

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

Periodo di osservazione: 1° Gennaio 2020 al 31 Dicembre 2020

Fondo ALFIERE		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	005		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	1.179.166.157	990.470.851
101	BTP	625.600.935	438.247.867
102	CCT	1.017.318	1.021.898
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	25.861.821	18.948.700
105	Obbligazioni quotate in euro	516.686.083	522.252.386
107	Obbligazioni non quotate in euro	10.000.000	10.000.000
200	Titoli di capitale	-	2.850.759
201	Azioni quotate in euro	-	2.850.759
300	Altre attività patrimoniali	146.594.606	102.534.946
303	Quote di OICR	92.298.543	48.229.167
305	Liquidità	46.086.139	46.800.511
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	8.209.924	7.505.268
400	Passività patrimoniali	9.461	8.760
401	Debiti per spese di revisione contabile	9.461	8.760
1000	Saldo attività della gestione separata	1.325.751.302	1.095.847.796

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 08 febbraio 2021

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
Riserve matematiche	1.309.439.919	1.080.160.981
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	Proventi da investimenti	A	22.386.473
101	Interessi su titoli di Stato in euro		11.838.091
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		9.992.440
105	Dividendi su azioni in euro		10.404
150	Altre tipologie di proventi: di cui: 152 Quote di OICR		545.538
200	Uttili/perdite da realizzati	B	1.539.690
201	Titoli di Stato in euro		(2.098)
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		1.734.865
207	Titoli azionari quotati in euro		(193.077)
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	23.926.163
500	Spese di revisione contabile	D	9.461
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	37.745
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	23.878.957
800	Giacenza media delle attività investite		1.187.095.771

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 2,01%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2019 a 31/01/2020	2,05	da 01/06/2019 a 31/05/2020	2,05	da 01/10/2019 a 30/09/2020	2,05
da 01/03/2019 a 29/02/2020	2,10	da 01/07/2019 a 30/06/2020	2,15	da 01/11/2019 a 31/10/2020	1,96
da 01/04/2019 a 31/03/2020	2,10	da 01/08/2019 a 31/07/2020	2,13	da 01/12/2019 a 30/11/2020	1,95
da 01/05/2019 a 30/04/2020	2,06	da 01/09/2019 a 31/08/2020	2,10	da 01/01/2020 a 31/12/2020	2,01

Fondo CBA Approdo		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	007		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	19.117.349	18.660.867
101	BTP	11.399.710	11.121.320
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	576.879	572.823
105	Obbligazioni quotate in euro	6.890.760	6.716.724
107	Obbligazioni non quotate in euro	250.000	250.000
300	Altre attività patrimoniali	1.148.513	934.120
305	Liquidità	1.000.358	765.426
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	148.155	168.694
400	Passività patrimoniali	148.155	168.694
401	Debiti per spese di revisione contabile	148.155	168.694
1000	Saldo attività della gestione separata	20.265.862	19.594.987

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 08 febbraio 2021

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
Riserve matematiche	19.905.758	18.956.172
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	Proventi da investimenti	A	632.165
101	Interessi su titoli di Stato in euro		410.961
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		221.204
200	Uttili/perdite da realizzati	B	(2.021)
201	Titoli di Stato in euro		(49)
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		(1.972)
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	630.144
500	Spese di revisione contabile	D	9.461
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	197
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	629.947
800	Giacenza media delle attività investite		19.741.799

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 3,19%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2019 a 31/01/2020	3,40	da 01/06/2019 a 31/05/2020	3,34	da 01/10/2019 a 30/09/2020	3,30
da 01/03/2019 a 29/02/2020	3,30	da 01/07/2019 a 30/06/2020	3,37	da 01/11/2019 a 31/10/2020	3,28
da 01/04/2019 a 31/03/2020	3,28	da 01/08/2019 a 31/07/2020	3,34	da 01/12/2019 a 30/11/2020	3,27
da 01/05/2019 a 30/04/2020	3,30	da 01/09/2019 a 31/08/2020	3,32	da 01/01/2020 a 31/12/2020	3,19

**LINEA
CBA**

HDI Assicurazioni S.p.A.

