Ania

Associazione Nazionale
fra le Imprese Assicuratrici

SUMMARY REPORT

Fondi interni collegati a polizze Vita unit-linked

Rilevazione al 2° Trimestre 2020

Summary report - Fondi interni collegati a polizze Vita Unit-Linked

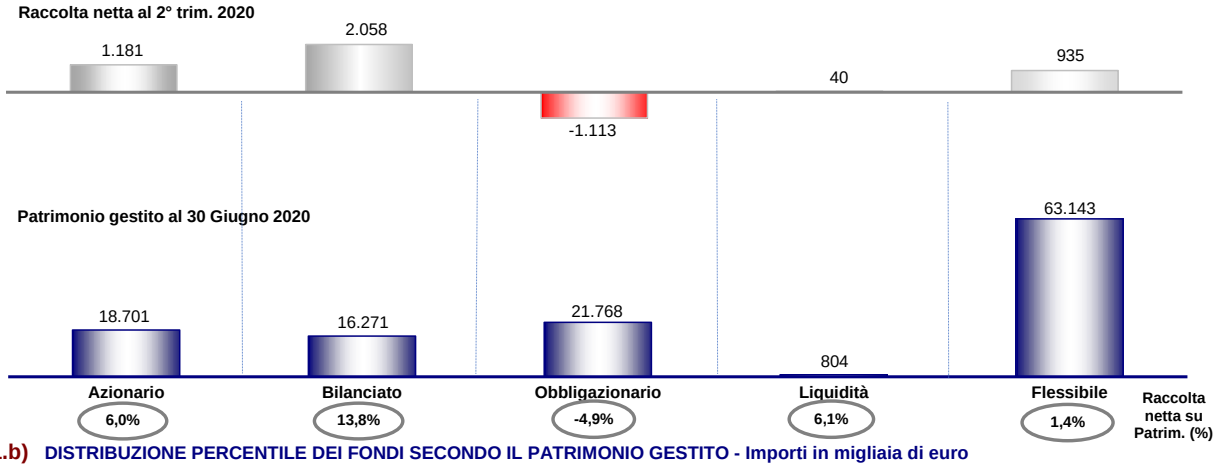
Rilevazione al 2° trim. 2020

1.a) NUMERO FONDI, PATRIMONIO GESTITO E RACCOLTA NETTA - Importi in milioni di euro

Tipologia di fondo	Numero fondi	Patrimonio gestito al 30.06.2020	Distr. patrim. gestito (%)	Raccolta netta al 30.06.2020	Incid. Racc. netta su Patrim. gestito a inizio anno (%)
Azionario	441	18.701	15,5	1.181	6,0
Bilanciato	426	16.271	13,5	2.058	13,8
Obbligazionario	456	21.768	18,0	-1.113	-4,9
Liquidità	32	804	0,7	40	6,1
Flessibile	1.824	63.143	52,3	935	1,4
Totale campione	**3.179**	**120.686**	**100,0**	**3.101**	**2,5**
*- di cui PIP**	*99*	*8.243*	*6,8*	*433*	*5,0*
*- di cui PIR***	*29*	*2.553*	*2,1*	*81*	*3,0*

(*) Pip - Piani pensionistici individuali - articolo 13, comma 1, lettera b) d.lgs. 5 dicembre 2005, n. 252

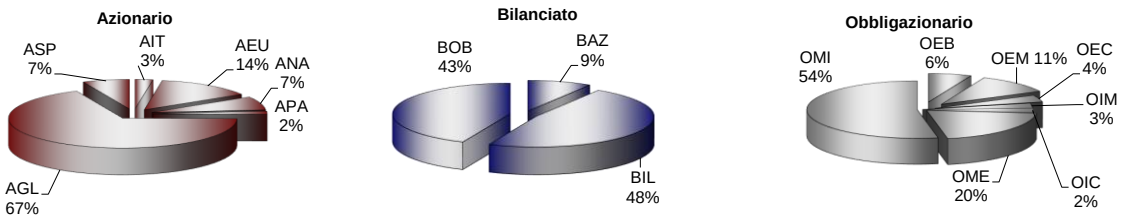
(**) Pir - Piani individuali di risparmio - articolo 1, commi 100-114, Legge 11 dicembre 2016, n. 232 e successive modifiche e integrazioni



1.b) DISTRIBUZIONE PERCENTILE DEI FONDI SECONDO IL PATRIMONIO GESTITO - Importi in migliaia di euro

