

# 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
<b>1000</b>	<b>Saldo attività della gestione separata</b>	<b>1.095.847.796</b>	<b>864.525.604</b>

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 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	*	*

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

100	<b>Proventi da investimenti</b>	<b>A</b>	<b>19.992.013</b>
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	<b>Utili/perdite da realizzo</b>	<b>B</b>	<b>190.523</b>
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	<b>Retrocessione di commissioni e altre utilità</b>	<b>C</b>	<b>-</b>
400	<b>Risultato finanziario lordo</b>	<b>A+B+C</b>	<b>20.182.536</b>
500	<b>Spese di revisione contabile</b>	<b>D</b>	<b>8.760</b>
600	<b>Spese per l'acquisto e la vendita di attività</b>	<b>E</b>	<b>35.218</b>
700	<b>Risultato finanziario netto</b>	<b>A+B+C-D-E</b>	<b>20.138.558</b>
800	<b>Giacenza media delle attività investite</b>		<b>980.328.780</b>

**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
<b>1000</b>	<b>Saldo attività della gestione separata</b>	<b>19.594.987</b>	<b>18.051.855</b>

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 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	*	*

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

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

**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	

# LINEA CBA

**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

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
<b>1000</b>	<b>Saldo attività della gestione separata</b>	<b>643.860.499</b>	<b>536.208.581</b>

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 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	*	*

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

100	<b>Proventi da investimenti</b>	<b>A</b>	<b>11.458.316</b>
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	<b>Utili/perdite da realizzo</b>	<b>B</b>	<b>376.840</b>
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	<b>Retrocessione di commissioni e altre utilità</b>	<b>C</b>	<b>-</b>
400	<b>Risultato finanziario lordo</b>	<b>A+B+C</b>	<b>11.835.156</b>
500	<b>Spese di revisione contabile</b>	<b>D</b>	<b>4.930</b>
600	<b>Spese per l'acquisto e la vendita di attività</b>	<b>E</b>	<b>14.598</b>
700	<b>Risultato finanziario netto</b>	<b>A+B+C-D-E</b>	<b>11.815.628</b>
800	<b>Giacenza media delle attività investite</b>		<b>575.757.855</b>

**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
<b>1000</b>	<b>Saldo attività della gestione separata</b>	<b>5.889.009</b>	<b>6.840.020</b>

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 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	*	*

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

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

**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	