

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

Periodo di osservazione: 1° Gennaio 2018 al 31 Dicembre 2018

| Fondo ALFIERE    |  | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|------------------|--|---|---|
| CODICE IMPRESA:  | 055  | Importi da libro mastro 1                             | Importi da libro mastro 1                                   |
| CODICE GESTIONE: | 005  |   |   |
| 100              | Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:             | 714.689.241   | 583.123.232   |
| 101              | BTP  | 333.363.443   | 258.503.883   |
| 102              | CCT  | 1.026.465   | -   |
| 103              | Altri titoli di Stato emessi in euro                 | 19.137.156  | 76.324.778  |
| 104              | Altri titoli di Stato emessi in valuta               | -   | 917.876   |
| 105              | Obbligazioni quotate in euro                         | 361.162.177   | 247.376.695   |
| 200              | Titoli di capitale:                                  | 2.850.759   | -   |
| 201              | Azioni quotate in euro                               | 2.850.759   | -   |
| 300              | Altre attività patrimoniali:                         | 146.992.004   | 149.762.636   |
| 303              | Quote di OICR  | 47.984.771  | 75.683.030  |
| 305              | Liquidita'   | 94.037.886  | 74.079.606  |
| 350              | Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei Attivi | 4.969.347   | -   |
| 400              | Passività patrimoniali:                              | 6.400   | -   |
| 401              | Debiti per spese di revisione contabile              | 6.400   | -   |
| <b>1000</b>      | <b>Saldo attività della gestione separata</b>        | <b>864.525.604</b>                                    | <b>732.885.868</b>  |

\* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 06 febbraio 2019

|   | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|---|---|---|
| Riserve matematiche   | 854.824.841   | 724.843.506   |
| Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008   | -   | -   |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contrafforti 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 contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008 | -   | -   |

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

|     |  | A           | B | C | D | E | A+B+C-D-E |
|-----|--|-------------|---|---|---|---|-----------|
| 100 | Proventi da investimenti                                   | 14.682.539  |   |   |   |   |           |
| 101 | Interessi su titoli di Stato in euro                       | 9.056.202   |   |   |   |   |           |
| 102 | Interessi su titoli di Stato in valuta                     | 10.213      |   |   |   |   |           |
| 103 | Interessi su titoli obbligazionari in euro                 | 5.318.947   |   |   |   |   |           |
| 105 | Dividendi su azioni in euro                                | 115.655     |   |   |   |   |           |
| 150 | Altre tipologie di proventi di cui: 151 Quote di OICR      | 181.522     |   |   |   |   |           |
| 200 | Utili/perdite da realizza                                  | 1.483.291   |   |   |   |   |           |
| 201 | Titoli di Stato in euro                                    | 1.439.788   |   |   |   |   |           |
| 202 | Titoli di Stato in valuta                                  | -49.102     |   |   |   |   |           |
| 203 | Titoli obbligazionari quotati in euro                      | 707.016     |   |   |   |   |           |
| 207 | Titoli azionari quotati in euro                            | -47.245     |   |   |   |   |           |
| 250 | Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR | -567.166    |   |   |   |   |           |
| 300 | Retrocessione di commissioni e altre utilità               | -           |   |   |   |   |           |
| 400 | Risultato finanziario lordo                                | 16.165.830  |   |   |   |   |           |
| 500 | Spese di revisione contabile                               | 6.400       |   |   |   |   |           |
| 600 | Spese per l'acquisto e la vendita di attività              | 35.364      |   |   |   |   |           |
| 700 | Risultato finanziario netto                                | 16.124.066  |   |   |   |   |           |
| 800 | Giacenza media delle attività investite                    | 800.979.407 |   |   |   |   |           |

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                   |
| dal 01/02/2017 al 31/01/2018 2,03%                              | dal 01/06/2017 al 31/05/2018 2,10% | dal 01/10/2017 al 30/09/2018 2,06% |
| dal 01/03/2017 al 28/02/2018 2,03%                              | dal 01/07/2017 al 30/06/2018 2,08% | dal 01/11/2017 al 31/10/2018 2,02% |
| dal 01/04/2017 al 31/03/2018 2,05%                              | dal 01/08/2017 al 31/07/2018 2,06% | dal 01/12/2017 al 30/11/2018 2,00% |
| dal 01/05/2017 al 30/04/2018 2,03%                              | dal 01/09/2017 al 31/08/2018 2,06% | dal 01/01/2018 al 31/12/2018 2,01% |

| Fondo CBA Approdo |  | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|-------------------|--|---|---|
| CODICE IMPRESA:   | 055  | Importi da libro mastro 1                             | Importi da libro mastro 1                                   |
| CODICE GESTIONE:  | 007  |   |   |
| 100               | Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:             | 16.443.185  | 15.072.705  |
| 101               | BTP  | 9.756.052   | 6.138.605   |
| 103               | Altri titoli di Stato emessi in euro                 | 568.779   | 2.829.578   |
| 105               | Obbligazioni quotate in euro                         | 5.868.354   | 5.854.522   |
| 107               | Obbligazioni non quotate in euro                     | 250.000   | 250.000   |
| 300               | Altre attività patrimoniali:                         | 1.608.670   | 1.815.116   |
| 305               | Liquidita'   | 1.440.826   | 1.815.116   |
| 350               | Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei Attivi | 167.844   | -   |
| <b>1000</b>       | <b>Saldo attività della gestione separata</b>        | <b>18.051.855</b>                                     | <b>16.887.821</b>   |

\* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 06 febbraio 2019

|   | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|---|---|---|
| Riserve matematiche   | 17.542.046  | 16.550.287  |
| Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008   | -   | -   |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contrafforti 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 contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008 | -   | -   |

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

|     |   | A          | B | C | D | E | A+B+C-D-E |
|-----|---|------------|---|---|---|---|-----------|
| 100 | Proventi da investimenti                      | 543.014    |   |   |   |   |           |
| 101 | Interessi su titoli di Stato in euro          | 341.213    |   |   |   |   |           |
| 103 | Interessi su titoli obbligazionari in euro    | 201.801    |   |   |   |   |           |
| 200 | Utili/perdite da realizza                     | 28.370     |   |   |   |   |           |
| 201 | Titoli di Stato in euro                       | 29.267     |   |   |   |   |           |
| 203 | Titoli obbligazionari quotati in euro         | -897       |   |   |   |   |           |
| 300 | Retrocessione di commissioni e altre utilità  | -          |   |   |   |   |           |
| 400 | Risultato finanziario lordo                   | 571.384    |   |   |   |   |           |
| 500 | Spese di revisione contabile                  | D          |   |   |   |   |           |
| 600 | Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E          |   |   |   |   |           |
| 700 | Risultato finanziario netto                   | 571.225    |   |   |   |   |           |
| 800 | Giacenza media delle attività investite       | 17.181.866 |   |   |   |   |           |

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 3,32%

| Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione |                                    |                                    |
|---|------------------------------------|------------------------------------|
| tasso realizzato  | tasso realizzato                   | tasso realizzato                   |
| dal 01/02/2017 al 31/01/2018 4,07%                              | dal 01/06/2017 al 31/05/2018 3,65% | dal 01/10/2017 al 30/09/2018 3,42% |
| dal 01/03/2017 al 28/02/2018 4,02%                              | dal 01/07/2017 al 30/06/2018 3,43% | dal 01/11/2017 al 31/10/2018 3,41% |
| dal 01/04/2017 al 31/03/2018 3,85%                              | dal 01/08/2017 al 31/07/2018 3,44% | dal 01/12/2017 al 30/11/2018 3,40% |
| dal 01/05/2017 al 30/04/2018 3,84%                              | dal 01/09/2017 al 31/08/2018 3,43% | dal 01/01/2018 al 31/12/2018 3,32% |



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

Ai sensi delle disposizioni IVASS vigenti

| Fondo VITABANK   |  | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|------------------|--|---|---|
| CODICE IMPRESA:  | 055  | Importi da libro mastro 1                             | Importi da libro mastro 1                                   |
| CODICE GESTIONE: | 009  |   |   |
| 100              | Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:             | 1.574.149   | 2.569.656   |
| 101              | BTP  | 1.067.449   | 1.262.620   |
| 103              | Altri titoli di Stato emessi in euro                 | -   | 800.336   |
| 105              | Obbligazioni quotate in euro                         | 506.700   | 506.700   |
| 300              | Altre attività patrimoniali:                         | 332.904   | 19.030  |
| 305              | Liquidita'   | 327.923   | 19.030  |
| 350              | Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei Attivi | 4.981   | -   |
| <b>1000</b>      | <b>Saldo attività della gestione separata</b>        | <b>1.907.053</b>                                      | <b>2.588.686</b>  |

\* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 06 febbraio 2019

|   | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|---|---|---|
| Riserve matematiche   | 1.735.893   | 2.138.384   |
| Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008   | -   | -   |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contrafforti 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 contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008 | -   | -   |

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

|     |   | A         | B | C | D | E | A+B+C-D-E |
|-----|---|-----------|---|---|---|---|-----------|
| 100 | Proventi da investimenti                      | 36.147    |   |   |   |   |           |
| 101 | Interessi su titoli di Stato in euro          | 35.269    |   |   |   |   |           |
| 103 | Interessi su titoli obbligazionari in euro    | 878       |   |   |   |   |           |
| 200 | Utili/perdite da realizza                     | -2.433    |   |   |   |   |           |
| 201 | Titoli di Stato in euro                       | -2.433    |   |   |   |   |           |
| 300 | Retrocessione di commissioni e altre utilità  | -         |   |   |   |   |           |
| 400 | Risultato finanziario lordo                   | 33.714    |   |   |   |   |           |
| 500 | Spese di revisione contabile                  | D         |   |   |   |   |           |
| 600 | Spese per l'acquisto e la vendita di attività | E         |   |   |   |   |           |
| 700 | Risultato finanziario netto                   | 33.714    |   |   |   |   |           |
| 800 | Giacenza media delle attività investite       | 2.467.664 |   |   |   |   |           |

