



C.B.A VITA S.p.A. COMPAGNIA DI BANCHE E ASSICURAZIONI PER LE ASSICURAZIONI SULLA VITA
 Sede e Direzione: 20124 Milano - Via Vittor Pisani n. 13 - Tel.: 02/676120 - Fax: 02/676120598 - segreteria@pec.cbavita.com - www.cbavita.com - Capitale Sociale Euro 38.537.146,00 i.v. - C.F./P. IVA e numero d'iscrizione 10288130155 del Reg. Imprese di Milano R.E.A. n. MI-1363580 - Autorizzata con D.M. n. 19336 del 22.5.1992 (G.U. 127 del 1.6.1992) e con Provvedimento ISVAP n. 633 del 28.7.1997 (G.U.181 del 5.8.1997) per Infortuni e malattie ed iscritta alla Sezione I dell'Albo delle Imprese n. 1.00106. Società con unico azionista, facente parte del Gruppo "HDI Assicurazioni" iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015, soggetta all'attività di Direzione e Coordinamento della HDI Assicurazioni S.p.A.

Rendiconto Riepilogativo e Prospetto della Composizione delle Gestioni Separate in Euro

Fondo ALFIERE

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIA DI ATTIVITA'		Importi in Euro
100 Proventi da investimenti	A	12.080.004
101 Interessi su titoli di Stato in euro		8.506.531
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		14.580
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		3.527.739
105 Dividendi su azioni in euro		3.348
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi di liquidità		27.805
200 Utili/perdite da realizzi	B	-306.866
201 Titoli di Stato in euro		-610
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		-306.257
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	11.773.137
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	36.853
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	11.736.284
800 Giacenza media delle attività investite		586.588.170

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **2,00%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione:

periodo	tasso realizzato	periodo	tasso realizzato
dal 01/02/15 al 31/01/16	2,51%	dal 01/08/15 al 31/07/16	2,22%
dal 01/03/15 al 29/02/16	2,48%	dal 01/09/15 al 31/08/16	2,19%
dal 01/04/15 al 31/03/16	2,40%	dal 01/10/15 al 30/09/16	2,17%
dal 01/05/15 al 30/04/16	2,35%	dal 01/11/15 al 31/10/16	2,07%
dal 01/06/15 al 31/05/16	2,30%	dal 01/12/15 al 30/11/16	2,03%
dal 01/07/15 al 30/06/16	2,26%	dal 01/01/16 al 31/12/16	2,00%

Codice Impresa: 385 Codice Gestione: 004	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016) Importi da libro mastro ¹	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015) Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso	595.100.528	455.449.874
101 BTP	336.703.657	256.930.185
102 CCT	1.649.606	34.117.348
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	73.466.217	45.119.217
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	917.823	914.718
105 Obbligazioni quotate in euro	173.843.077	109.848.258
107 Obbligazioni non quotate in euro	8.520.148	8.520.148
200 Titoli di capitale	555.820	555.820
201 Azioni quotate in euro	555.820	555.820
300 Altre attività patrimoniali	47.590.195	32.158.013
303 Quote di OICR	15.654.979	15.654.979
305 Liquidità	31.935.216	16.503.034
1000 Saldo attività della gestione separata	643.246.543	488.163.707

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015)
Riserve matematiche	641.235.121	484.570.267

Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

Fondo VITABANK

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIA DI ATTIVITA'		Importi in Euro
100 Proventi da investimenti	A	38.341
101 Interessi su titoli di Stato in euro		29.591
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		8.750
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	38.341
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	38.341
800 Giacenza media delle attività investite		2.731.602

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **1,40%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione:

periodo	tasso realizzato	periodo	tasso realizzato
dal 01/02/15 al 31/01/16	1,54%	dal 01/08/15 al 31/07/16	1,47%
dal 01/03/15 al 29/02/16	1,47%	dal 01/09/15 al 31/08/16	1,45%
dal 01/04/15 al 31/03/16	1,40%	dal 01/10/15 al 30/09/16	1,42%
dal 01/05/15 al 30/04/16	1,57%	dal 01/11/15 al 31/10/16	1,39%
dal 01/06/15 al 31/05/16	1,54%	dal 01/12/15 al 30/11/16	1,38%
dal 01/07/15 al 30/06/16	1,49%	dal 01/01/16 al 31/12/16	1,40%

Codice Impresa: 385 Codice Gestione: 005	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016) Importi da libro mastro ¹	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015) Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso	2.665.714	2.663.923
101 BTP	1.359.023	1.357.286
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	799.991	799.937
105 Obbligazioni quotate in euro	506.700	506.700
300 Altre attività patrimoniali	57.025	206.660
305 Liquidità	57.025	206.660
1000 Saldo attività della gestione separata	2.722.739	2.870.583

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015)
Riserve matematiche	2.633.220	2.821.192

Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste.

