

**PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE E RENDICONTO RIEPILOGATIVO
DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO**

Periodo di osservazione: 1° Gennaio 2019 al 31 Dicembre 2019

Fondo ALFIERE		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	005		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	990.470.851	714.689.241
101	BTP	438.247.867	333.363.443
102	CCT	1.021.898	1.026.465
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	18.948.700	19.137.156
105	Obbligazioni quotate in euro	522.252.386	361.162.177
107	Obbligazioni non quotate in euro	10.000.000	-
200	Titoli di capitale	2.850.759	2.850.759
201	Azioni quotate in euro	2.850.759	2.850.759
300	Altre attività patrimoniali	102.534.946	146.992.004
303	Quote di OICR	48.229.167	47.984.771
305	Liquidità	46.800.511	94.037.886
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	7.505.268	4.969.347
400	Passività patrimoniali	8.760	6.400
401	Debiti per spese di revisione contabile	8.760	6.400
1000	Saldo attività della gestione separata	1.095.847.796	864.525.604

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 12 febbraio 2020

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
Riserve matematiche	1.080.160.981	854.824.841
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contropartiti 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 i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*

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

100	Proventi da investimenti	A	19.992.013
101	Interessi su titoli di Stato in euro		10.217.671
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		9.392.705
105	Dividendi su azioni in euro		127.237
150	Altre tipologie di proventi di cui: 151 Quote di OICR		254.400
200	Utili/perdite da realzi	B	190.523
201	Titoli di Stato in euro		411.601
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		(140.410)
250	Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR		(80.668)
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	20.182.536
500	Spese di revisione contabile	D	8.760
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	35.218
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	20.138.558
800	Giacenza media delle attività investite		980.328.780

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 2,05%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2018 a 31/01/2019	1,98	da 01/06/2018 a 31/05/2019	1,90	da 01/10/2018 a 30/09/2019	2,05
da 01/03/2018 a 28/02/2019	1,97	da 01/07/2018 a 30/06/2019	1,93	da 01/11/2018 a 31/10/2019	2,06
da 01/04/2018 a 31/03/2019	1,90	da 01/08/2018 a 31/07/2019	1,95	da 01/12/2018 a 30/11/2019	2,06
da 01/05/2018 a 30/04/2019	1,95	da 01/09/2018 a 31/08/2019	2,00	da 01/01/2019 a 31/12/2019	2,05

Fondo CBA Approdo		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	007		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	18.660.867	16.443.185
101	BTP	11.121.320	9.756.052
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	572.823	568.779
105	Obbligazioni quotate in euro	6.716.724	5.868.354
107	Obbligazioni non quotate in euro	250.000	250.000
300	Altre attività patrimoniali	934.120	1.608.670
305	Liquidità	765.426	1.440.826
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	168.694	167.844
1000	Saldo attività della gestione separata	19.594.987	18.051.855

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 12 febbraio 2020

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
Riserve matematiche	18.956.172	17.542.046
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contropartiti 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 i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*

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

100	Proventi da investimenti	A	642.606
101	Interessi su titoli di Stato in euro		407.755
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		234.851
200	Utili/perdite da realzi	B	(14.018)
201	Titoli di Stato in euro		2.228
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		(16.246)
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	628.588
500	Spese di revisione contabile	D	-
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	293
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	628.295
800	Giacenza media delle attività investite		18.392.943

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 3,42%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2018 a 31/01/2019	3,15	da 01/06/2018 a 31/05/2019	3,26	da 01/10/2018 a 30/09/2019	3,29
da 01/03/2018 a 28/02/2019	3,25	da 01/07/2018 a 30/06/2019	3,27	da 01/11/2018 a 31/10/2019	3,29
da 01/04/2018 a 31/03/2019	3,26	da 01/08/2018 a 31/07/2019	3,28	da 01/12/2018 a 30/11/2019	3,28
da 01/05/2018 a 30/04/2019	3,29	da 01/09/2018 a 31/08/2019	3,29	da 01/01/2019 a 31/12/2019	3,42



HDI Assicurazioni S.p.A.

