPA 02/02/2026 1,5	XS1180451657	150.000.000	EUR	96,114	144.171,00	1,00000	144.171,00	2,046,58	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,114	101,150	1,00000	1,00000	A-	9,30 Corp
AUTOSTRAD PER LITALIA 04/11/2021 1,125	XS1316567343	200.000.000	EUR	100,399	200.798,00	1,00000	200.798,00	350,41	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,399	100,380	1,00000	1,00000	BBB+	5,69 Corp
AUTOSTRAD PER LITALIA 26/06/2026 1,75	XS1327504087	200.000.000	EUR	99,757	199.514,00	1,00000	199.514,00	296,45	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,757	99,146	1,00000	1,00000	BBB+	9,66 Corp
Totale I.G - Tdebito Q IT							544.483,00	2.693,44												
AMERICA MOVIL SAB DE CV 12/07/2021 3	XS0802174044	100.000.000	EUR	109,312	109.312,00	1,00000	109.312,00	1,409,84	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,312	104,110	1,00000	1,00000	A-	5,14 Corp
PETROLIOS MEXICANOS 27/11/2020 3,125	XS0997484430	100.000.000	EUR	96,552	96.552,00	1,00000	96.552,00	290,30	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,552	99,358	1,00000	1,00000	BBB+	4,61 Corp
TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 21/07/2022, 75	XS1171483933	150.000.000	EUR	98,270	147.405,00	1,00000	147.405,00	501,02	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,270	99,876	1,00000	1,00000	AA+	6,40 Corp
STATOIL ASA 17/02/2023, 875	XS1190624111	200.000.000	EUR	96,825	193.650,00	1,00000	193.650,00	1,519,86	-	-	-	-	-	Obbligazioni	96,825	99,846	1,00000	1,00000	AA-	8,89 Corp
AT&T INC 15/03/2025 2,45	XS1196380031	150.000.000	EUR	88,545	132.817,50	1,00000	132.817,50	2,982,17	-	-	-	-	-	Obbligazioni	88,545	99,328	1,00000	1,00000	BBB+	14,95 Corp
APPLE INC 17/01/2024 1,375	XS1292384960	250.000.000	EUR	100,923	252.307,50	1,00000	252.307,50	988,87	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,923	99,604	1,00000	1,00000	AA+	7,65 Corp
PROCTER & GAMBLE CO/THE 02/11/2023 1,125	XS1314318301	100.000.000	EUR	99,941	99.941,00	1,00000	99.941,00	181,35	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,941	99,970	1,00000	1,00000	AA-	7,54 Corp
UNITED PARCEL SERVICE 15/11/2025 1,625	XS1323463726	150.000.000	EUR	100,585	150.877,50	1,00000	150.877,50	273,80	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,585	99,708	1,00000	1,00000	AA+	9,20 Corp
Totale I.G - Tdebito Q OCSE							1.182.862,50	8.147,21												
ENGIE 13/03/2022, 5	FR0012602753	200.000.000	EUR	97,306	194.612,00	1,00000	194.612,00	800,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	97,306	95,782	1,00000	1,00000	A	6,10 Corp
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 10/01/2028 1,59	FR0012663169	100.000.000	EUR	94,708	94.708,00	1,00000	94.708,00	1.158,74	-	-	-	-	-	Obbligazioni	94,708	100,000	1,00000	1,00000	BBB	10,88 Corp
DANONE SA 30/05/2024 1,25	FR0013063609	200.000.000	EUR	98,592	197.184,00	1,00000	197.184,00	212,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,592	99,228	1,00000	1,00000	BBB+	8,03 Corp
ROLLS-ROYCE PLC 18/06/2021 2,125	XS0944838241	100.000.000	EUR	105,330	105.330,00	1,00000	105.330,00	1.137,98	-	-	-	-	-	Obbligazioni	105,330	99,557	1,00000	1,00000	A-	5,17 Corp
CREDIT AGRICOLE LONDON 19/01/2022, 875	XS1169630602	200.000.000	EUR	98,421	196.842,00	1,00000	196.842,00	1.658,90	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,421	97,068	1,00000	1,00000	A-	5,88 Corp
HEINEKEN NV 10/09/2021 1,25	XS1288852939	150.000.000	EUR	100,913	151.369,50	1,00000	151.369,50	573,77	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,913	99,839	1,00000	1,00000	BBB+	5,52 Corp
BAT INTL FINANCE PLC 23/05/2022 1	XS1324928750	150.000.000	EUR	98,019	147.028,50	1,00000	147.028,50	156,16	-	-	-	-	-	Obbligazioni	98,019	99,297	1,00000	1,00000	A-	6,22 Corp
Totale I.G - Tdebito Q UE							1.087.074,00	5.698,43												
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2034 5	IT0003535157	500.000	EUR	140,034	700,17	1,00000	700,17	10,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	140,034	99,250	1,00000	1,00000	NR	13,20 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2020 4,5	IT0003644769	500.000	EUR	116,478	582,39	1,00000	582,39	9,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,478	99,500	1,00000	1,00000	NR	3,75 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2018 4,5	IT0004273493	500.000	EUR	109,251	546,26	1,00000	546,26	9,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,251	101,520	1,00000	1,00000	NR	1,99 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2019 4,25	IT0004489610	350.000.000	EUR	114,102	399.356,30	1,00000	399.356,30	4.944,71	-	-	-	-	-	Obbligazioni	114,102	104,229	1,00000	1,00000	NR	3,41 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2025 5	IT0004513641	250.000.000	EUR	129,912	324.780,75	1,00000	324.780,75	4.155,22	-	-	-	-	-	Obbligazioni	129,912	109,118	1,00000	1,00000	NR	7,62 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2044 4,75	IT0004923998	300.000.000	EUR	141,069	423.207,90	1,00000	423.207,90	4.736,95	-	-	-	-	-	Obbligazioni	141,069	113,107	1,00000	1,00000	NR	17,83 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2024 4,5	IT0004953417	350.000.000	EUR	124,160	434.561,05	1,00000	434.561,05	5.235,58	-	-	-	-	-	Obbligazioni	124,160	105,625	1,00000	1,00000	NR	7,00 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2024 3,75	IT0005001547	400.000.000	EUR	118,750	475.000,80	1,00000	475.000,80	4.986,26	-	-	-	-	-	Obbligazioni	118,750	103,778	1,00000	1,00000	NR	7,53 Govt
CCTS EU 15/12/2020 FLOATING	IT0005056541	650.000.000	EUR	102,339	665.202,85	1,00000	665.202,85	220,13	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,339	101,617	1,00000	1,00000	NR	0,50 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/12/2019 1,05	IT0005069395	200.000.000	EUR	102,503	205.006,20	1,00000	205.006,20	172,13	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,503	100,988	1,00000	1,00000	NR	3,85 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2046 3,25	IT0005083057	100.000.000	EUR	111,745	111.744,90	1,00000	111.744,90	1,080,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	111,745	102,503	1,00000	1,00000	NR	20,11 Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/05/2018, 25	IT0005106049	100.000.000	EUR	100,378	100.377,70	1,00000	100.377,70	17,86	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,378	99,846	1,00000	1,00000	NR	2,37 Govt
Totale I.G - Tdebito Q OCSE							3													

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																				
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 30 AL 31.12.2015																				
GESTORE ANIMA																				
den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_mar_gini	esposizione_globale_tramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_torico	tasso_cambio_storico	cod_rating_gompo_site_blm	den_categoria_strumento
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc AUD		17.375.010	AUD	1,000	17.375,01	1,49305	11.637,26	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,50585	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc CAD		213.201.530	CAD	1,000	213.201,53	1,50895	141.291,32	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,45541	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc CHF		7.376.010	CHF	1,000	7.376,01	1,08740	6.783,16	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,08258	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc DKK		21.338.060	DKK	1,000	21.338,06	7,46265	2.859,31	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	7,46265	7,46099	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc EUR		611.795.420	EUR	1,000	611.795,42	1,00000	611.795,42	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc GBP		7.802.330	GBP	1,000	7.802,33	0,73705	10.585,89	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,73306	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc JPY		3.620.983.000	JPY	1,000	3.620.983,00	130,67645	27.709,53	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	132,63859	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc NOK		17.043.770	NOK	1,000	17.043,77	9,61525	1.772,58	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,61525	9,15239	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc SEK		29.302.020	SEK	1,000	29.302,02	9,15815	3.199,56	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,15815	9,28320	-	-
CARIPARMA ORIZ 30 ANIMA cc USD		117.479.400	USD	1,000	117.479,40	1,08630	108.146,37	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,07589	-	-
Totale I.G - Depositi Bancari							925.780,40													
Forward su cambi: vendita JPY, acquisto JPY	FWDCAMEURJPY	430.010	EUR	1,000	430,01	1,00000	430,01	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-
Forward su cambi: vendita JPY, acquisto EUR	FWDCAMJPYEUR	1.158.270	EUR	1,000	1.158,27	1,00000	1.158,27	-	-	-	-	-	-	Forward su cambi	1,000	-	1,00000	-	-	-
Totale I.G - Forward su cambi							728,26													
ASSICURAZIONI GENERALI																				
INTESA SANPAOLO	IT0000072618	42.490.000	EUR	3,088	131.209,12	1,00000	131.209,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,088	2,541	1,00000	1,00000	-	Equity