Redatto il 17.02.2017



- Importi espressi in euro.
- Periodo di osservazione: 1 gennaio 2016 - 31 dicembre 2016.
- In conformità al regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011.
- Certificazione KPMG S.p.A..

www.cbavita.com



C.B.A VITA S.p.A. COMPAGNIA DI BANCHE E ASSICURAZIONI PER LE ASSICURAZIONI SULLA VITA
 Sede e Direzione: 20124 Milano - Via Vittor Pisani n. 13 - Tel.: 02/676120 - Fax: 02/676120598 - segreteria@pec.cbavita.com - www.cbavita.com - Capitale Sociale Euro 38.537.146,00 i.v. - C.F./P. IVA e numero d'iscrizione 10288130155 del Reg. Imprese di Milano R.E.A. n. MI-1363580 - Autorizzata con D.M. n. 19336 del 22.5.1992 (G.U. 127 del 1.6.1992) e con Provvedimento ISVAP n. 633 del 28.7.1997 (G.U.181 del 5.8.1997) per Infortuni e malattie ed iscritta alla Sezione I dell'Albo delle Imprese n. 1.00106. Società con unico azionista, facente parte del Gruppo "HDI Assicurazioni" iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015, soggetta all'attività di Direzione e Coordinamento della HDI Assicurazioni S.p.A.

Rendiconto Riepilogativo e Prospetto della Composizione delle Gestioni Separate in Euro

Fondo CAPITALBANK

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIA DI ATTIVITA'		Importi in Euro
100 Proventi da investimenti	A	256.396
101 Interessi su titoli di Stato in euro		227.795
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		28.601
200 Utili/perdite da realizza	B	700
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		700
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	257.096
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	257.096
800 Giacenza media delle attività investite		7.878.534

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **3,26%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione:

periodo	tasso realizzato	periodo	tasso realizzato
dal 01/02/15 al 31/01/16	1,74%	dal 01/08/15 al 31/07/16	2,45%
dal 01/03/15 al 29/02/16	1,99%	dal 01/09/15 al 31/08/16	2,61%
dal 01/04/15 al 31/03/16	2,10%	dal 01/10/15 al 30/09/16	2,76%
dal 01/05/15 al 30/04/16	2,13%	dal 01/11/15 al 31/10/16	2,92%
dal 01/06/15 al 31/05/16	2,25%	dal 01/12/15 al 30/11/16	3,11%
dal 01/07/15 al 30/06/16	2,32%	dal 01/01/16 al 31/12/16	3,26%

Codice Impresa: 385 Codice Gestione: 007	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016) Importi da libro mastro ¹	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015) Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso	7.309.903	10.293.256
101 BTP	5.664.615	5.648.945
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	-	1.999.723
105 Obbligazioni quotate in euro	999.069	1.998.369
107 Obbligazioni non quotate in euro	646.219	646.219
300 Altre attività patrimoniali	-	314.995
305 Liquidità	-	314.995
1000 Saldo attività della gestione separata	7.309.903	10.608.251

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015)
Riserve matematiche	2.149.520	10.414.638

Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

Fondo CBA Accumulo

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIA DI ATTIVITA'		Importi in Euro
100 Proventi da investimenti	A	5.882.153
101 Interessi su titoli di Stato in euro		4.135.800
102 Interessi su titoli di Stato in valuta		14.580
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		1.718.408
150 Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi di liquidità		13.365
200 Utili/perdite da realizza	B	-174.194
201 Titoli di Stato in euro		-18.892
203 Titoli obbligazionari quotati in euro		-155.302
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	5.707.959
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	19.212
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	5.688.747
800 Giacenza media delle attività investite		284.803.517

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **2,00%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione:

periodo	tasso realizzato	periodo	tasso realizzato
dal 01/02/15 al 31/01/16	2,60%	dal 01/08/15 al 31/07/16	2,32%
dal 01/03/15 al 29/02/16	2,57%	dal 01/09/15 al 31/08/16	2,27%
dal 01/04/15 al 31/03/16	2,49%	dal 01/10/15 al 30/09/16	2,24%
dal 01/05/15 al 30/04/16	2,45%	dal 01/11/15 al 31/10/16	2,12%
dal 01/06/15 al 31/05/16	2,40%	dal 01/12/15 al 30/11/16	2,04%
dal 01/07/15 al 30/06/16	2,36%	dal 01/01/16 al 31/12/16	2,00%

Codice Impresa: 385 Codice Gestione: 013	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016) Importi da libro mastro ¹	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015) Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso	335.774.906	220.355.554
101 BTP	192.596.214	121.813.938
102 CCT	4.548.913	31.538.113
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	39.094.949	11.561.917
104 Altri titoli di Stato emessi in valuta	917.823	914.718
105 Obbligazioni quotate in euro	94.357.607	50.267.468
107 Obbligazioni non quotate in euro	4.259.400	4.259.400
300 Altre attività patrimoniali	13.184.352	15.498.378
303 Quote di OICR	7.343.148	7.343.148
305 Liquidità	5.841.204	8.155.230
1000 Saldo attività della gestione separata	348.959.258	235.853.932

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015)
Riserve matematiche	347.079.549	233.915.529

Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/2008 *

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011, nell'apposita sezione del libro mastro.