Azionario		Bilanciato		Obbligazionario		Liquidità		Flessibile		Totale	
Distr.%-ile	Patrim.	Distr.%-ile	Patrim.	Distr.%-ile	Patrim.	Distr.%-ile	Patrim.	Distr.%-ile	Patrim.	Distr.%-ile	Patrim.
1°quart.	502	1°quart.	551	1°quart.	568	1°quart.	329	1°quart.	82	1°quart.	146
Mediana	2.957	Mediana	3.000	Mediana	3.454	Mediana	1.860	Mediana	380	Mediana	1.029
3°quart.	17.785	3°quart.	13.853	3°quart.	25.041	3°quart.	5.234	3°quart.	3.834	3°quart.	8.406
Imp. Medio	42.406	Imp. Medio	38.195	Imp. Medio	47.737	Imp. Medio	25.115	Imp. Medio	34.618	Imp. Medio	37.964

1.c) DISTRIBUZIONE % DEL PATRIMONIO GESTITO PER CATEGORIA DEL FONDO (vedasi legenda - Categorie ANIA)



NOTA: Fondi di liquidità poco rappresentativi. Fondi flessibili costituiti da una sola categoria.

LEGENDA - Categorie ANIA

azionari Italia	AIT	bilanciati	BIL	obbligazionari puri corporate internazionali	OIC
azionari Europa	AEU	bilanciati-obbigaz.	BOB	obbligazionari misti area euro	OME
azionari Nord America	ANA	obblig. puri gover. euro breve term.	OEB	obbligazionari misti internazionali	OMI
azionari Pacifico	APA	obblig. puri gover. euro medio-lungo term.	OEM	liquidità area euro	LAE
azionari globale	AGL	obblig. puri corporate euro	OEC	liquidità altre valute	LAA
azionari specializzati	ASP	obblig. puri gover. internaz. breve term.	OIB	flessibili	FLE
bilanciati-azionari	BAZ	obblig. puri gover. internaz. medio-lungo term.	OIM		

Summary report - Fondi interni collegati a polizze Vita Unit-Linked

Rilevazione al 2° trim. 2020

1.d) PATRIMONIO GESTITO E RACCOLTA NETTA PER TIPOLOGIA DI FONDO - Importi in milioni di euro

Anno / Trimestre \ Tipologia di fondo		Azionario	Bilanciato	Obbligazionario	Liquidità	Flessibile	Totale
Patrimonio gestito al:							
2018	- 31 marzo	14.662	9.558	19.716	632	60.350	104.917
	- 30 giugno	15.543	10.170	19.430	583	64.066	109.792
	- 30 settembre	14.510	10.517	19.534	613	62.100	107.274
	- 31 dicembre	14.510	10.517	19.534	613	62.100	107.274
2019	- 31 marzo	16.932	11.679	20.088	618	68.118	117.435
	- 30 giugno	17.299	12.746	21.130	641	66.621	118.436
	- 30 settembre	18.148	13.810	22.426	665	66.086	121.136
	- 31 dicembre	15.726	13.842	22.637	789	60.225	113.219
2020	**- 31 marzo**	**15.726**	**13.842**	**22.637**	**789**	**60.225**	**113.219**
	- 30 giugno	**18.701**	**16.271**	**21.768**	**804**	**63.143**	**120.686**
	- 30 settembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- 31 dicembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
Raccolta netta da inizio anno al:							
2018	- I° trim.	238	535	-252	93	1.800	2.414
	- II° trim.	583	1.037	-420	46	4.347	5.593
	- III° trim.	1.038	1.471	-212	88	5.674	8.060
	- IV° trim.	1.541	1.743	-283	82	5.871	8.955
2019	- I° trim.	255	548	41	-8	-267	569
	- II° trim.	517	1.411	867	17	-775	2.035
	- III° trim.	944	2.106	1.771	43	-699	4.165
	- IV° trim.	1.297	2.908	2.037	37	-761	5.518
2020	**- I° trim.**	**152**	**564**	**333**	**153**	**132**	**1.335**
	- II° trim.	**1.181**	**2.058**	**-1.113**	**40**	**935**	**3.101**
	- III° trim.	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- IV° trim.	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
Incidenza % Raccolta netta su Patrimonio gestito a inizio anno:							
2018	- I° trim.	1,8	10,9	-1,2	17,6	4,6	3,1
	- II° trim.	4,4	21,1	-2,1	8,7	11,1	7,1
	- III° trim.	7,8	29,9	-1,0	16,7	14,4	10,3
	- IV° trim.	11,5	35,4	-1,4	15,6	14,9	11,4
2019	- I° trim.	1,8	5,2	0,2	-1,3	-0,4	0,5
	- II° trim.	3,6	13,4	4,4	2,7	-1,2	1,9
	- III° trim.	6,5	20,0	9,1	7,0	-1,1	3,9
	- IV° trim.	8,9	27,7	10,4	6,0	-1,2	5,1
2020	**- I° trim.**	**1,0**	**4,1**	**1,5**	**19,4**	**0,2**	**1,2**
	- II° trim.	**7,5**	**14,9**	**-4,9**	**5,0**	**1,6**	**2,7**
	- III° trim.	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- IV° trim.	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**