ENI SPA	IT0003132476	5.305.000	EUR	13,800	73.209,00	1,00000	73.209,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	13,800	15,133	1,00000	1,00000	-	Equity
SNIAI SPA	IT0003153415	17.770.000	EUR	4,830	85.829,10	1,00000	85.829,10	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,830	4,493	1,00000	1,00000	-	Equity
TELECOM ITALIA SPA	IT0003487168	64.586.000	EUR	1,175	75.888,55	1,00000	75.888,55	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,175	1,174	1,00000	1,00000	-	Equity
ATLANTIA SPA	IT0003506190	1.335.000	EUR	24,500	32.707,50	1,00000	32.707,50	-	-	-	-	-	-	Azioni	24,500	23,553	1,00000	1,00000	-	Equity
FIMMECCANICA SPA	IT0003856405	7.256.000	EUR	12,900	93.602,40	1,00000	93.602,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,900	10,187	1,00000	1,00000	-	Equity
PRYSMIAN SPA	IT0004176001	2.371.000	EUR	20,260	48.036,46	1,00000	48.036,46	-	-	-	-	-	-	Azioni	20,260	19,901	1,00000	1,00000	-	Equity
ENEL GREEN POWER SPA	IT0004618465	42.245.000	EUR	1,883	79.547,34	1,00000	79.547,34	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,883	1,740	1,00000	1,00000	-	Equity
Totale I.G - TCapitale O IT							651.111,51													
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	AU0000000CB7	1.960.000	AUD	85,530	167.638,80	1,49305	112.279,43	-	-	-	-	-	-	Azioni	85,530	80,165	1,49305	1,49317	-	Equity
TELSTRA CORP LTD	AU0000000TL52	3.700.000	AUD	5,610	20.757,00	1,49305	13.902,41	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,610	5,573	1,49305	1,52665	-	Equity
WESTPAC BANKING CORP OLD	AU0000000WBC1	1.800.000	AUD	33,560	60.408,00	1,49305	40.459,46	-	-	-	-	-	-	Azioni	33,560	32,136	1,49305	1,50550	-	Equity
WESFARMERS LTD	AU0000000WES1	400.000	AUD	41,610	16.644,00	1,49305	11.147,65	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,610	41,696	1,49305	1,52665	-	Equity
MAGNA INTERNATIONAL INC	CA5592224011	934.000	CAD	56,120	52.416,08	1,50895	34.736,79	-	-	-	-	-	-	Azioni	56,120	64,200	1,50895	1,36226	-	Equity
ACTELION LTD-REG	CH0010532478	253.000	CHF	139,600	35.318,80	1,08740	32.480,04	-	-	-	-	-	-	Azioni	139,600	117,568	1,08740	1,20268	-	Equity
NOVARTIS AG-REG	CH0012005267	2.902.000	CHF	86,800	251.893,60	1,08740	231.647,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	86,800	85,024	1,08740	1,11469	-	Equity
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CH0012032048	1.776.000	CHF	276,400	490.886,40	1,08740	451.431,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	276,400	262,415	1,08740	1,09478	-	Equity
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	CH0014852781	202.000	CHF	271,300	54.802,60	1,08740	50.397,83	-	-	-	-	-	-	Azioni	271,300	206,891	1,08740	1,10066	-	Equity
NESTLE SA-REG	CH0038863350	4.056.000	CHF	74,550	302.374,80	1,08740	278.071,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	74,550	71,466	1,08740	1,12247	-	Equity
ARYZTA AG	CH0043238366	1.244.000	CHF	51,000	63.444,00	1,08740	58.344,68	-	-	-	-	-	-	Azioni	51,000	64,195	1,08740	1,15947	-	Equity
UBS GROUP AG-REG	CH0244767585	6.476.000	CHF	19,520	126.411,52	1,08740	116.251,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	19,520	17,548	1,08740	1,13232	-	Equity
INGERSOLL-RAND PLC	IE0008633032	1.531.000	USD	55,290	84.648,99	1,08630	77.924,14	-	-	-	-	-	-	Azioni	55,290	59,900	1,08630	1,14991	-	Equity
ALLERGAN PLC	IE00BY9D5467	77.000	USD	312,500	24.062,50	1,08630	22.150,88	-	-	-	-	-	-	Azioni	312,500	257,410	1,08630	1,12345	-	Equity
AISIN SEIKI CO LTD	JP3102000001	400.000	JPY	5.240.000	2.096.000,00	130,67645	16.039,62	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.240.000	5.062.925	130,67645	131,57565	-	Equity
ITOCHU CORP	JP3143600009	1.400.000	JPY	1.442.000	2.018.800,00	130,67645	15.448,84	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.442.000	1.538.947	130,67645	132,30840	-	Equity
OTSUKA HOLDINGS CO LTD	JP3188220002	700.000	JPY	4.317.000	3.021.900,00	130,67645	23.125,05	-	-	226,82	-	-	-	Azioni	4.317.000	4.184.974	130,67645	132,91735	-	Equity
KAO CORP	JP3205800000	400.000	JPY	6.255.000	2.502.000,00	130,67645	19.146,53	-	-	98,50	-	-	-	Azioni	6.255.000	6.495.000	130,67645	136,59825	-	Equity
KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	JP3228600007	1.700.000	JPY	1.459.500	2.481.150,00	130,67645	18.986,97	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.459.500	1.470.000	130,67645	131,84960	-	Equity
KUBOTA CORP	JP3266400005	1.000.000	JPY	1.888.000	1.888.000,00	130,67645	14.447,90	-	-	-	90,73	-	-	Azioni	1.888.000	2.029.548	130,67645	132,91735	-	Equity
SHISEIDO CO LTD	JP3251600006	-	JPY	2.529.000	-	130,67645	-	-	15.110,87	51,85	-	-	-	Azioni	-	-	-	-	-	Equity
SHIMIZU CORP	JP3358800005	2.000.000	JPY	990.000	1.980.000,00	130,67645	15.151,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	990.000	1.009.735	130,67645	133,04720	-	Equity
SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JP3371200001	200.000	JPY	6.617.000	1.323.400,00	130,67645	10.127,30	-	-	25.256,29	-	-	-	Azioni	6.617.000	6.989.257	130,67645	137,04115	-	Equity
SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	JP3407400005	2.200.000	JPY	1.724.000	3.792.800,00	130,67645	29.024,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.724.000	1.709.000	130,67645	141,81890	-	Equity
SEKISUI HOUSE LTD	JP3420600003	2.000.000	JPY	2.046.500	4.093.000,00	130,67645	31.321,63	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.046.500	1.955.822	130,67645	136,77760	-	Equity
SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	JP3422950000	400.000	JPY	5.550.000	2.220.000,00	130,67645	16.988,52	-	-	-	16.875,17	-	-	Azioni	5.550.000	5.508.561	130,67645	131,39550	-	Equity
SONY CORP	JP3435000009	500.000	JPY	3.002.000	1.501.000,00	130,67645	11.486,38	-	-	-	-	-	-	Azioni	3.002.000	3.500.536	130,67645	133,61446	-	Equity
SOFTBANK GROUP CORP	JP3436100006	400.000	JPY	6.139.000	2.455.600,00	130,67645	18.791,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	6.139.000	7.442.756	130,67645	138,51165	-	Equity
DAI-ICHI LIFE INSURANCE	JP3476480003	900.000	JPY	2.035.000	1.831.500,00	130,67645	14.015,53	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.035.000	2.253.054	130,67645	136,16809	-	Equity
KDDI CORP	JP3496400007	1.900.000	JPY	3.154.000	5.992.600,00	130,67645	45.858,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	3.154.000	2.952.480	130,67645	136,75174	-	Equity
TDK CORP	JP3538800008	200.000	JPY	7.820.000	1.564.000,00	130,67645	11.968,49	-	-	-	-	-	-	Azioni	7.820.000	8.800.568	130,67645	131,57565	-	Equity
CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	JP3566800003	200.000	JPY																	

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pendng	saldo_mar_gini	esposizione_globale_tramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_ratin_g_co_mpo_site_blm	duration	den_cate_goria_strumento
MINEBEA CO LTD	JP3906000009	2.000.000	JPY	1.049.000	2.098.000,00	130,67645	16.054,92	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.049.000	1.508.055	130,67645	132,46975	-	-	Equity
TOKIO MARINE HOLDINGS INC	JP3910660004	500.000	JPY	4.712.000	2.356.000,00	130,67645	18.029,26	-	-	-	-	-	-	Azioni	4.712.000	5.088,151	130,67645	134,71402	-	-	Equity
MURATA MANUFACTURING CO LTD	JP3914400001	100.000	JPY	17.570.000	1.757.000,00	130,67645	13.445,42	-	-	-	-	-	-	Azioni	17.570.000	17.855,070	130,67645	132,91919	-	-	Equity
ASTELLAS PHARMA INC	JP3942400007	1.500.000	JPY	1.731.500	2.597.250,00	130,67645	19.875,43	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.731.500	1.939.500	130,67645	137,38675	-	-	Equity
YAMAHA MOTOR CO LTD	JP3942800008	800.000	JPY	2.744.000	2.195.200,00	130,67645	16.798,74	-	-	114,06	-	-	-	Azioni	2.744.000	2.803,552	130,67645	138,44565	-	-	Equity
RAKUTEN INC	JP3967200001	2.700.000	JPY	1.403.675	3.788.100,00	130,67645	28.988,39	-	-	-	-	-	-	Azioni	1.403.675	1.992,476	130,67645	136,71162	-	-	Equity
LYONDELLBASELL INDU-CL A	NL0009434992	521.000	USD	86,900	45.274,90	1,08630	41.678,08	-	-	-	-	-	-	Azioni	86,900	93,267	1,08630	1,11638	-	-	Equity
NORSK HYDRO ASA	NO0005052605	14.323.000	NOK	33,130	474.520,99	9,61525	49.350,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	33,130	32,982	9,61525	9,17614	-	-	Equity
ADT CORP/THE	US00101J1060	1.013.000	USD	32,980	33.408,74	1,08630	30.754,62	-	-	-	-	-	-	Azioni	32,980	37,400	1,08630	1,14122	-	-	Equity
AT&T INC	US00206R1023	1.987.000	USD	34,410	68.372,67	1,08630	62.940,87	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,410	34,679	1,08630	1,10475	-	-	Equity
ABBVIE INC	US00287Y1091	809.000	USD	59,240	47.925,16	1,08630	44.117,79	-	-	-	-	-	-	Azioni	59,240	57,353	1,08630	1,10134	-	-	Equity
ADDOBE SYSTEMS INC	US00724F1012	338.000	USD	93,940	31.751,72	1,08630	29.229,24	-	-	-	-	-	-	Azioni	93,940	88,787	1,08630	1,10465	-	-	Equity
ALPHABET INC-CL C	US02079K1079	159.000	USD	758,880	120.661,92	1,08630	111.076,06	-	-	-	-	-	-	Azioni	758,880	547,990	1,08630	1,12030	-	-	Equity
ALPHABET INC-CL A	US02079K3059	205.000	USD	778,010	159.492,05	1,08630	146.821,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	778,010	632,961	1,08630	1,11950	-	-	Equity