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste.

Redatto il 17.02.2017



- Importi espressi in euro.
- Periodo di osservazione: 1 gennaio 2016 - 31 dicembre 2016.
- In conformità al regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011.
- Certificazione KPMG S.p.A..

www.cbavita.com



C.B.A VITA S.p.A. COMPAGNIA DI BANCHE E ASSICURAZIONI PER LE ASSICURAZIONI SULLA VITA
 Sede e Direzione: 20124 Milano - Via Vittor Pisani n. 13 - Tel.: 02/676120 - Fax: 02/676120598 - segreteria@pec.cbavita.com - www.cbavita.com - Capitale Sociale Euro 38.537.146,00 i.v. - C.F./P. IVA e numero d'iscrizione 10288130155 del Reg. Imprese di Milano R.E.A. n. MI-1363580 - Autorizzata con D.M. n. 19336 del 22.5.1992 (G.U. 127 del 1.6.1992) e con Provvedimento ISVAP n. 633 del 28.7.1997 (G.U.181 del 5.8.1997) per Infortuni e malattie ed iscritta alla Sezione I dell'Albo delle Imprese n. 1.00106. Società con unico azionista, facente parte del Gruppo "HDI Assicurazioni" iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015, soggetta all'attività di Direzione e Coordinamento della HDI Assicurazioni S.p.A.

Rendiconto Riepilogativo e Prospetto della Composizione della Gestione Separata in Euro

Fondo CBA APPRODO

PROVENTI ED ONERI DISTINTI PER CATEGORIA DI ATTIVITA'		Importi in Euro
100 Proventi da investimenti	A	555.173
101 Interessi su titoli di Stato in euro		353.524
103 Interessi su titoli obbligazionari in euro		201.649
200 Utili/perdite da realizzo	B	44.334
201 Titoli di Stato in euro		44.334
300 Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400 Risultato finanziario lordo	A+B+C	599.507
500 Spese di revisione contabile	D	-
600 Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	208
700 Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	599.299
800 Giacenza media delle attività investite		14.679.221

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione **4,08%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione:

periodo	tasso realizzato	periodo	tasso realizzato
dal 01/02/15 al 31/01/16	4,12%	dal 01/08/15 al 31/07/16	4,36%
dal 01/03/15 al 29/02/16	4,12%	dal 01/09/15 al 31/08/16	4,36%
dal 01/04/15 al 31/03/16	4,11%	dal 01/10/15 al 30/09/16	4,21%
dal 01/05/15 al 30/04/16	4,24%	dal 01/11/15 al 31/10/16	4,15%
dal 01/06/15 al 31/05/16	4,23%	dal 01/12/15 al 30/11/16	4,09%
dal 01/07/15 al 30/06/16	4,16%	dal 01/01/16 al 31/12/16	4,08%

Codice Impresa: 385 Codice Gestione: 010	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016) Importi da libro mastro ¹	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015) Importi da libro mastro ¹
100 Obbligazioni ed altri titoli a reddito fisso:	14.950.031	13.577.558
101 BTP	8.319.199	9.071.511
103 Altri titoli di Stato emessi in euro	424.006	46.806
105 Obbligazioni quotate in euro	5.956.826	4.209.241
107 Obbligazioni non quotate in euro	250.000	250.000
300 Altre attività patrimoniali	472.807	638.225
303 Quote di OICR	103.580	103.580
305 Liquidità	369.227	534.645
1000 Saldo attività della gestione separata	15.422.838	14.215.783

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2016)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2015)
Riserve matematiche	15.217.290	13.996.446
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/20082	*	2.491.629
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/20083	*	34.659
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento Isvap n. 25/20084	*	*

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011, nell'apposita sezione del libro mastro.
 * Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste.

Redatto il 17.02.2017



- Importi espressi in euro.
- Periodo di osservazione: 1 gennaio 2016 - 31 dicembre 2016.
- In conformità al regolamento ISVAP n. 38 del 3 giugno 2011.
- Certificazione KPMG S.p.A..

www.cbavita.com