Summary report - Fondi interni collegati a polizze Vita Unit-Linked

Rilevazione al 2° trim. 2020

2.a) ANALISI DEL RENDIMENTO E DELLA VOLATILITA'

Categorie ANIA		Distribuz. patr. gestito (%)	Rendimento cumulato (%)			Rendim. medio annuo (%)		Volatilità settim. annualizzata (%)	
			A 1 anno	A 3 anni	A 5 anni	A 3 anni	A 5 anni	A 3 anni	A 5 anni
A I T	azionari Italia	0,4	-2,09	-2,54	-9,22	-0,85	-1,92	10,31	19,18
A E U	azionari Europa	2,1	-7,43	-7,45	-7,98	-2,55	-1,65	17,49	17,10
A N A	azionari Nord America	1,1	4,19	17,85	27,59	5,63	4,99	18,69	16,58
A P A	azionari Pacifico	0,3	1,19	0,89	4,60	0,29	0,90	20,12	15,82
A G L	azionari globale	10,6	-2,63	3,35	6,86	1,10	1,34	15,41	15,18
A S P	azionari specializzati	1,0	-1,25	3,55	6,19	1,17	1,21	13,68	12,67
AZIONARI		***15,5***	***-2,62***	***2,76***	***6,63***	***0,91***	***1,29***	***15,78***	***15,36***
B A Z	bilanciati-azionari	1,2	-1,26	3,40	6,87	1,12	1,34	12,66	11,76
B I L	bilanciati	6,4	1,05	2,53	5,70	0,84	1,12	8,22	7,34
B O B	bilanciati-obbligazionari	5,9	-0,58	1,06	3,58	0,35	0,71	6,55	6,68
BILANCIATI		***13,5***	***0,07***	***1,89***	***5,20***	***0,62***	***1,02***	***7,91***	***7,88***
O E B	obbligazionari puri governativi euro breve termine	1,1	-0,74	-2,12	-3,05	-0,71	-0,62	1,31	1,17
O E M	obbligazionari puri governativi euro medio-lungo termine	2,0	0,47	3,38	5,18	1,11	1,02	3,89	3,34
O E C	obbligazionari puri corporate euro	0,7	-1,87	0,45	2,82	0,15	0,56	5,24	4,13
O I B	obbligazionari puri governativi internaz. breve termine	0,0	-0,91	-2,74	-4,38	-0,92	-0,89	2,42	2,35
O I M	obbligazionari puri governativi internaz. medio-lungo termine	0,5	8,06	11,48	11,11	3,69	2,13	7,40	7,54
O I C	obbligazionari puri corporate internazionali	0,4	-2,45	-2,24	3,17	-0,75	0,63	12,58	9,00
O M E	obbligazionari misti area euro	3,7	-0,05	0,44	1,05	0,15	0,21	4,04	4,14
O M I	obbligazionari misti internazionali	9,6	-1,49	-1,09	3,05	-0,36	0,60	5,83	4,53
OBBLIGAZIONARI		***18,0***	***-0,67***	***0,15***	***2,71***	***0,05***	***0,54***	***5,10***	***4,20***
L A E	liquidità area euro	0,7	-1,18	-3,46	-5,56	-1,17	-1,14	0,34	0,32
L A A	liquidità altre valute	0,0	4,01	4,97	1,71	1,63	0,34	6,71	6,57
LIQUIDITA'		***0,7***	***-1,15***	***-3,42***	***-5,52***	***-1,15***	***-1,13***	***0,37***	***0,35***
FLESSIBILI		***52,3***	***-1,99***	***-2,44***	***-1,59***	***-0,82***	***-0,32***	***7,46***	***7,33***
TOTALE CAMPIONE		**100,0**	**-1,59**	**-0,65**	**1,74**	**-0,22**	**0,35**	**8,48**	**8,47**

Nota

Il rendimento e la volatilità sono medie ponderate con il volume del patrimonio gestito alla fine del periodo di osservazione. La voce "Totale campione" riporta l'analisi complessiva di tutti i fondi analizzati.