ALTRIA GROUP INC	US02209S1033	422.000	USD	58,210	24.564,62	1,08630	22.613,11	-	-	186,57	-	-	-	Azioni	58,210	51,739	1,08630	1,09150	-	-	Equity
AMAZON.COM INC	US0231351067	220.000	USD	675,890	148.695,80	1,08630	136.882,81	-	-	-	-	-	-	Azioni	675,890	483,074	1,08630	1,15451	-	-	Equity
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	US0268747849	1.888.000	USD	61,970	116.999,36	1,08630	107.704,61	-	-	-	-	-	-	Azioni	61,970	56,569	1,08630	1,13338	-	-	Equity
AMGEN INC	US0311621009	142.000	USD	162,330	23.050,86	1,08630	21.219,61	-	-	-	-	-	-	Azioni	162,330	164,001	1,08630	1,06200	-	-	Equity
APPL INC	US0378331005	2.342.000	USD	105,260	246.518,92	1,08630	226.934,47	-	-	14.848,59	-	-	-	Azioni	105,260	98,492	1,08630	1,24131	-	-	Equity
APPLIED MATERIALS INC	US0382210051	2.491.000	USD	18,570	46.506,97	1,08630	42.812,27	-	-	-	-	-	-	Azioni	18,570	18,673	1,08630	1,05869	-	-	Equity
ARAMARK	US03852U1060	801.000	USD	32,250	25.832,25	1,08630	23.780,03	-	-	-	-	-	-	Azioni	32,250	26,160	1,08630	1,33824	-	-	Equity
BANK OF AMERICA CORP	US0605051046	10.478.000	USD	16,830	176.344,74	1,08630	162.335,21	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,830	16,694	1,08630	1,22070	-	-	Equity
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	US0640581007	2.773.000	USD	41,220	114.303,06	1,08630	105.222,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,220	37,352	1,08630	1,19928	-	-	Equity
BECTON DICKINSON AND CO	US0758871091	353.000	USD	154,090	54.393,77	1,08630	50.072,51	-	-	-	-	-	-	Azioni	154,090	141,560	1,08630	1,21262	-	-	Equity
BLACKROCK INC	US09247X1019	170.000	USD	340,520	57.888,40	1,08630	53.289,51	-	-	-	-	-	-	Azioni	340,520	340,703	1,08630	1,11187	-	-	Equity
BOEING CO/THE	US0970231058	659.000	USD	144,590	95.284,81	1,08630	87.715,01	-	-	-	-	-	-	Azioni	144,590	143,403	1,08630	1,11268	-	-	Equity
BOSTON SCIENTIFIC CORP	US1011371077	2.858.000	USD	18,440	52.701,52	1,08630	48.514,70	-	-	-	-	-	-	Azioni	18,440	12,865	1,08630	1,26964	-	-	Equity
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	US1101221083	620.000	USD	68,790	42.649,80	1,08630	39.261,63	-	-	184,35	-	-	-	Azioni	68,790	67,244	1,08630	1,08380	-	-	Equity
BROADCOM CORP-CL A	US1113201073	955.000	USD	57,820	55.218,10	1,08630	50.831,35	-	-	-	-	-	-	Azioni	57,820	29,137	1,08630	1,35105	-	-	Equity
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	US1156372096	398.000	USD	99,280	39.513,44	1,08630	36.374,33	-	-	-	-	-	-	Azioni	99,280	78,728	1,08630	1,36855	-	-	Equity
CVS HEALTH CORP	US1266501006	491.000	USD	97,770	48.005,07	1,08630	44.191,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	97,770	98,441	1,08630	1,10838	-	-	Equity
CELGENE CORP	US1510201049	292.000	USD	119,760	34.969,92	1,08630	32.191,77	-	-	-	-	-	-	Azioni	119,760	122,286	1,08630	1,12930	-	-	Equity
CHEVRON CORP	US1667641005	1.420.000	USD	89,960	127.743,20	1,08630	117.594,77	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,960	84,370	1,08630	1,11257	-	-	Equity
CISCO SYSTEMS INC	US17275R1023	2.718.000	USD	27,155	73.807,29	1,08630	67.943,74	-	-	-	-	-	-	Azioni	27,155	25,878	1,08630	1,24514	-	-	Equity
CITIGROUP INC	US1729674242	3.479.000	USD	51,750	180.038,25	1,08630	165.735,29	-	-	-	-	-	-	Azioni	51,750	53,230	1,08630	1,18506	-	-	Equity
CITRIX SYSTEMS INC	US1773761002	460.000	USD	75,650	34.799,00	1,08630	32.034,43	-	-	-	-	-	-	Azioni	75,650	76,279	1,08630	1,11904	-	-	Equity
COCA-COLA CO/THE	US1912161007	2.569.000	USD	42,960	110.364,24	1,08630	101.596,47	-	-	-	-	-	-	Azioni	42,960	41,932	1,08630	1,18680	-	-	Equity
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	US1924461023	363.000	USD	60,020	21.787,26	1,08630	20.056,39	-	-	-	-	-	-	Azioni	60,020	64,291	1,08630	1,11151	-	-	Equity
COMCAST CORP-CLASS A	US20030N1019	1.421.000	USD	56,430	80.187,03	1,08630	73.816,65	-	-	-	-	-	-	Azioni	56,430	60,666	1,08630	1,11860	-	-	Equity
CONOCOPHILLIPS	US20285C1045	660.000	USD	46,690	30.815,40	1,08630	28.367,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,690	54,841	1,08630	1,12630	-	-	Equity
COSTCO WHOLESALE CORP	US22160K1051	217.000	USD	161,500	35.045,50	1,08630	32.261,35	-	-	-	-	-	-	Azioni	161,500	145,592	1,08630	1,10784	-	-	Equity
DANAHER CORP	US2358511028	320.000	USD	92,880	29.721,60	1,08630	27.360,40	-	-	33,80	-	-	-	Azioni	92,880	93,689	1,08630	1,10465	-	-	Equity
DARDEN RESTAURANTS INC	US2371941053	571.000	USD	63,640	36.338,44	1,08630	33.451,57	-	-	-	-	-	-	Azioni	63,640	59,936	1,08630	1,12927	-	-	Equity
WALT DISNEY CO/THE	US2546871060	1.245.000	USD	105,080	130.824,60	1,08630	120.431,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	105,080	95,307	1,08630	1,17231	-	-	Equity
DOW CHEMICAL CO/THE	US2605431038	1.415.000	USD	51,480	72.844,20	1,08630	67.057,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	51,480	509,32	1,08630	1,11766	-	-	Equity
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	US2635341090	448.000	USD	66,600	29.836,80	1,08630	27.466,45	-	-	-	-	-	-	Azioni	66,600	60,233	1,08630	1,11563	-	-	Equity
EOG RESOURCES INC	US26875P1012	833.000	USD	70,790	58.968,07	1,08630	54.283,41	-	-	-	-	-	-	Azioni	70,790	84,918	1,08630	1,09436	-	-	Equity
ENERGIZER HOLDINGS INC	US29272W1099	880.000	USD	34,060	29.972,80	1,08630	27.591,64	-	-	-	-	-	-	Azioni	34,060	40,997	1,08630	1,12155	-	-	Equity
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	US30219G1085	703.000	USD	87,410	61.449,23	1,08630	56.567,46	-	-	-	-	-	-	Azioni	87,410	86,495	1,08630	1,12122	-	-	Equity
EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	2.411.000	USD	77,950	187.937,45	1,08630	173.006,95	-	-	-	-	-	-	Azioni	77,950	89,496	1,08630	1,22881	-	-	Equity
FACEBOOK INC-A	US30303M1027	876.000	USD	104,660	91.682,16	1,08630	84.398,56	-	-	-	-	-	-	Azioni	104,660	81,201	1,08630	1,18392	-	-	Equity
FISERV INC	US3377381088	314.000	USD	91,460	28.718,44	1,08630	26.436,93	-	-	-	-	-	-	Azioni	91,460	86,042	1,08630	1,12155	-	-	Equity
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	US35086T1097	190.000	USD	24,160	4.590,40	1,08630	4.402,34	-	-	-	-	-	-	Azioni	24,160	21,048	1,08630	1,06935			

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_mar_gini	esposizione_globale_tramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_torico	tasso_cambio_site_blm	cod_rating_co_mpo	duration	den_categoria_strumento
PRICELINE GROUP INC/THE	US7415034039	21.000	USD	1.274,950	26.773,95	1,08630	24.646,92	-	-	-	-	-	-	-	1.274,950	1.282,471	1,08630	1,12476	-	-	Equity
PROCTER & GAMBLE CO/THE	US7427181091	831.000	USD	79,410	65.989,71	1,08630	60.747,22	-	-	-	-	-	-	-	79,410	77,571	1,08630	1,11252	-	-	Equity
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	US7443201022	353.000	USD	81,410	28.737,73	1,08630	26.454,69	-	-	-	-	-	-	-	81,410	86,396	1,08630	1,12735	-	-	Equity
ROCKWELL COLLINS INC	US7743411016	719.000	USD	92,300	66.363,70	1,08630	61.091,50	-	-	-	-	-	-	-	92,300	93,449	1,08630	1,11330	-	-	Equity
SALESFORCE.COM INC	US79466L3024	667.000	USD	78,400	52.292,80	1,08630	48.138,45	-	-	-	-	-	-	-	78,400	75,527	1,08630	1,10748	-	-	Equity
STARBUCKS CORP	US8552441094	719.000	USD	60,030	43.161,57	1,08630	39.732,64	-	-	-	-	-	-	-	60,030	47,311	1,08630	1,12135	-	-	Equity
STATE STREET CORP	US8574771031	670.000	USD	66,360	44.461,20	1,08630	40.929,03	-	-	178,25	-	-	-	-	66,360	75,431	1,08630	1,18958	-	-	Equity
SYSCO CORP	US8718291078	1.008.000	USD	41,000	41.328,00	1,08630	38.044,74	-	-	-	-	-	-	-	41,000	40,018	1,08630	1,11110	-	-	Equity
TJX COMPANIES INC	US8725401090	421.000	USD	70,910	29.853,11	1,08630	27.481,46	-	-	-	-	-	-	-	70,910	68,609	1,08630	1,06505	-	-	Equity
T-MOBILE US INC	US8725901040	1.006.000	USD	39,120	39.354,72	1,08630	36.228,22	-	-	-	-	-	-	-	39,120	32,999	1,08630	1,07415	-	-	Equity
TARGET CORP	US87612E1064	315.000	USD	72,610	22.872,15	1,08630	21.055,10	-	-	-	-	-	-	-	72,610	72,441	1,08630	1,19795	-	-	Equity
3M CO	US88579Y1010	263.000	USD	150,640	39.618,32	1,08630	36.470,88	-	-	-	-	-	-	-	150,640	158,641	1,08630	1,07415	-	-	Equity
TRAVELERS COS INC/THE	US89417E1091	590.000	USD	112,860	66.587,40	1,08630	61.297,43	-	-	-	-	-	-	-	112,860	100,993	1,08630	1,12765	-	-	Equity
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	US9113121068	299.000	USD	96,230	28.772,77	1,08630	26.486,95	-	-	-	-	-	-	-	96,230	103,514	1,08630	1,13015	-	-	Equity
UNITED TECHNOLOGIES CORP	US9130171096	439.000	USD	96,070	42.174,73	1,08630	38.824,20	-	-	-	-	-	-	-	96,070	97,313	1,08630	1,13425	-	-	Equity
UNITEDHEALTH GROUP INC	US91324P1021	358.000	USD	117,640	42.115,12	1,08630	38.769,33	-	-	-	-	-	-	-	117,640	123,052	1,08630	1,11070	-	-	Equity
VERIZON COMMUNICATIONS INC	US92343V1044	1.344.000	USD	46,220	62.119,68	1,08630	57.164,65	-	-	-	-	-	-	-	46,220	45,463	1,08630	1,13425	-	-	Equity
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	US92532F1003	221.000	USD	125,830	27.808,43	1,08630	25.599,22	-	-	-	-	-	-	-	125,830	132,909	1,08630	1,06185	-	-	Equity
VISA INC-CLASS A SHARES	US92826C8394	1.228.000	USD	77,550	95.231,40	1,08630	87.665,64	-	-	-	-	-	-	-	77,550	71,053	1,08630	1,11773	-	-	Equity
WELLS FARGO & CO	US9437461015	3.603.000	USD	54,360	195.859,08	1,08630	180.299,25	-	-	-	-	-	-	-	54,360	51,064	1,08630	1,21825	-	-	Equity