Sede Legale e Direzione Generale:

Palazzo Italia - Piazza Guglielmo Marconi, 25 - 00144 Roma (I)

Telefono +39 06 421 031 - Fax +39 06 4210 3500

hdi.assicurazioni@pec.hdia.it - www.hdiassicurazioni.it

Capitale Sociale € 126.000.000,00 i.v.

Codice Fiscale, Parita Iva

e Numero d'iscrizione: 04349061004

del Registro Imprese di Roma,

N. REA: RM-757172

Autorizzata all'esercizio delle Assicurazioni

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

alla Sezione I dell'Albo delle Imprese Assicuratrici al n. 1.00022

Capogruppo del Gruppo Assicurativo "HDI Assicurazioni"

iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015



Entra in HDI
con il tuo Smartphone



HDI
ASSICURAZIONI

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 (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	006		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	706.657.131	619.769.074
101	BTP	343.372.622	259.034.850
102	CCT	49.543.483	49.709.774
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	9.707.871	3.760.669
105	Obbligazioni quotate in euro	297.283.155	300.513.781
107	Obbligazioni non quotate in euro	6.750.000	6.750.000
200	Titoli di capitale	-	950.929
201	Azioni quotate in euro	-	950.929
300	Altre attività patrimoniali	24.809.624	23.145.426
303	Quote di OICR	8.500.000	3.500.000
305	Liquidità	11.965.470	15.409.929
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	4.344.154	4.235.497
400	Passività patrimoniali	5.280	4.930
401	Debiti per spese di revisione contabile	5.280	4.930
1000	Saldo attività della gestione separata	731.461.475	643.860.499

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 08 febbraio 2021

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
Riserve matematiche	721.049.751	632.574.874
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	Proventi da investimenti	A	12.422.645
101	Interessi su titoli di Stato in euro		6.996.574
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		5.422.876
105	Dividendi su azioni in euro		3.195
200	Uttili/perdite da realizzati	B	1.325.243
201	Titoli di Stato in euro		(524)
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		1.413.233
207	Titoli azionari quotati in euro		(87.466)
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	13.747.888
500	Spese di revisione contabile	D	5.280
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	19.831
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	13.722.777
800	Giacenza media delle attività investite		682.437.312

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 2,01%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2019 a 31/01/2020	2,12	da 01/06/2019 a 31/05/2020	2,04	da 01/10/2019 a 30/09/2020	2,05
da 01/03/2019 a 29/02/2020	2,13	da 01/07/2019 a 30/06/2020	2,14	da 01/11/2019 a 31/10/2020	2,03
da 01/04/2019 a 31/03/2020	2,12	da 01/08/2019 a 31/07/2020	2,12	da 01/12/2019 a 30/11/2020	2,02
da 01/05/2019 a 30/04/2020	2,05	da 01/09/2019 a 31/08/2020	2,10	da 01/01/2020 a 31/12/2020	2,01

Fondo CAPITALBANK		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
CODICE IMPRESA:	055	Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE GESTIONE:	008		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso	4.768.582	5.773.674
101	BTP	4.768.582	4.774.605
105	Obbligazioni quotate in euro	-	999.069
300	Altre attività patrimoniali	156.452	115.835
305	Liquidità	91.280	43.794
350	Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei attivi su titoli	65.172	72.041
400	Passività patrimoniali	500	500
401	Debiti per spese di revisione contabile	500	500
1000	Saldo attività della gestione separata	4.924.534	5.889.009

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 08 febbraio 2021

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2020)	Alla chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2019)
Riserve matematiche	1.214.678	1.351.305
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	Proventi da investimenti	A	172.486
101	Interessi su titoli di Stato in euro		165.375
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		7.111
200	Uttili/perdite da realizzati	B	4.030
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		4.030
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	176.516
500	Spese di revisione contabile	D	500
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	100
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	175.916
800	Giacenza media delle attività investite		5.196.246

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 3,39%

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
da 01/02/2019 a 31/01/2020	3,66	da 01/06/2019 a 31/05/2020	3,69	da 01/10/2019 a 30/09/2020	3,60
da 01/03/2019 a 29/02/2020	3,77	da 01/07/2019 a 30/06/2020	3,53	da 01/11/2019 a 31/10/2020	3,39
da 01/04/2019 a 31/03/2020	3,86	da 01/08/2019 a 31/07/2020	3,44	da 01/12/2019 a 3	