



Rendiconto riepilogativo e Prospetto della composizione delle Gestioni Separate

PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI
IVASS VIGENTI

Periodo di osservazione:
dal 1/11/2021 al 31/10/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
GESTIONE SEPARATA: BPM Gest – Cod. gestione 600

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|-------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 428.231 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 286.238 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 141.993 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 48.219 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | 48.219 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 476.449 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 476.449 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 57.445.174 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 0,83% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM Gest – Cod. gestione 600

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 53.208.182 | 52.672.743 |
| 101 BTP | 49.321.879 | 49.682.860 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | 3.886.303 | 2.989.883 |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | | |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | 4.401.824 | 4.401.824 |
| 201 Azioni quotate in euro | 4.401.824 | 4.401.824 |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 35.330 | 119.897 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | | |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 35.330 | 119.897 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 57.645.336 | 57.194.464 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 50.171.062 | 50.828.160 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
GESTIONE SEPARATA: BPM GEST DEM – Cod. gestione 700

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|---------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 319 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 319 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | |
| 201 Titoli di Stato in euro | | |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 319 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 3 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 317 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 71.350 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 0,44% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM GEST DEM - Cod. gestione 700

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 68.565 | 65.576 |
| 101 BTP | 68.565 | 65.576 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | | |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | | |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | | |
| 201 Azioni quotate in euro | | |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 2.949 | 5.622 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | | |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 2.949 | 5.622 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 71.514 | 71.198 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 50.809 | 51.444 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
GESTIONE SEPARATA: BPM GEST ECU – Cod. gestione 800

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|--------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 833 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 833 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 250 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | 250 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 1.083 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 6 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 1.077 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 145.891 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 0,74% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM GEST ECU - Cod. gestione 800

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 141.511 | 137.790 |
| 101 BTP | 141.511 | 137.790 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | | |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | | |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | | |
| 201 Azioni quotate in euro | | |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 4.864 | 7.060 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | | |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 4.864 | 7.060 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 146.375 | 144.850 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 132.617 | 129.424 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM GEST USD – Cod. gestione 300

(cambio in euro alla data di fine periodo: 0,9914)

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|--------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 6.485 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | 6.485 |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | |
| 201 Titoli di Stato in euro | | |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 6.485 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 11 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 6.473 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 152.784 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 4,24% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM GEST USD - Cod. gestione 300

(cambio in euro alla data di fine periodo: 0,9914)

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 145.324 | 117.803 |
| 101 BTP | | |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | | |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | 145.324 | 117.803 |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | | |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | | |
| 201 Azioni quotate in euro | | |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 10.945 | 9.732 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | | |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 10.945 | 9.732 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 156.269 | 127.535 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 56.831 | 66.672 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
GESTIONE SEPARATA: BPM Sicurgest – Cod. gestione 900

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|-------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 67.318.989 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 63.590.369 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | 495.119 |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 2.250.684 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | 982.816 |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | 982.816 |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 12.832.189 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | -366.488 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | 2.043.873 |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | 11.154.804 |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | 11.154.804 |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 80.151.177 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 9.823 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 152.633 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 79.988.721 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 3.619.603.716 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 2,21% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM Sicurgest – Cod. gestione 900

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 2.774.923.932 | 2.754.365.517 |
| 101 BTP | 2.283.441.252 | 2.215.295.619 |
| 102 CCT | | 47.937.097 |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | 482.292.776 | 466.946.331 |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | 9.189.904 | 24.186.470 |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | 102.464.730 | 113.129.378 |
| 201 Azioni quotate in euro | 102.464.730 | 113.129.378 |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 753.989.586 | 745.813.785 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | 753.224.336 | 745.448.481 |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 765.250 | 365.304 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 3.631.378.248 | 3.613.308.680 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 3.613.955.937 | 3.532.175.718 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
BPM Gestpiù – Cod. gestione 1100