Totale I-G - Capitale Q OCSE					8.815.031,73		8.815.031,73		98.843,44	7.313,16	- 37.284,70										
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	BE0003793107	1.456.000	EUR	114,400	166.566,40	1,00000	166.566,40	-	-	-	-	-	-	-	114,400	117,792	1,00000	1,00000	-	-	Equity
BEIERSDORF AG	DE0005200000	816.000	EUR	84,160	68.674,56	1,00000	68.674,56	-	-	-	-	-	-	-	84,160	77,222	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CONTINENTAL AG	DE0005439004	367.000	EUR	224,550	82.409,85	1,00000	82.409,85	-	-	-	-	-	-	-	224,550	211,039	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE POST AG-REG	DE0005562004	1.199.000	EUR	25,955	31.120,05	1,00000	31.120,05	-	-	-	-	-	-	-	25,955	26,734	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	DE0005567508	5.123.000	EUR	16,690	85.502,87	1,00000	85.502,87	-	-	-	-	-	-	-	16,690	15,870	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	472.000	EUR	81,390	38.416,08	1,00000	38.416,08	-	-	-	-	-	-	-	81,390	77,884	1,00000	1,00000	-	-	Equity
HEIDELBERGCEMENT AG	DE0006047004	720.000	EUR	75,620	54.446,40	1,00000	54.446,40	-	-	-	-	-	-	-	75,620	73,018	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INFINEON TECHNOLOGIES AG	DE0006231004	9.278.000	EUR	13,505	125.299,39	1,00000	125.299,39	-	-	-	-	-	-	-	13,505	10,609	1,00000	1,00000	-	-	Equity
MERCK KGAA	DE0006599905	1.168.000	EUR	89,570	104.617,76	1,00000	104.617,76	-	-	-	-	-	-	-	89,570	84,226	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DAILLER AG-REGISTERED SHARES	DE0007100000	2.031.000	EUR	77,580	157.564,98	1,00000	157.564,98	-	-	-	-	-	-	-	77,580	72,730	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SAP SE	DE0007164600	2.548.000	EUR	73,380	186.972,24	1,00000	186.972,24	-	-	-	-	-	-	-	73,380	64,948	1,00000	1,00000	-	-	Equity
SIEMENS AG-REG	DE0007236101	1.484.000	EUR	89,880	133.381,92	1,00000	133.381,92	-	-	-	-	-	-	-	89,880	92,865	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ALLIANZ SE-REG	DE0008404005	1.021.000	EUR	163,550	166.984,55	1,00000	166.984,55	-	-	-	-	-	-	-	163,550	161,302	1,00000	1,00000	-	-	Equity
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	DE0008430026	685.000	EUR	184,550	126.416,75	1,00000	126.416,75	-	-	-	-	-	-	-	184,550	173,475	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ADIDAS AG	DE00084EWWW0	1.094.000	EUR	89,910	98.361,54	1,00000	98.361,54	-	-	-	-	-	-	-	89,910	83,519	1,00000	1,00000	-	-	Equity
BAYER AG-REG	DE00084Y0017	1.569.000	EUR	115,800	181.690,20	1,00000	181.690,20	-	-	-	-	-	-	-	115,800	121,898	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CARLSBERG AS-B	DK0010181759	393.000	DKK	612,500	240.712,50	7,46265	32.255,63	-	-	-	-	-	-	-	612,500	614,221	7,46265	7,45980	-	-	Equity
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	DK0010268606	537.000	DKK	483,800	259.800,60	7,46265	34.813,45	-	-	-	-	-	-	-	483,800	370,875	7,46265	7,46188	-	-	Equity
DANSKE BANK A/S	DK0010274414	2.194.000	DKK	185,200	406.328,80	7,46265	54.448,33	-	-	-	-	-	-	-	185,200	160,590	7,46265	7,45773	-	-	Equity
NOVO NORDISK A/S-B	DK00060534915	3.112.000	DKK	399,900	1.244.488,80	7,46265	166.762,32	-	-	-	-	-	-	-	399,900	270,661	7,46265	7,45623	-	-	Equity
BANCO SANTANDER SA	ES0113900J37	21.310.000	EUR	4,558	97.130,98	1,00000	97.130,98	-	-	-	-	-	-	-	4,558	5,040	1,00000	1,00000	-	-	Equity
FERROVIAL SA	ES0118900010	69.000	EUR	20,855	1.439,00	1,00000	1.439,00	-	-	-	-	-	-	-	20,855	16,798	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ACCIONA SA	ES0125203111	903.000	EUR	79,080	71.409,24	1,00000	71.409,24	-	-	-	-	-	-	-	79,080	67,551	1,00000	1,00000	-	-	Equity
IBERDROLA SA	ES0144580Y14	5.005.000	EUR	6,550	32.782,75	1,00000	32.782,75	-	-	-	-	-	-	-	6,550	5,640	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	ES0148396007	2.308.000	EUR	31,690	73.140,52	1,00000	73.140,52	-	-	-	-	-	-	-	31,690	27,281	1,00000	1,00000	-	-	Equity
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	ES0177542018	12.018.000	GBP	6,105	73.369,89	0,73705	99.545,34	-	-	-	-	-	-	-	6,105	5,699	0,73705	0,71874	-	-	Equity
TELEFONICA SA	ES0178430E18	129.000	EUR	10,235	1.320,31	1,00000	1.320,31	-	-	-	-	-	-	-	10,235	9,438	1,00000	1,00000	-	-	Equity
NOKIA OYJ	FI0009000681	27.784.000	EUR	6,595	183.235,48	1,00000	183.235,48	-	-	-	-	-	-	-	6,595	6,401	1,00000	1,00000	-	-	Equity
CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	2.828.000	EUR	10,880	30.768,64	1,00000	30.768,64	-	-	-	-	-	-	-	10,880	11,492	1,00000	1,00000	-	-	Equity
TOTAL SA	FR0000120271	2.434.000	EUR	41,265	100.439,01	1,00000	100.439,01	-	-	1.039,32	-	-	-	-	41,265	45,600	1,00000	1,00000	-	-	Equity
ACCOR SA	FR0000120404	1.114.000	EUR	40,005	44.565,57	1,00000	44.565,57	-	-	-	-	-	-	-	40,005	38,321	1,00000	1,00000	-	-	Equity
AXA SA	FR0000120628	6.340.000	EUR	25,230	159.958,20	1,00000	159.958,20	-	-	-	-	-	-	-	25,230	22,423	1,00000	1,00000	-	-	Equity
DANONE	FR0000120644	1.481.000	EUR	62,280	92.236,68	1,00000	92.236,68	-	-	-	-	-	-	-	62,2						

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pendng	dividendi_pending	debiti_pendng	saldo_mar_gini	esposizione_globale_tramite_futur es_lc	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_ratin_g_campo_site_blm	duration	den_categoria_strumento	
RANDGOLD RESOURCES LTD	GB00801CS32	1.555.000	GBP	41,430	64.423,65	0,73705	87.407,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	41,430	41,013	0,73705	0,73655	-	-	Equity	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	GB00803MLX29	6.641.000	EUR	21,095	140.091,89	1,00000	140.091,89	-	-	-	-	-	-	Azioni	21,095	23,139	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	GB00803MM408	4.588.000	GBP	15,430	70.792,84	0,73705	96.048,90	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,430	19,089	0,73705	0,74016	-	-	Equity	
BRITVIC PLC	GB00808N8QD54	7.344.000	GBP	7,275	53.427,60	0,73705	72.488,43	-	-	1.624,14	-	-	-	Azioni	7,275	7,304	0,73705	0,78487	-	-	Equity	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	GB00824CGK77	1.216.000	GBP	62,810	76.376,96	0,73705	103.625,21	-	-	-	-	-	-	Azioni	62,810	51,223	0,73705	0,78272	-	-	Equity	
DIXONS CARPHONE PLC	GB0084Y7R145	11.388.000	GBP	5,000	56.940,00	0,73705	77.253,92	-	-	502,15	-	-	-	Azioni	5,000	4,486	0,73705	0,72032	-	-	Equity	
VODAFONE GROUP PLC	GB0084H4KS39	57.790.000	GBP	2,210	127.715,90	0,73705	173.279,83	-	-	-	3.120,40	-	-	Azioni	2,210	2,248	0,73705	0,72380	-	-	Equity	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	GB008N33FD40	1.210.000	GBP	26,580	32.161,80	0,73705	43.635,85	-	-	-	-	-	-	Azioni	26,580	25,110	0,73705	0,72555	-	-	Equity	
INDIVIOR PLC	GB008RS65X63	1.482.000	GBP	1,878	2.783,20	0,73705	3.776,13	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,878	1,135	0,73705	0,78450	-	-	Equity	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	GB008Y9DDY18	9.318.000	GBP	4,075	37.970,85	0,73705	51.517,33	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,075	3,178	0,73705	0,70845	-	-	Equity	
CRH PLC	IE0001827041	1.610.000	EUR	26,700	42.987,00	1,00000	42.987,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	26,700	26,279	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
ACCENTURE PLC-CL A	IE0084BNM334	242.000	USD	104,500	25.289,00	1,08630	23.279,94	-	-	-	-	-	-	Azioni	104,500	102,536	1,08630	1,09655	-	-	Equity	
MEDTRONIC PLC	IE008TN1Y115	1.149.000	USD	76,920	88.381,08	1,08630	81.359,73	-	-	321,55	-	-	-	Azioni	76,920	73,338	1,08630	1,14012	-	-	Equity	
WPP PLC	JE0088K9B49	5.083.000	GBP	15,630	79.447,29	0,73705	107.790,91	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,630	13,862	0,73705	0,76851	-	-	Equity	
KONINKLIJKE KPN NV	NL0000009082	15.259.000	EUR	3,492	53.284,43	1,00000	53.284,43	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,492	3,381	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
HEINEKEN NV	NL0000009165	980.000	EUR	78,770	77.194,60	1,00000	77.194,60	-	-	-	-	-	-	Azioni	78,770	76,657	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
UNILEVER NV-CVA	NL0000009355	4.347.000	EUR	40,105	174.336,44	1,00000	174.336,44	-	-	-	-	-	-	Azioni	40,105	36,481	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	NL0000009538	3.143.000	EUR	23,560	74.049,08	1,00000	74.049,08	-	-	-	-	-	-	Azioni	23,560	25,541	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
KONINKLIJKE DSM NV	NL0000009827	1.555.000	EUR	46,280	71.985,40	1,00000	71.985,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,280	52.194	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
AIRBUS GROUP SE	NL0000235190	1.315.000	EUR	62,000	81.530,00	1,00000	81.530,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	62,000	58,612	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
ING GROEP NV-CVA	NL0000303600	8.448.000	EUR	12,450	80.290,05	1,00000	80.290,05	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,450	11,910	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
RELX NV	NL0006144495	5.117.000	EUR	15,540	79.518,18	1,00000	79.518,18	-	-	-	-	-	-	Azioni	15,540	14,014	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
