

## Cli ETF Easy Short




### COMPOSIZIONE

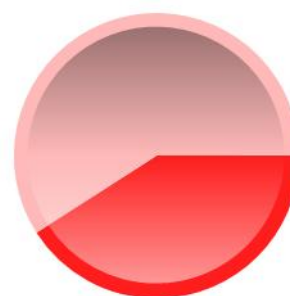
Periodo di analisi: da 20/03/2008 a 13/06/2014

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.% ultima quota	Quantità	Contro valore	Peso %
 Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	Etf e Etc	152,69	159,07	-0,27%	64,30	10.228,20	40,93%
 iShares S&P 500 UCITS ETF (Inc)	Etf e Etc	14,33	14,26	0,02%	512,00	7.298,56	29,20%
 Ossiam Stoxx Europe 600 Equal Weight NR UCITS ETF	Etf e Etc	65,70	68,96	-0,50%	108,00	7.447,68	29,80%
 Liquidità						17,16	0,07%
<b>Totale</b>						<b>24.991,6</b>	

Tutti i valori sono espressi in EUR

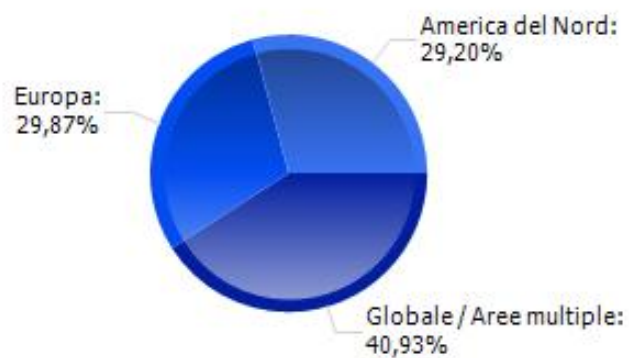
### Composizione del portafoglio:

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
 Strumenti azionari ed assimilabili ad alta volatilità	oltre 20%	40,93%
 Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	59,00%
 Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,07%

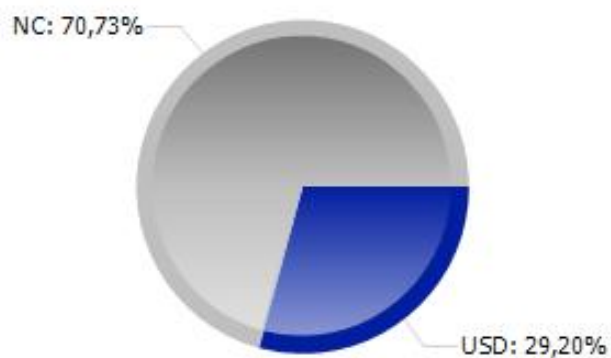


**Esposizione geografica del portafoglio:**

<b>Esposizione geografica</b>	<b>Peso %</b>
■ Globale / Aree multiple	40,93%
■ Europa	29,87%
■ America del Nord	29,20%
■ Non classificato (NC)	0,00%

**Esposizione valutaria del portafoglio:**

<b>Esposizione valutaria</b>	<b>Peso %</b>
■ USD	29,20%
■ EUR	0,07%
■ Non classificato (NC)	70,73%



## Evoluzione del portafoglio, periodo: 20/03/2008 - 13/06/2014



Patrimonio a inizio periodo: 10.000,00 EUR

Patrimonio a fine periodo: 24.991,60 EUR

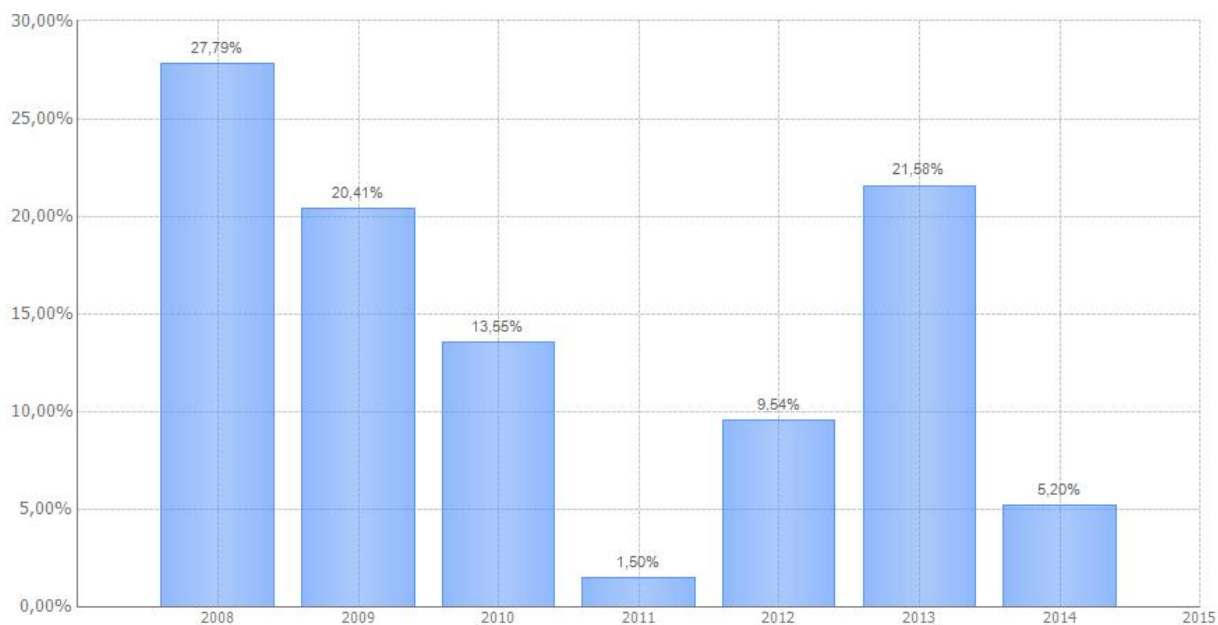
## Evoluzione rispetto ad un benchmark, periodo: 20/03/2008 - 13/06/2014


 Cli ETF Easy Short

 Ben.Diversificati (Azioni 30-70%)

**ANALISI**

Rendimento annualizzato: 15,82%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	5,20%	8,83%	5,63%	1,33	30,12	5,28%
1 anno	17,46%	9,72%	5,73%	1,78	43,14	5,28%
3 anni	43,14%	8,80%	5,20%	1,38	33,49	9,77%
5 anni	92,58%	10,48%	6,28%	1,25	29,91	9,77%
Da inizio periodo	149,92%	11,06%	6,57%	1,32	31,92	9,77%