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|----------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 239.506 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 224.872 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 14.634 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 160.530 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | -7.897 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | 168.427 |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 400.036 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 2.806 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 196 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 397.034 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 17.953.844 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 2,21% |

| Tassi medi di rendimento nel periodo di osservazione | Tasso realizzato | Tassi medi di rendimento nel periodo di osservazione | Tasso realizzato |
|--|------------------|--|------------------|
| dal 01/12/20 al 30/11/21 | 2,59% | dal 01/06/21 al 31/05/22 | 3,03% |
| dal 01/01/21 al 31/12/21 | 2,81% | dal 01/07/21 al 30/06/22 | 2,83% |
| dal 01/02/21 al 31/01/22 | 2,90% | dal 01/08/21 al 31/07/22 | 2,68% |
| dal 01/03/21 al 28/02/22 | 2,95% | dal 01/09/21 al 31/08/22 | 2,53% |
| dal 01/04/21 al 31/03/22 | 3,19% | dal 01/10/21 al 30/09/22 | 2,40% |
| dal 01/05/21 al 30/04/22 | 3,15% | dal 01/11/21 al 31/10/22 | 2,21% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

BPM Gestpiù – Cod. gestione 1100

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 17.840.544 | 17.307.302 |
| 101 BTP | 17.840.544 | 17.307.302 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | | |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | | |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | 166.115 | 316.162 |
| 201 Azioni quotate in euro | 166.115 | 316.162 |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 126.954 | 35.590 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | | |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 126.954 | 35.590 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 18.133.613 | 17.659.054 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 7.804.534 | 11.445.145 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402
GESTIONE SEPARATA: BPM Valore – Cod. gestione 1200

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 4.597.086 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 4.310.635 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | 44.039 |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 221.270 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | 21.142 |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | 21.142 |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 1.545.847 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | 99.826 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | 85.175 |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | 1.360.846 |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | 1.360.846 |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 6.142.933 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 5.613 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 9.777 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 6.127.543 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 322.312.689 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 1,90% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM Valore – Cod. gestione 1200

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 234.063.053 | 264.649.673 |
| 101 BTP | 201.066.461 | 230.299.286 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | 31.648.304 | 31.003.296 |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | 1.348.288 | 3.347.091 |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | 8.440.977 | 8.747.409 |
| 201 Azioni quotate in euro | 8.440.977 | 8.747.409 |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | 63.805.329 | 68.566.890 |
| 301 Immobili | | |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | 63.753.704 | 68.241.987 |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 51.625 | 324.903 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 306.309.359 | 341.963.972 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 233.877.599 | 300.667.414 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022

RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM Consolida – Cod. gestione 1000

| Proventi e oneri distinti per categoria di attività | | Importi |
|--|--------------------------|-------------------|
| 100 Proventi da investimenti | A | 8.493.871 |
| 101 Interessi su titoli di Stato in euro | | 8.062.331 |
| 102 Interessi su titoli di Stato in valuta | | |
| 103 Interessi su titoli obbligazionari in euro | | 11.767 |
| 104 Interessi su titoli obbligazionari in valuta | | |
| 105 Dividendi su azioni in euro | | 372.172 |
| 106 Dividendi su azioni in valuta | | |
| 107 Redditi degli investimenti immobiliari | | |
| 150 Altre tipologie di proventi di cui: | | 47.601 |
| 151 Interessi ed altri proventi netti su altre attività | | 47.601 |
| 200 Utili/perdite da realizzi | B | 2.943.318 |
| 201 Titoli di Stato in euro | | 73.875 |
| 202 Titoli di Stato in valuta | | |
| 203 Titoli obbligazionari quotati in euro | | |
| 204 Titoli obbligazionari non quotati in euro | | |
| 205 Titoli obbligazionari quotati in valuta | | |
| 206 Titoli obbligazionari non quotati in valuta | | |
| 207 Titoli azionari quotati in euro | | 322.518 |
| 208 Titoli azionari non quotati in euro | | |
| 209 Titoli azionari in valuta quotati | | |
| 210 Titoli azionari in valuta non quotati | | |
| 211 Immobili | | |
| 212 Cambi | | |
| 250 Altre tipologie di utili/perdite di cui: | | 2.546.924 |
| 251 Utili/perdite su altre attività finanziarie | | 2.546.924 |
| 300 Retrocessione di commissioni e altre utilità | C | |
| 400 Risultato finanziario lordo | A + B + C | 11.437.189 |
| 500 Spese di revisione contabile | D | 5.613 |
| 600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E | 30.705 |
| 700 Risultato finanziario netto | A + B + C - D - E | 11.400.871 |
| 800 Giacenza media delle attività investite | | 652.802.020 |
| Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione | | 1,75% |