NXP SEMICONDUCTORS NV	NL0009538784	713.000	USD	84,250	60.070,25	1,08630	55.298,03	-	-	-	-	-	-	Azioni	84,250	73,668	1,08630	1,24485	-	-	Equity	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	SE0010877643	4.161.000	EUR	12,920	53.760,12	1,00000	53.760,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	12,920	13,047	1,00000	1,00000	-	-	Equity	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	SE0000148884	8.933.000	SEK	89,400	798.610,20	9,15815	87.202,13	-	-	-	-	-	-	Azioni	89,400	92,188	9,15815	9,22981	-	-	Equity	
SANDVIK AB	SE0000667891	3.607.000	SEK	74,050	267.098,35	9,15815	29.165,10	-	-	-	-	-	-	Azioni	74,050	83,245	9,15815	9,37135	-	-	Equity	
ASSA ABLOY AB-B	SE0007100581	1.147.000	SEK	178,000	204.166,00	9,15815	22.293,37	-	-	-	-	-	-	Azioni	178,000	175,741	9,15815	9,37540	-	-	Equity	
Totale I.G - TCapitale Q UE							8.371.598,46															
UNICREDIT SPA 19/06/2019 1,5	XS1078760813	300.000.000	EUR	102,096	306.288,00	1,00000	306.288,00	2.397,54	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,096	100,911	1,00000	1,00000	BBB	3,38	Corp	
INTESA SANPAOLO SPA 14/01/2020 1,125	XS1168003900	300.000.000	EUR	100,464	301.392,00	1,00000	301.392,00	3.245,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,464	98,726	1,00000	1,00000	BBB	3,93	Corp	
Totale I.G - TDebito Q IT							607.680,09															
MERCK FIN SERVICES GMBH 24/03/2020 4,5	XS0497186758	100.000.000	EUR	116,333	116.333,00	1,00000	116.333,00	3.467,21	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,333	114,041	1,00000	1,00000	A-	3,86	Corp	
TELEFONICA EMISIONES SAU 03/02/2016 4,967	XS0696856847	100.000.000	EUR	100,385	100.385,00	1,00000	100.385,00	4.504,32	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,385	107,522	1,00000	1,00000	BBB	0,09	Corp	
Totale I.G - TDebito Q UE							216.718,00	9.791,53														
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2039 5	IT0004286966	210.000.000	EUR	142,791	299.861,52	1,00000	299.861,52	4.336,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	142,791	124,213	1,00000	1,00000	NR	15,53	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2020 4,25	IT0004536949	350.000.000	EUR	115,726	405.039,95	1,00000	405.039,95	4.944,71	-	-	-	-	-	Obbligazioni	115,726	115,496	1,00000	1,00000	NR	3,85	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2021 2,1	IT0004604671	570.000.000	EUR	120,784	688.470,11	1,00000	688.470,11	3.816,89	-	-	-	-	-	Obbligazioni	120,784	119,830	1,00000	1,00000	NR	5,42	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2026 3,1	IT0004735152	470.000.000	EUR	132,567	623.067,17	1,00000	623.067,17	4.547,71	-	-	-	-	-	Obbligazioni	132,567	129,361	1,00000	1,00000	NR	9,38	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2028 4,75	IT0004889033	320.000.000	EUR	131,762	421.639,36	1,00000	421.639,36	5.052,75	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,762	129,106	1,00000	1,00000	NR	10,00	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/06/2018 3,5	IT0004907843	710.000.000	EUR	108,205	768.253,37	1,00000	768.253,37	2.036,89	-	-	-	-	-	Obbligazioni	108,205	108,819	1,00000	1,00000	NR	2,34	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2019 1,5	IT0005030504	710.000.000	EUR	104,183	739.695,75	1,00000	739.695,75	4.398,91	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,183	103,539	1,00000	1,00000	NR	3,49	Govt	
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/01/2018 7,5	IT0005058463	300.000.000	EUR	101,473	304.419,90	1,00000	304.419,90	1.033,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,473	100,989	1,00000	1,00000	NR	2,03	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 12/02/2016 ZERO COUPON	IT0005086068	750.000.000	EUR	100,019	750.139,50	1,00000	750.139,50	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,019	99,940	1,00000	1,00000	NR	0,12	Govt	
CERT DI CREDITO DEL TES 27/02/2017 ZERO COUPON	IT0005089955	2.130.000.000	EUR	100,043	2.130.920,16	1,00000	2.130.920,16	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,043	99,983	1,00000	1,00000	NR	1,16	Govt	
BUONI ORDINARI DEL TES 14/03/2016 ZERO COUPON	IT0005091472	1.040.000.000	EUR	100,040	1.040.416,00	1,00000	1.040.416,00	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,040	99,989	1,00000	1,00000	NR	0,20	Govt	
Totale I.G - TStato Org.Int Q IT							8.171.922,79	30.168,11														
REPUBLIC OF AUSTRIA 15/09/2021 3,5	AT0000A001X2	320.000.000	EUR	119,190	381.408,00	1,00000	381.408,00	3.274,32	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,190	112,884	1,00000	1,00000	AA+	5,28	Govt	
REPUBLIC OF AUSTRIA 20/10/2025 1,2	AT0000A1FAP5	270.000.000	EUR	102,835	277.654,50	1,00000	277.654,50	1.690,82	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,835	103,316	1,00000	1,00000	AA+	9,27	Govt	
BELGIUM KINGDOM 28/09/2020 3,75	BE0000318270	620.000.000	EUR	117,625	729.275,00	1,00000	729.275,00	5.971,31	-	-	-	-	-	Obbligazioni	117,625	114,284	1,00000	1,00000	AA-	4,43	Govt	
BELGIUM KINGDOM 22/06/2034 3	BE0000333428	220.000.000	EUR	119,883	263.742,60	1,00000	263.742,60	3.462,30	-	-	-	-	-	Obbligazioni	119,883	115,681	1,00000	1,00000	NR	14,67	Govt	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/09/2020 2,25	DE0001135416	250.000.000	EUR	110,820	277.050,00	1,00000	277.050,00	1.813,52	-	-	-	-	-	Obbligazioni	110,820	110,736	1,00000	1,00000	NR	4,48	Govt	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/07/2042 3,25	DE0001135432	3																				

FONDO PENSIONE GRUPPO CARIPARMA CREDIT AGRICOLE																						
TITOLI DELLA LINEA ORIZZONTE 30 AL 31.12.2015																						
GESTORE DUEMME																						
don strumento finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures_ic	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_bim	duration	den_categoria_strumento	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc AUD		33.784.740	AUD	1,000	33.784.74	1,49305	22.628,00	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,49305	1,51731	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc CAD		24.791.310	CAD	1,000	24.791,31	1,50895	15.429,51	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,50895	1,51821	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc CHF		280.191.880	CHF	1,000	280.191,88	1,08740	257.671,40	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08740	1,08501	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc DKK		1.208.970	DKK	1,000	1.208,97	7,46265	162,00	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	7,46265	7,44406	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc EUR		719.594.520	EUR	1,000	719.594,52	1,00000	719.594,52	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,00000	1,00000	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc GBP		20.198.690	GBP	1,000	20.198,69	0,73705	27.404,78	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	0,73705	0,73393	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc HKD		372.829.150	HKD	1,000	372.829,15	8,41895	44.284,52	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	8,41895	9,17553	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc JPY		5.732.030.000	JPY	1,000	5.732.030,00	130,67645	43.864,29	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	130,67645	132,69923	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc NOK		2.260.620	NOK	1,000	2.260,62	9,61525	235,11	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,61525	7,69927	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc SEK		1.454.110.950	SEK	1,000	1.454.110,95	9,91581	158.777,80	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	9,91581	9,43183	-	-	-	
CARIPARMA ORIZ 30 DUEMME cc USD		16.837.700	USD	1,000	16.837,70	1,08630	15.500,05	-	-	-	-	-	-	Banca c/c	1,000	1,000	1,08630	1,09654	-	-	-	
Totale I.G - Depositi Bancari							1.306.551,98															
Forward su cambi: vendita EUR, acquisto CHF	FWDCAMEURCHF	282.990	EUR	1,000	282,99	1,00000	282,99	-	-	-	-	-	-	Forward su c	1,000	-	1,00000	-	-	-	-	
Totale I.G - Forward su cambi							282,99															
EURO FX CURR FUT Mar16	ECH6 Curncy	8.000	USD	1,089	2.800,00	1,08630	2.577,56	-	5,063,06	-	-	2.761,67	-	1.002.117,28	Futures	1,091	1,091	1,09625	1,09625	-	-	Curncy
S&P500 EMINI FUT Mar16	ESH6 Index	53.000	USD	2,035,400	107.153,07	1,08630	98.640,40	-	58.547,36	-	-	44.398,42	-	145.478,29	Futures	1,994,965	1,994,965	1,10275	1,10275	-	-	Index
S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	PTH6 Index	3.000	CAD	760,900	7.152,00	1,50895	4.739,72	-	-	-	4.453,43	-	7.761,69	Futures	748,980	748,980	1,51615	1,51615	-	-	-	Index
OMX50 IND FUTURE Jan16	QFH6 Index	2.000	SEK	1.448,000	775,27	1,50815	9.581,55	-	398,55	-	300,27	-	775,27	Futures	1.412,500	1.412,500	9,28175	9,28175	-	-	-	Index
EURO/GBP FUTURE Mar16	RPH6 Curncy	11.000	GBP	0,739	15.990,62	0,73705	20.474,35	-	2.238,65	-	466,39	-	18.608,51	Futures	0,728	0,728	0,72240	0,72240	-	-	-	Curncy
SWISS MKT IX FUTR Mar16	SML6 Index	23.000	CHF	8,746	78.990,00	1,08740	72.549,20	-	31.727,06	-	-	9.729,63	-	32.549,20	Futures	8,403,650	8,403,650	1,08165	1,08165	-	-	Index
EURO STOXX 50 Mar16	VGH6 Index	76.000	EUR	3,282,000	38.481,64	1,00000	38.481,64	-	-	-	-	-	-	38.481,64	Futures	3,231,366	3,231,366	1,00000	1,00000	-	-	Index