Summary report - Fondi interni collegati a polizze Vita Unit-Linked

Rilevazione al 2° trim. 2020

Ania
Associazione Nazionale fra le Imprese Assicuratrici

2.b) RENDIMENTO CUMULATO PER TIPOLOGIA DI FONDO - Valori in %

Anno / Trimestre \ Tipologia di fondo		Azionario	Bilanciato	Obbligazionario	Liquidità	Flessibile	Totale
Rendimento cumulato a 1 anno al:							
2018	- 31 marzo	-1,96	-0,85	-0,70	-1,27	-1,18	-1,17
	- 30 giugno	3,04	0,27	-1,37	-1,49	-1,10	-0,42
	- 30 settembre	3,93	0,23	-1,39	-1,39	-0,91	-0,18
	- 31 dicembre	-12,30	-6,50	-3,76	-1,31	-7,47	-7,34
2019	- 31 marzo	3,14	1,27	-0,06	-1,01	-1,04	-0,03
	- 30 giugno	1,39	2,21	2,06	-0,78	-0,10	0,73
	- 30 settembre	2,11	4,29	4,58	-0,77	0,89	2,11
	- 31 dicembre	-13,43	-5,56	-2,35	-1,35	-6,57	-6,55
2020	**- 31 marzo**	**-13,43**	**-5,56**	**-2,35**	**-1,35**	**-6,57**	**-6,55**
	- 30 giugno	**-2,62**	**0,07**	**-0,67**	**-1,15**	**-1,99**	**-1,59**
	- 30 settembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- 31 dicembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
Rendimento cumulato a 3 anni al:							
2018	- 31 marzo	-1,32	-1,69	-2,75	-3,40	-4,49	-3,28
	- 30 giugno	5,65	3,31	-0,22	-3,51	-1,67	0,44
	- 30 settembre	19,69	8,36	0,87	-3,52	3,70	6,49
	- 31 dicembre	-0,43	-1,39	-2,32	-3,50	-4,76	-3,09
2019	- 31 marzo	18,20	6,51	0,30	-3,42	1,90	4,82
	- 30 giugno	18,96	7,74	0,93	-3,33	3,28	5,83
	- 30 settembre	16,85	7,99	2,23	-3,28	3,10	5,65
	- 31 dicembre	-10,89	-5,37	-2,66	-3,66	-8,31	-7,24
2020	**- 31 marzo**	**-10,89**	**-5,37**	**-2,66**	**-3,66**	**-8,31**	**-7,24**
	- 30 giugno	**2,76**	**1,89**	**0,15**	**-3,42**	**-2,44**	**-0,65**
	- 30 settembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- 31 dicembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
Rendimento cumulato a 5 anni al:							
2018	- 31 marzo	31,45	20,30	7,56	-4,00	13,65	16,77
	- 30 giugno	37,77	23,13	7,68	-4,34	15,00	19,45
	- 30 settembre	36,90	20,94	6,85	-4,55	13,48	18,41
	- 31 dicembre	14,28	10,07	4,18	-4,67	4,06	7,09
2019	- 31 marzo	27,62	16,26	6,08	-4,84	7,65	12,70
	- 30 giugno	24,03	15,45	5,94	-5,05	6,17	10,96
	- 30 settembre	25,18	16,48	6,91	-5,17	7,21	11,98
	- 31 dicembre	-9,91	-6,32	-4,36	-5,74	-11,51	-8,87
2020	**- 31 marzo**	**-9,91**	**-6,32**	**-4,36**	**-5,74**	**-11,51**	**-8,87**
	- 30 giugno	**6,63**	**5,20**	**2,71**	**-5,52**	**-1,59**	**1,74**
	- 30 settembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**
	- 31 dicembre	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**	**-**

Il rendimento è ottenuto come media ponderata con il volume del patrimonio gestito alla fine del periodo di osservazione. La voce "Totale campione" riporta l'analisi complessiva di tutti i fondi analizzati.