

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi  
**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) Quadrif. Portafoglio Protetto**  
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2006

Allegato 1

ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2006		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
<b>A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI</b>				
A1. Titoli di debito				
A1.1. Titoli di Stato				
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari				
A3. Parti di O.I.C.R.				
<b>B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI</b>				
B1. Titoli di debito				
B1.1. Titoli di Stato				
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili				
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
B2. Titoli azionari				
B3. Parti di O.I.C.R.				
<b>C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>	<b>27.536.058,98</b>	<b>99,89</b>	<b>34.015.666,30</b>	<b>99,93</b>
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)	27.536.058,98	99,89	34.015.666,30	99,93
C1.1. Opzione - Call Asiatica su Fondi Comuni di Investimento				
C1.2. Contratto swap	27.536.058,98	99,89	34.015.666,30	99,93
C1.3. Opzione su basket titoli azionari internazionali Acquistate				
C1.4. Opzione call su titoli obbligazionari				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
<b>D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE</b>				
<b>E. DEPOSITI BANCARI</b>	<b>30.380,83</b>	<b>0,11</b>	<b>22.663,88</b>	<b>0,07</b>
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare				
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
<b>H. ALTRE ATTIVITA'</b>	<b>381,43</b>		<b>300,94</b>	
H1. Ratei attivi				
H2. Altri attivi (da specificare)	381,43		300,94	
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute	381,43		300,94	
H2.3. Crediti diversi				
<b>TOTALE ATTIVITA'</b>	<b>27.566.821,24</b>	<b>100,00</b>	<b>34.038.631,12</b>	<b>100,00</b>

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2006		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore complessivo	% sul totale
<b>I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI</b>				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
<b>L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE</b>				
<b>M. ALTRE PASSIVITA'</b>	<b>-7.751,19</b>	<b>100,00</b>	<b>-8.509,29</b>	<b>100,00</b>
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto	-4.108,00	53,00	-4.015,00	47,18
M4. Commissione di gestione	-3.624,68	46,76	-4.475,78	52,60
M5. Passività diverse	-18,51	0,24	-18,51	0,22
<b>TOTALE PASSIVITA'</b>	<b>-7.751,19</b>	<b>100,00</b>	<b>-8.509,29</b>	<b>100,00</b>
<b>VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO</b>		<b>27.559.070,05</b>		<b>34.030.121,83</b>
Numero delle quote in circolazione		274.002,54500		335.990,51500
Valore unitario delle quote		100,58		101,283

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	532,69000	83,24900	770,02900	327,00400
Quote rimborsate	17.736,11500	6.113,70100	10.040,16800	29.810,95800

Data: 28 febbraio 2007

Firma:

QUADRIFOGLIO VITA SPA  
 DIRETTORE GENERALE