SPI 200 FUTURES Mar16	XPH6 Index	1.000	AUD	5,257,000	7,925,00	1,49305	5,307,93	-	2,277,21	-	-	-	-	5,860,49	Futures	4,940,000	4,940,000	1,52325	1,52325	-	-	Index
FTSE 100 IDX FUT Mar16	Z H6 Index	46.000	GBP	6,198,000	123.280,00	0,73705	167.261,38	-	25.588,49	-	16.850,96	-	184.736,45	Futures	5,930,000	5,930,000	0,72580	0,72580	-	-	-	Index
Totale I.G - Futures							369.858,75		125.840,38		-76.199,10		434.272,55	11.219.480,66								
ASSICURAZIONI GENERALI	IT000062072	6.660.000	EUR	16,920	112.687,20	1,00000	112.687,20	-	-	-	-	-	-	Azioni	16,920	16,673	1,00000	1,00000	-	-	-	Equity
UNIPOLSAI SPA	IT0004827447	49.084.000	EUR	2,360	115.838,24	1,00000	115.838,24	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,360	2,343	1,00000	1,00000	-	-	-	Equity
Totale I.G - TCapitale Q IT							228.525,44															
SCHLUMBERGER LTD	AN8068571086	375.000	USD	69,750	26.156,25	1,08630	24.078,29	-	-	172,60	-	-	-	Azioni	69,750	83,026	1,08630	1,18209	-	-	-	Equity
GARMIN LTD	CH0114405324	1.826.000	USD	37,170	67.872,42	1,08630	62.480,36	-	-	-	-	-	-	Azioni	37,170	37,876	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
NIELSEN HOLDINGS PLC	GB00BWFY5505	599.000	USD	46,600	27.913,40	1,08630	25.695,85	-	-	-	-	-	-	Azioni	46,600	45,815	1,08630	1,12493	-	-	-	Equity
AISIN SEIKI CO LTD	JP310200001	800.000	JPY	5,240,000	4.192.000,00	130,67645	32.079,23	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.240,000	5.634,915	130,67645	138,67305	-	-	-	Equity
SMC CORP	JP316260005	100.000	JPY	31.770,000	3.177.000,00	130,67645	24.311,96	-	-	-	-	-	-	Azioni	31.770,000	18.391,430	130,67645	123,49000	-	-	-	Equity
NTT DATA CORP	JP316570000	800.000	JPY	5.880,000	4.704.000,00	130,67645	35.997,30	-	-	-	-	-	-	Azioni	5.880,000	5.376,529	130,67645	135,93015	-	-	-	Equity
OTSUKA CORP	JP318200004	800.000	JPY	5.960,000	4.768.000,00	130,67645	36.487,06	-	-	492,52	-	-	-	Azioni	5.960,000	4.736,768	130,67645	135,11480	-	-	-	Equity
KAJIMA CORP	JP321020006	8.000.000	JPY	724,000	5.792.000,00	130,67645	44.323,21	-	-	-	-	-	-	Azioni	724,000	575,120	130,67645	138,67305	-	-	-	Equity
KEYENCE CORP	JP323620006	1.000.000	JPY	67.080,000	6.708.000,00	130,67645	51.332,89	-	-	-	-	-	-	Azioni	67.080,000	53.609,948	130,67645	136,95475	-	-	-	Equity
KOITO MANUFACTURING CO LTD	JP328460008	1.000.000	JPY	5,010,000	5,010.000,00	130,67645	38.338,97	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,010,000	4.369,900	130,67645	135,60815	-	-	-	Equity
JTEKT CORP	JP329200007	1.600.000	JPY	2,005,000	3.208.000,00	130,67645	24.549,18	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,005,000	2.272,320	130,67645	131,48575	-	-	-	Equity
KONAMI HOLDINGS CORP	JP330020007	1.800.000	JPY	2,888,000	5.198.400,00	130,67645	39.793,69	-	-	-	-	-	-	Azioni	2.888,000	2.032,734	130,67645	136,95475	-	-	-	Equity
CYBERDYNE INC	JP3311530004	2.000.000	JPY	2,046,000	4.092.000,00	130,67645	31.313,98	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,046,000	1.594,650	130,67645	139,95619	-	-	-	Equity
NIPPON STEEL & SUMITOMO META	JP338100003	1.100.000	JPY	2,416,000	2.657.600,00	130,67645	20.337,25	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,416,000	553,017	130,67645	140,22548	-	-	-	Equity
JFE HOLDINGS INC	JP3386030005	1.800.000	JPY	1,920,000	3.456.000,00	130,67645	26.447,00	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,920,000	2.147,983	130,67645	137,38675	-	-	-	Equity
SONY CORP	JP343500009	1.200.000	JPY	3,002,000	3.602.400,00	130,67645	27.567,32	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,002,000	3,096,920	130,67645	135,53115	-	-	-	Equity
DAIICHI LIFE INSURANCE	JP3476480003	2.000.000	JPY	2,035,000	4.070.000,00	130,67645	31.145,63	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,035,000	2.134,120	130,67645	132,90610	-	-	-	Equity
DAIKIN INDUSTRIES LTD	JP3481800005	500.000	JPY	8,901,000	4.450.500,00	130,67645	34.057,40	-	-	-	-	-	-	Azioni	8,901,000	8,051,608	130,67645	136,95475	-	-	-	Equity
DAIFUKU CO LTD	JP3497400006	2.600.000	JPY	2,075,000	5.395.000,00	130,67645	41.285,17	-	-	-	-	-	-	Azioni	2,075,000	1.292,145	130,67645	139,29520	-	-	-	Equity
DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	JP3505000004	1.300.000	JPY	3,503,000	4.553.900,00	130,67645	34.848,67	-	-	-	-	-	-	Azioni	3,503,000	3,106,140	130,67645	135,60815	-	-	-	Equity
DENSO CORP	JP3551500006	700.000	JPY	5,818,000	4.072.600,00	130,67645	31.165,52	-	-	-	-	-	-	Azioni	5,818,000	5,602,860	130,67645	135,60815	-	-	-	Equity
NISSAN MOTOR CO LTD	JP3672400003	3.100.000	JPY	1,279,500	3.966.450,00	130,67645	30.353,21	-	-	-	-	-	-	Azioni	1,279,500	1,050,107	130,67645	139,29520	-	-	-	Equity
JAPAN STEEL WORKS LTD	JP3721400004	10.000.000	JPY	427,000	4.270.000,00	130,67645	32.676,12	-	-	-	-	-	-	Azioni	427,000	405,852	130,67645	135,90413	-	-	-	Equity
HIMACHAL RESEARCH INSTITUTE LT	JP3762800005	1.100.000	JPY	4,670,000	5.137.000,00	130,67645	39.310,83	-	-	-	-	-	-	Azioni	4,670,000							

den_strumento_finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures_lc	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_blm	duration	den_categoria_strumento	
CONSOLIDATED EDISON INC	US2091151041	1.098.000	USD	64,270	70.568,46	1,08630	64.962,22	-	-	-	-	-	-	-	64,270	62,791	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
DTE ENERGY COMPANY	US233311072	360.000	USD	80,190	28.868,40	1,08630	26.574,98	-	-	205,63	-	-	-	-	80,190	78,057	1,08630	1,26489	-	-	-	Equity
DELTA AIR LINES INC	US2473617023	1.264.000	USD	50,690	64.072,16	1,08630	58.982,01	-	-	-	-	-	-	-	50,690	42,928	1,08630	1,12691	-	-	-	Equity
DOLLAR TREE INC	US2567461080	851.000	USD	77,220	65.714,22	1,08630	60.493,62	-	-	-	-	-	-	-	77,220	63,555	1,08630	1,18519	-	-	-	Equity
DUKE ENERGY CORP	US26441C2044	434.000	USD	71,390	30.983,26	1,08630	28.521,83	-	-	-	-	-	-	-	71,390	75,463	1,08630	1,13170	-	-	-	Equity
ENERGY CORP	US235451031	944.000	USD	68,360	64.531,84	1,08630	59.405,17	-	-	-	-	-	-	-	68,360	64,031	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
EXXON MOBIL CORP	US30231G1022	415.000	USD	77,950	32.349,25	1,08630	29.779,30	-	-	-	-	-	-	-	77,950	82,156	1,08630	1,08935	-	-	-	Equity
FACEBOOK INC-A	US30303M1027	296.000	USD	104,660	30.879,36	1,08630	28.518,24	-	-	-	-	-	-	-	104,660	63,506	1,08630	1,36150	-	-	-	Equity
FIFTH THIRD BANCORP	US3167731005	1.496.000	USD	20,100	30.069,60	1,08630	27.680,75	-	-	152,18	-	-	-	-	20,100	19,982	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
FORD MOTOR CO	US3453708600	4.304.000	USD	14,090	60.643,36	1,08630	55.825,61	-	-	-	-	-	-	-	14,090	15,407	1,08630	1,10395	-	-	-	Equity
FRANKLIN RESOURCES INC	US3546131018	698.000	USD	36,820	25.700,36	1,08630	23.668,62	-	-	98,31	-	-	-	-	36,820	46,819	1,08630	1,24053	-	-	-	Equity
GAP INC/THE	US3647601083	850.000	USD	24,700	20.995,00	1,08630	19.327,07	-	-	-	-	-	-	-	24,700	37,428	1,08630	1,21083	-	-	-	Equity
GENERAL MOTORS CO	US370451V008	966.000	USD	34,010	32.853,66	1,08630	30.243,63	-	-	-	-	-	-	-	34,010	32,159	1,08630	1,17156	-	-	-	Equity
HALLIBURTON CO	US4062161017	805.000	USD	34,040	27.402,20	1,08630	25.225,26	-	-	-	-	-	-	-	34,040	38,282	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
HERSHEY CO/THE	US4278661081	657.000	USD	89,270	58.650,39	1,08630	53.990,97	-	-	-	-	-	-	-	89,270	93,033	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
HESS CORP	US42809H1077	526.000	USD	48,480	25.500,48	1,08630	23.474,62	-	-	-	-	-	-	-	48,480	53,244	1,08630	1,16074	-	-	-	Equity
HOME DEPOT INC	US4370761029	517.000	USD	132,250	68.373,25	1,08630	62.941,41	-	-	-	-	-	-	-	132,250	116,527	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	US4385161066	299.000	USD	103,570	30.967,43	1,08630	28.507,25	-	-	-	-	-	-	-	103,570	100,751	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN KEYCORP	US45866F1049	127.000	USD	256,260	32.545,02	1,08630	29.959,51	-	-	-	-	-	-	-	256,260	230,182	1,08630	1,12194	-	-	-	Equity
KIMBERLY-CLARK CORP	US4932671088	2.180.000	USD	13,190	28.754,20	1,08630	26.469,85	-	-	-	-	-	-	-	13,190	13,370	1,08630	1,25336	-	-	-	Equity
KIMBERLY-CLARK CORP	US4943681035	263.000	USD	127,300	33.479,90	1,08630	30.820,12	-	-	181,09	-	-	-	-	127,300	110,093	1,08630	1,18467	-	-	-	Equity
KOHLER CORP	US5002551043	1.216.000	USD	47,630	57.918,08	1,08630	53.316,84	-	-	-	-	-	-	-	47,630	48,139	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
KROGER CO	US5010441013	731.000	USD	41,830	30.577,73	1,08630	28.148,51	-	-	-	-	-	-	-	41,830	21,407	1,08630	1,18048	-	-	-	Equity
LAM RESEARCH CORP	US5128071092	883.000	USD	79,420	70.127,86	1,08630	64.556,62	-	-	207,28	-	-	-	-	79,420	76,846	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
LMCO	US524311058	1.894.000	USD	30,640	57.900,86	1,08630	51.852,03	-	-	138,03	-	-	-	-	30,640	43,362	1,08630	1,12630	-	-	-	Equity
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	US52729N3089	1.345.000	USD	54,360	73.114,20	1,08630	67.305,72	-	-	-	-	-	-	-	54,360	50,812	1,08630	1,08935	-	-	-	Equity
LI LILLY & CO	US5324571083	723.000	USD	84,260	60.819,98	1,08630	56.080,25	-	-	-	-	-	-	-	84,260	85,947	1,08630	1,10765	-	-	-	Equity
LOCKHEED MARTIN CORP	US5398301094	132.000	USD	217,150	28.863,80	1,08630	26.386,63	-	-	-	-	-	-	-	217,150	148,434	1,08630	1,24448	-	-	-	Equity