Via Abruzzi, 10 - 00187 Roma

Tel. 06-421031 - Fax 06-42103500

Capitale Sociale € 96.000.000,00

C.F. e P.IVA 04349061004

Impresa autorizzata all'esercizio delle assicurazioni

con D.M.I.C.A. n. 19570 dell'8/6/93 (G.U. 14/6/93)

Società con unico azionista

Società Capogruppo del Gruppo Assicurativo HDI Assicurazioni

Iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015

hdi.assicurazioni@pec.hdia.it



Entra in HDI con il tuo Smartphone



Al tuo fianco, ogni giorno

www.hdiassicurazioni.it

Ai sensi delle disposizioni IVASS vigenti

www.hdiassicurazioni.it

Fondo CBA Accumulo		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	006		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	619.769.074	516.642.635
101	BTP	259.034.850	223.244.004
102	CCT	49.709.774	49.875.610
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	3.760.669	3.754.854
105	Obbligazioni quotate in euro	300.513.781	237.166.841
106	Obbligazioni quotate in valuta	-	851.326
107	Obbligazioni non quotate in euro	6.750.000	1.750.000
200	Titoli di capitale	950.929	950.929
201	Azioni quotate in euro	950.929	950.929
300	Altre attività patrimoniali	23.145.426	18.619.017
303	Quote di OICR	3.500.000	3.500.000
305	Liquidità	15.409.929	11.834.549
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	4.235.497	3.284.468
400	Passività patrimoniali	4.930	4.000
401	Debiti per spese di revisione contabile	4.930	4.000
1000	Saldo attività della gestione separata	643.860.499	536.208.581

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 12 febbraio 2020

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
Riserve matematiche	632.574.874	525.729.922
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contropartiti 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 i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*

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

100	Proventi da investimenti	A	11.458.316
101	Interessi su titoli di Stato in euro		6.581.503
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		4.832.846
104	Interessi su titoli obbligazionari in valuta		1.915
105	Dividendi su azioni in euro		42.052
200	Utili/perdite da realzi	B	376.840
201	Titoli di Stato in euro		206.952
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		151.120
205	Titoli obbligazionari quotati in valuta		18.768
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	11.835.156
500	Spese di revisione contabile	D	4.930
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	14.598
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	11.815.628
800	Giacenza media delle attività investite		575.757.855

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 2,05%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2018 a 31/01/2019	2,02	da 01/06/2018 a 31/05/2019	2,04	da 01/10/2018 a 30/09/2019	2,02
da 01/03/2018 a 28/02/2019	2,01	da 01/07/2018 a 30/06/2019	2,03	da 01/11/2018 a 31/10/2019	2,02
da 01/04/2018 a 31/03/2019	1,98	da 01/08/2018 a 31/07/2019	1,98	da 01/12/2018 a 30/11/2019	2,02
da 01/05/2018 a 30/04/2019	2,04	da 01/09/2018 a 31/08/2019	1,98	da 01/01/2019 a 31/12/2019	2,05

Fondo CAPITALBANK		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	008		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	5.773.674	6.750.232
101	BTP	4.774.605	5.751.163
105	Obbligazioni quotate in euro	999.069	999.069
300	Altre attività patrimoniali	115.835	90.288
305	Liquidità	43.794	4.079
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	72.041	86.209
400	Passività patrimoniali	500	500
401	Debiti per spese di revisione contabile	500	500
1000	Saldo attività della gestione separata	5.889.009	6.840.020

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 12 febbraio 2020

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2019)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2018)
Riserve matematiche	1.351.305	1.521.398
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contropartiti 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 i contropartiti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	*	*

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

100	Proventi da investimenti	A	242.847
101	Interessi su titoli di Stato in euro		222.847
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		20.000
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	242.847
500	Spese di revisione contabile	D	500
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	-
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	242.347
800	Giacenza media delle attività investite		6.491.537

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 3,73%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2018 a 31/01/2019	4,14	da 01/06/2018 a 31/05/2019	3,93	da 01/10/2018 a 30/09/2019	3,89
da 01/03/2018 a 28/02/2019	4,02	da 01/07/2018 a 30/06/2019	4,07	da 01/11/2018 a 31/10/2019	3,87
da 01/04/2018 a 31/03/2019	3,88	da 01/08/2018 a 31/07/2019	3,95	da 01/12/2018 a 30/11/2019	3,78
da 01/05/2018 a 30/04/2019	3,92	da 01/09/2018 a 31/08/2019	3,96	da 01/01/2019 a 31/12/2019	3,73