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: 1,37%

| Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione |                                    |                                    |
|---|------------------------------------|------------------------------------|
| tasso realizzato  | tasso realizzato                   | tasso realizzato                   |
| dal 01/02/2017 al 31/01/2018 1,37%                              | dal 01/06/2017 al 31/05/2018 1,30% | dal 01/10/2017 al 30/09/2018 1,47% |
| dal 01/03/2017 al 28/02/2018 1,35%                              | dal 01/07/2017 al 30/06/2018 1,28% | dal 01/11/2017 al 31/10/2018 1,47% |
| dal 01/04/2017 al 31/03/2018 1,33%                              | dal 01/08/2017 al 31/07/2018 1,38% | dal 01/12/2017 al 30/11/2018 1,45% |
| dal 01/05/2017 al 30/04/2018 1,27%                              | dal 01/09/2017 al 31/08/2018 1,42% | dal 01/01/2018 al 31/12/2018 1,37% |

| Fondo CBA Accumulo |  | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|--------------------|--|---|---|
| CODICE IMPRESA:    | 055  | Importi da libro mastro 1                             | Importi da libro mastro 1                                   |
| CODICE GESTIONE:   | 006  |   |   |
| 100                | Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:             | 516.642.635   | 420.572.633   |
| 101                | BTP  | 223.244.004   | 160.033.390   |
| 102                | CCT  | 49.875.610  | 48.955.537  |
| 103                | Altri titoli di Stato emessi in euro                 | 3.754.854   | 49.641.969  |
| 104                | Altri titoli di Stato emessi in valuta               | -   | 917.876   |
| 105                | Obbligazioni quotate in euro                         | 237.166.841   | 158.422.535   |
| 106                | Obbligazioni quotate in valuta                       | 851.326   | 851.326   |
| 107                | Obbligazioni non quotate in euro                     | 1.750.000   | 1.750.000   |
| 200                | Titoli di capitale:                                  | 950.929   | -   |
| 201                | Azioni quotate in euro                               | 950.929   | -   |
| 300                | Altre attività patrimoniali:                         | 18.619.017  | 35.407.089  |
| 303                | Quote di OICR  | 3.500.000   | 13.691.951  |
| 305                | Liquidita'   | 11.834.549  | 21.715.138  |
| 350                | Altre tipologie di attività di cui: 351 Ratei Attivi | 3.284.468   | -   |
| 400                | Passività patrimoniali:                              | 4.000   | -   |
| 401                | Debiti per spese di revisione contabile              | 4.000   | -   |
| <b>1000</b>        | <b>Saldo attività della gestione separata</b>        | <b>536.208.581</b>                                    | <b>455.979.722</b>  |

\* al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 06 febbraio 2019

|   | Ala chiusura del periodo di osservazione (31/12/2018) | Ala chiusura del periodo di osservazione prec. (31/12/2017) |
|---|---|---|
| Riserve matematiche   | 525.729.922   | 451.718.142   |
| Riserve matematiche relative a contratti stipulati con i contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008   | -   | -   |
| Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con i contrafforti 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 contrafforti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008 | -   | -   |

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

|     |  | A         | B | C | D | E | A+B+C-D-E |
|-----|--|-----------|---|---|---|---|-----------|
| 100 | Proventi da investimenti                                   | 9.462.715 |   |   |   |   |           |
| 101 | Interessi su titoli di Stato in euro                       | 6.197.343 |   |   |   |   |           |
| 102 | Interessi su titoli di Stato in valuta                     | 10.213    |   |   |   |   |           |
| 103 | Interessi su titoli obbligazionari in euro                 | 3.191.991 |   |   |   |   |           |
| 104 | Interessi su titoli obbligazionari in valuta               | 25.629    |   |   |   |   |           |
| 105 | Dividendi su azioni in euro                                | 37.539    |   |   |   |   |           |
| 200 | Utili/perdite da realizza                                  | 491.807   |   |   |   |   |           |
| 201 | Titoli di Stato in euro                                    | 85.027    |   |   |   |   |           |
| 202 | Titoli di Stato in valuta                                  | -49.102   |   |   |   |   |           |
| 203 | Titoli obbligazionari quotati in euro                      | 475.392   |   |   |   |   |           |
| 207 | Titoli azionari quotati in euro                            | -15.974   |   |   |   |   |           |
| 250 | Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR |           |   |   |   |   |           |