MACERICH CO/THE	US543821012	398.000	USD	80,690	32.114,62	1,08630	29.563,31	-	-	1.245,70	-	-	-	-	80,690	76,014	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
MASTERCARD INC-CLASS A	US57636Q1040	402.000	USD	97,360	39.138,72	1,08630	36.029,38	-	-	-	-	-	-	-	97,360	94,453	1,08630	1,12630	-	-	-	Equity
MICRON TECHNOLOGY INC	US5951121038	1.639.000	USD	14,160	23.208,24	1,08630	21.364,48	-	-	-	-	-	-	-	14,160	12,172	1,08630	1,14702	-	-	-	Equity
NORTHROP GRUMMAN CORP	US6668071029	307.000	USD	188,810	57.964,67	1,08630	53.359,73	-	-	-	-	-	-	-	188,810	187,378	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	US67103H1077	252.000	USD	253,420	63.861,84	1,08630	58.788,40	-	-	-	-	-	-	-	253,420	272,624	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
PPG INDUSTRIES INC	US6935061076	290.000	USD	98,820	28.657,80	1,08630	26.381,11	-	-	-	-	-	-	-	98,820	97,829	1,08630	1,25741	-	-	-	Equity
PARKER HANNIFIN CORP	US7010941042	586.000	USD	96,980	56.830,28	1,08630	52.315,46	-	-	-	-	-	-	-	96,980	98,240	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
PAYCHEX INC	US7043261079	1.557.000	USD	52,890	82.349,73	1,08630	75.807,54	-	-	-	-	-	-	-	52,890	48,936	1,08630	1,12630	-	-	-	Equity
T ROWE PRICE GROUP INC	US74144T1088	783.000	USD	71,490	55.976,67	1,08630	51.529,66	-	-	-	-	-	-	-	71,490	73,644	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
PUBLIC STORAGE	US74460D1090	135.000	USD	247,700	33.439,50	1,08630	30.782,93	-	-	-	-	-	-	-	247,700	183,434	1,08630	1,24278	-	-	-	Equity
QUEST DIAGNOSTICS INC	US74834L1008	898.000	USD	71,140	63.883,72	1,08630	58.808,54	-	-	-	-	-	-	-	71,140	67,614	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
REPUBLIC SERVICES INC	US7607591002	1.304.000	USD	43,990	57.362,96	1,08630	52.805,82	-	-	306,10	-	-	-	-	43,990	44,211	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
REYNOLDS AMERICAN INC	US7617131062	845.000	USD	46,150	38.996,75	1,08630	35.898,69	-	-	238,03	-	-	-	-	46,150	45,224	1,08630	1,12630	-	-	-	Equity
SOUTHWEST AIRLINES CO	US8447411088	1.288.000	USD	43,060	55.461,28	1,08630	51.055,21	-	-	-	-	-	-	-	43,060	45,145	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
SPECTRA ENERGY CORP	US8475601097	2.398.000	USD	23,940	57.408,12	1,08630	52.847,39	-	-	-	-	-	-	-	23,940	24,103	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
STARBUCKS CORP	US852241094	484.000	USD	60,030	29.054,52	1,08630	26.746,31	-	-	-	-	-	-	-	60,030	38,556	1,08630	1,33655	-	-	-	Equity
SMC CO	US857691010	150.000	USD	150,640	29.224,16	1,08630	26.902,44	-	-	-	-	-	-	-	150,640	150,640	1,08630	1,26193	-	-	-	Equity
TIME WARNER CABLE	US88732J2078	146.000	USD	185,590	27.086,14	1,08630	24.943,50	-	-	85,68	-	-	-	-	185,590	108,391	1,08630	1,22567	-	-	-	Equity
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	US90130A2006	1.982.000	USD	27,230	53.969,86	1,08630	49.682,28	-	-	-	-	-	-	-	27,230	29,086	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
UNITEDHEALTH GROUP INC	US91324P1021	499.000	USD	117,640	58.702,36	1,08630	54.038,81	-	-	-	-	-	-	-	117,640	115,907	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
VENTAS INC	US92276F1003	561.000	USD	56,430	31.657,23	1,08630	29.142,25	-	-	-	-	-	-	-	56,430	54,561	1,08630	1,12955	-	-	-	Equity
VERIZON COMMUNICATIONS INC	US92343V1044	1.502.000	USD	46,220	69.422,44	1,08630	63.907,24	-	-	-	-	-	-	-	46,220	45,135	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
VIACOM INC-CLASS B	US92553P2011	1.307.000	USD	41,160	53.796,12	1,08630	49.522,34	-	-	409,08	-	-	-	-	41,160	44,317	1,08630	1,09370	-	-	-	Equity
WELLS FARGO & CO	US9497461015	1.226.000	USD	54,360	66.645,36	1,08630	61.350,79	-	-	-	-	-	-	-	54,360	55,569	1,08630	1,06935	-	-	-	Equity
YUM! BRANDS INC	US9884981013	338.000	USD	73,050	24.690,90	1,0863																

den strumento finanziario	cod_isin	imp_nominale_totale	cod_divisa	prezzo	valore_divisa	tasso_cambio	imp_valore	rateo	crediti_pending	dividendi_pending	debiti_pending	saldo_margini	esposizione_globale_tramite_futures_lc	den_sezione	prezzo_carico	prezzo_storico	tasso_cambio_carico	tasso_cambio_storico	cod_rating_compositivo_blm	duration	den_categoria_strumento
Totale I.G - TDebito Q IT							413.125,70	1.485,66													
GOLDMAN SACHS GROUP INC 16/03/2017 4.375	XS0494996043	350.000.000	EUR	104,979	367.426,50	1,00000	367.426,50	12.132,86	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,979	108,942	1,00000	1,00000	A-	1,17	Corp
NATIONAL AUSTRALIA BANK 19/07/2016 FLOATING	XS0954026661	100.000.000	EUR	100,112	100.112,00	1,00000	100.112,00	50,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,112	100,096	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
JPMORGAN CHASE & CO 19/02/2017 FLOATING	XS1034975988	200.000.000	EUR	100,214	200.428,00	1,00000	200.428,00	71,87	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,214	100,215	1,00000	1,00000	A-	0,50	Corp
NATIONAL AUSTRALIA BANK 16/01/2018 FLOATING	XS1167324596	200.000.000	EUR	99,916	199.832,00	1,00000	199.832,00	97,53	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,916	100,000	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
Totale I.G - TDebito Q OCSE							967.798,50	12.352,55													
KFW 19/01/2016 6	AU0000KFWHP6	500.000.000	AUD	100,130	500.650,00	1,49305	335.320,32	9.009,14	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,130	102,892	1,49305	1,38330	AAA	0,05	Corp
FMS WERTMANAGEMENT 18/04/2016 625	US30254WA854	400.000.000	USD	99,982	399.928,00	1,08630	368.156,13	460,28	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,982	100,100	1,08630	1,11855	AAA	0,30	Corp
GE CAPITAL INTL FUNDING 15/04/2016 964	US36164PFEE51	372.000.000	USD	100,042	372.156,24	1,08630	342.590,67	586,88	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,042	101,357	1,08630	1,10485	AA-	0,29	Corp
KFV 01/06/2016 2	US500769EM26	350.000.000	USD	100,493	351.725,50	1,08630	323.783,02	519,09	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,493	101,100	1,08630	1,11855	AAA	0,43	Corp
GE CAPITAL EURO FUNDING 22/02/2016 FLOATING	XS0245166367	170.000.000	EUR	100,016	170.027,20	1,00000	170.027,20	10,41	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,016	98,300	1,00000	1,00000	AA-	0,50	Corp
KFW 07/09/2016 3,75	XS0433107041	1.300.000.000	GBP	102,194	1.328.522,00	0,73705	1.802.485,58	20.782,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,194	102,556	0,73705	0,71508	AAA	0,69	Corp
BK NEDERLANDSE GEMEENTEN 20/01/2016 3	XS0577454951	130.000.000	CAD	100,082	130.106,60	1,50895	86.223,27	2.442,96	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,082	98,619	1,50895	1,35720	AA+	0,05	Corp
LANDWIRTSCH. RENTENBANK 07/12/2016 3,25	XS0587975961	950.000.000	GBP	102,432	973.104,00	0,73705	1.320.268,64	2.746,88	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,432	103,410	0,73705	0,70948	AAA	0,94	Corp
KFW 05/07/2016 7,5	XS0800582339	250.000.000	USD	99,986	249.965,00	1,08630	230.106,78	839,05	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,986	100,273	1,08630	1,12630	AAA	0,52	Corp
NEDER WATERSCHAPS BANK 04/03/2016 5	XS1105489071	1.000.000.000	USD	99,983	999.830,00	1,08630	920.399,52	1.483,12	-	-	-	-	-	Obbligazioni	99,983	100,044	1,08630	1,11925	AAA	0,18	Corp
Totale I.G - TDebito Q UE							5.899.361,13	38.880,14													
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2029 5,25	IT0001278511	420.000.000	EUR	138,728	582.658,02	1,00000	582.658,02	3.634,62	-	-	-	-	-	Obbligazioni	138,728	134,329	1,00000	1,00000	NR	10,60	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/08/2034 5	IT0003535157	6.500.000	EUR	140,034	9.102,21	1,00000	9.102,21	134,24	-	-	-	-	-	Obbligazioni	140,034	99,250	1,00000	1,00000	NR	13,20	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2020 4,5	IT0003644769	500.000	EUR	116,478	582,39	1,00000	582,39	9,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	116,478	100,467	1,00000	1,00000	NR	3,75	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2017 4	IT0004164775	150.000.000	EUR	104,339	156.507,90	1,00000	156.507,90	2.478,26	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,339	105,303	1,00000	1,00000	NR	1,06	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/02/2018 4,5	IT0004273493	500.000	EUR	109,251	546,26	1,00000	546,26	9,29	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,251	101,324	1,00000	1,00000	NR	1,99	Govt
CERT DI CREDITO DEL TES 01/03/2017 FLOATING	IT0004584204	2.000.000.000	EUR	100,383	2.007.668,00	1,00000	2.007.668,00	1.994,51	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,383	100,345	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/03/2021 3,75	IT0004634132	500.000.000	EUR	115,447	577.232,50	1,00000	577.232,50	6.232,83	-	-	-	-	-	Obbligazioni	115,447	110,786	1,00000	1,00000	NR	4,73	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 15/09/2016 2,1	IT0004682107	1.300.000.000	EUR	109,717	1.413.326,41	1,00000	1.413.326,41	8.601,78	-	-	-	-	-	Obbligazioni	109,717	109,260	1,00000	1,00000	NR	0,70	Govt