| Tassi medi di rendimento nel periodo di osservazione | Tasso realizzato | Tassi medi di rendimento nel periodo di osservazione | Tasso realizzato |
|--|------------------|--|------------------|
| dal 01/11/21 al 30/11/21 | 0,27% | dal 01/05/22 al 31/05/22 | 0,14% |
| dal 01/12/21 al 31/12/21 | 0,10% | dal 01/06/22 al 30/06/22 | 0,10% |
| dal 01/01/22 al 31/01/22 | 0,26% | dal 01/07/22 al 31/07/22 | 0,11% |
| dal 01/02/22 al 28/02/22 | 0,16% | dal 01/08/22 al 31/08/22 | 0,11% |
| dal 01/03/22 al 31/03/22 | 0,21% | dal 01/09/22 al 30/09/22 | 0,10% |
| dal 01/04/22 al 30/04/22 | 0,10% | dal 01/10/22 al 31/10/22 | 0,10% |

Redatto il 30/11/2022

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE DELLA GESTIONE SEPARATA IN EURO

PERIODO DI OSSERVAZIONE dal 1/11/2021 al 31/10/2022 – PUBBLICAZIONE AI SENSI DELLE DISPOSIZIONI IVASS VIGENTI

I valori sotto riportati sono espressi in Euro, salvo diversa indicazione

IMPRESA: BANCO BPM VITA SpA – Cod. impresa 402

GESTIONE SEPARATA: BPM Consolida - Cod. gestione 1000

| Categoria di attività | al 31/10/2022 importi da libro mastro* | al 31/10/2021 importi da libro mastro* |
|--|--|--|
| 100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso: | 511.215.568 | 503.020.770 |
| 101 BTP | 390.590.930 | 400.146.275 |
| 102 CCT | | |
| 103 Altri titoli di stato emessi in euro | 119.525.400 | 101.776.024 |
| 104 Altri titoli di stato emessi in valuta | | |
| 105 Obbligazioni quotate in euro | 1.099.238 | 1.098.471 |
| 106 Obbligazioni quotate in valuta | | |
| 107 Obbligazioni non quotate in euro | | |
| 108 Obbligazioni non quotate in valuta | | |
| 150 Altre tipologie di titoli di debito | | |
| 200 Titoli di capitale: | 17.945.572 | 15.036.542 |
| 201 Azioni quotate in euro | 17.945.572 | 15.036.542 |
| 202 Azioni non quotate in euro | | |
| 203 Azioni quotate in valuta | | |
| 204 Azioni non quotate in valuta | | |
| 250 Altre tipologie di titoli di capitale | | |
| 300 Altre attività patrimoniali: | | |
| 301 Immobili | 127.296.981 | 129.055.276 |
| 302 Prestiti | | |
| 303 Quote di OICR | 127.006.917 | 128.697.036 |
| 304 Strumenti derivati | | |
| 305 Liquidità | 290.064 | 358.240 |
| 350 Altre tipologie di attività | | |
| 351 Ratei Attivi | | |
| 352 Pronti c/ termine | | |
| 353 Retrocessione di commissioni | | |
| 400 Passività patrimoniali: | | |
| 401 Debiti per spese di revisione contabile | | |
| 402 Debiti per spese per l'acquisto/vendita di attività | | |
| 1000 Saldo attività della gestione separata | 656.458.121 | 647.112.588 |

* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento, nell'apposita sezione del libro mastro.

| | al 31/10/2022 | al 31/10/2021 |
|--|---------------|---------------|
| Riserve matematiche | 618.185.883 | 621.392.553 |
| Riserve matematiche relative ai contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |
| Oneri relativi ai sinistri sostenuti nel periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'art.5 del Reg. ISVAP n 25/2008 | | |

Redatto il 30/11/2022