CCTS EU 15/04/2018 FLOATING	IT0004716319	1.900.000.000	EUR	102,056	1.939.054,50	1,00000	1.939.054,50	4.169,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,056	102,445	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 28/03/2016 2,45	IT0004808888	1.550.000.000	EUR	100,548	1.558.456,41	1,00000	1.558.456,41	10.013,18	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,548	102,746	1,00000	1,00000	NR	0,24	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2022 5,5	IT0004848831	500.000.000	EUR	128,911	644.554,50	1,00000	644.554,50	4.532,97	-	-	-	-	-	Obbligazioni	128,911	107,406	1,00000	1,00000	NR	5,90	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 22/10/2016 2,55	IT0004863608	1.500.000.000	EUR	101,915	1.528.724,92	1,00000	1.528.724,92	7.305,92	-	-	-	-	-	Obbligazioni	101,915	100,000	1,00000	1,00000	NR	0,80	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/11/2017 3,5	IT0004867070	400.000.000	EUR	106,390	425.560,40	1,00000	425.560,40	2.307,69	-	-	-	-	-	Obbligazioni	106,390	106,911	1,00000	1,00000	NR	1,79	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2028 4,75	IT0004889033	700.000.000	EUR	131,762	922.336,10	1,00000	922.336,10	11.052,88	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,762	113,965	1,00000	1,00000	NR	10,00	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/05/2023 4,5	IT0004898034	600.000.000	EUR	123,359	740.154,00	1,00000	740.154,00	4.450,55	-	-	-	-	-	Obbligazioni	123,359	97,290	1,00000	1,00000	NR	6,41	Govt
CCTS EU 01/11/2018 FLOATING	IT0004922909	200.000.000	EUR	104,702	209.403,00	1,00000	209.403,00	601,33	-	-	-	-	-	Obbligazioni	104,702	105,094	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUONI POLIENNALI DEL TES 01/09/2046 3,25	IT0005083057	250.000.000	EUR	111,745	279.362,25	1,00000	279.362,25	2.700,89	-	-	-	-	-	Obbligazioni	111,745	106,970	1,00000	1,00000	NR	20,11	Govt
CERT DI CREDITO DEL TES 27/02/2017 ZERO COUPON	IT0005089955	1.000.000.000	EUR	100,043	1.000.432,00	1,00000	1.000.432,00	-	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,043	99,978	1,00000	1,00000	NR	1,16	Govt
CCTS EU 15/06/2022 FLOATING	IT0005104473	1.125.000.000	EUR	100,749	1.133.430,75	1,00000	1.133.430,75	256,00	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,749	99,906	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
ITALY GOVT INT BOND 15/06/2033 5,375	US465410BG26	500.000	USD	114,050	570,25	1,08630	524,95	1,03	-	-	-	-	-	Obbligazioni	114,050	101,335	1,08630	1,41445	NR	12,10	Govt
ITALY GOVT INT BOND 14/11/2016 3,7	XS0070731194	20.000.000.000	JPY	102,939	20.587.800,00	130,67645	157.547,90	723,59	-	-	-	-	-	Obbligazioni	102,939	106,220	130,67645	136,95475	BBB	0,89	Govt
Totale I.G - TStato Org.int Q IT							15.287.165,37	71.210,38													
EXPORT DEVELOPMENT CANADA 18/02/2016 6	CAU3CB0170009	300.000.000	CAD	100,417	301.251,00	1,49305	201.768,86	4.422,67	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,417	102,280	1,49305	1,47260	AAA	0,13	Govt
CANADIAN GOVERNMENT 01/08/2021 6 1	CA135087B295	500.000.000	AUD	100,302	501.510,00	1,50895	332.356,94	1.368,65	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,302	100,547	1,50895	1,43735	AAA	0,58	Govt
INTL BK RECON & DEVELOP 15/03/2016 2,125	US459058B888	300.000.000	USD	100,303	300.909,00	1,08630	277.003,59	1.711,66	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,303	101,789	1,08630	1,12135	AAA	0,21	Corp
INTL BK RECON & DEVELOP 15/02/2035 4,75	US45905CAA27	250.000.000	USD	122,391	305.977,50	1,08630	281.669,43	4.099,36	-	-	-	-	-	Obbligazioni	122,391	97,578	1,08630	1,36040	AAA	13,45	Corp
TSV INFL IX NB 15/01/2029 2,5	US912810P257	900.000.000	USD	131,407	1.182.665,36	1,08630	1.088.709,71	10.537,59	-	-	-	-	-	Obbligazioni	131,407	132,369	1,08630	1,29541	AAA	11,40	Govt
Totale I.G - TStato Org.int Q OCSE							2.181.508,63	22.139,63													
BELGIUM KINGDOM 02/05/2018 FLOATING	BE0000330390	600.000.000	EUR	100,499	602.994,00	1,00000	602.994,00	56,05	-	-	-	-	-	Obbligazioni	100,499	99,865	1,00000	1,00000	NR	0,50	Govt
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/01/2037 4	DE0001135275	325.000.000	EUR	148,460	482.495,00	1,00000	482.495,00	12.857,53	-	-	-	-	-	Obbligazioni	148,460	116,426	1,00000	1,00000	NR	15,46	Govt
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 04/07/2039 4,25	DE0001135325	50.000.000	EUR	157,420	78.710,00	1,00000	78.710,00	1.045,08	-	-	-	-	-	Obbligazioni	157,420	137,030	1,00000	1,00000	NR	16,89	Govt
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO																					

den_portafoglio_op	den_sezi one	den_categoria_bilancio	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_divisa	data_operazio ne	data_valuta	data_banca	data_contabil izzazione	imp_valore_no minale	imp_prezzo_lordo	imp_prezzo_netto	tasso_cambio	tasso_cambio_b anca	imp_valore_pen ding_lc
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	XPH6 Index	SPI 200 FUTURES Mar16	AUD	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	2.375,00	1,000000	1,000000	1,496550	1,496550	1.590,70
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	XPH6 Index	SPI 200 FUTURES Mar16	AUD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	1.025,00	1,000000	1,000000	1,493050	1,493050	686,51
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	18.860,00	1,000000	1,000000	0,735800	0,735800	25.588,49
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	70,82	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	996,26
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 30 - DUEMME / sottoptf															
126.836,64															
Acquisti Pending															
den_portafoglio_op	den_sezi one	den_categoria_bilancio	cod_isin	den_strumento_finanziario	cod_divisa	data_operazio ne	data_valuta	data_banca	data_contabil izzazione	imp_valore_no minale	imp_prezzo_lordo	imp_prezzo_netto	tasso_cambio	tasso_cambio_b anca	imp_valore_pen ding_lc
AMUNDI / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.738,56	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	38.523,30
AMUNDI / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	32.758,50	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	460.813,78
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 30 - AMUNDI / sottoptf															
499.337,08															
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q OCSE	JP3422950000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	JPY	29/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	29/12/2015	400,00	5.508,561000	5.512,968500	131,395500	131,395500	16.875,17
ANIMA / sottoptf	Azioni	I.G - TCapitale Q OCSE	JP3684000007	NITTO DENKO CORP	JPY	29/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	29/12/2015	300,00	8.883,042900	8.890,149567	131,395500	131,395500	20.409,53
ANIMA / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.738,56	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	38.523,30
ANIMA / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	32.758,50	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	460.813,78
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 30 - ANIMA / sottoptf															
536.621,78															
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	ESH6 Index	S&P500 EMINI FUT Mar16	USD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	48.230,00	1,000000	1,000000	1,086300	1,086300	44.398,42
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	PTH6 Index	S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	CAD	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	1.920,00	1,000000	1,000000	1,515600	1,515600	1.272,41
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	PTH6 Index	S&P/TSX 60 IX FUT Mar16	CAD	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	4.800,00	1,000000	1,000000	1,508950	1,508950	3.181,02
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	29/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	29/12/2015	2.000,00	1,000000	1,000000	9,150750	9,150750	218,38
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	QCF6 Index	OMXS30 IND FUTURE Jan16	SEK	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	750,00	1,000000	1,000000	9,158150	9,158150	81,89
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	RPH6 Curncy	EURO/GBP FUTURE Mar16	GBP	30/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	30/12/2015	343,75	1,000000	1,000000	0,735800	0,735800	466,39
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	SMH6 Index	SWISS MKT IX FUTR Mar16	CHF	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	10.580,00	1,000000	1,000000	1,087400	1,087400	9.729,63
DUEMME / sottoptf	Futures	I.G - Futures	Z H6 Index	FTSE 100 IDX FUT Mar16	GBP	31/12/2015	05/01/2016	05/01/2016	31/12/2015	12.420,00	1,000000	1,000000	0,737050	0,737050	16.850,96
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	2.738,56	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	38.523,29
DUEMME / sottoptf	Quote di prodotto		QUOCARIPORIZZ30	Quota di CARIPARMA FRIULADRIA	EUR	15/12/2015	04/01/2016	04/01/2016	15/12/2015	32.758,50	14,067000	14,067000	1,000000	1,000000	460.813,77
Totale CARIPARMA CREDIT AGRICOLE - ORIZZONTE 30 - DUEMME / sottoptf															
575.536,16															