

## Cli ETF Easy NO 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%	51,50	8.192,11	39,79%
 iShares S&P 500 UCITS ETF (Inc)	Etf e Etc	14,33	14,26	0,02%	420,00	5.987,10	29,08%
 Ossiam Stoxx Europe 600 Equal Weight NR UCITS ETF	Etf e Etc	65,70	68,96	-0,50%	92,00	6.344,32	30,82%
 Liquidità						64,78	0,31%
<b>Totale</b>						<b>20.588,31</b>	

Tutti i valori sono espressi in EUR

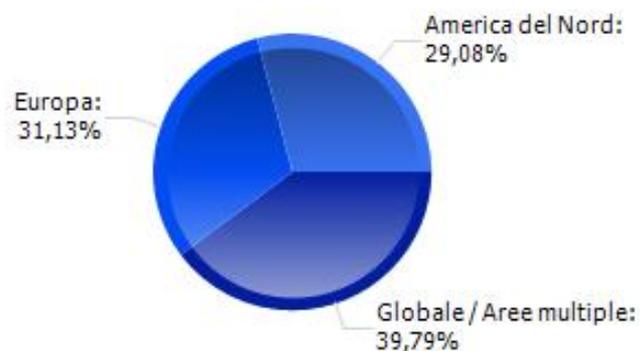
### Composizione del portafoglio:

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
 Strumenti azionari ed assimilabili ad alta volatilità	oltre 20%	39,79%
 Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	59,90%
 Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,31%

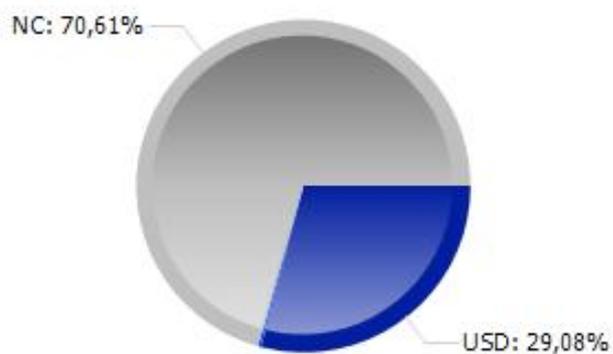


**Esposizione geografica del portafoglio:**

Esposizione geografica	Peso %
■ Globale / Aree multiple	39,79%
■ Europa	31,13%
■ America del Nord	29,08%
■ Non classificato (NC)	0,00%

**Esposizione valutaria del portafoglio:**

Esposizione valutaria	Peso %
■ USD	29,08%
■ EUR	0,31%
■ Non classificato (NC)	70,61%



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



Patrimonio a inizio periodo: 10.000,00 EUR

Patrimonio a fine periodo: 20.588,31 EUR

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

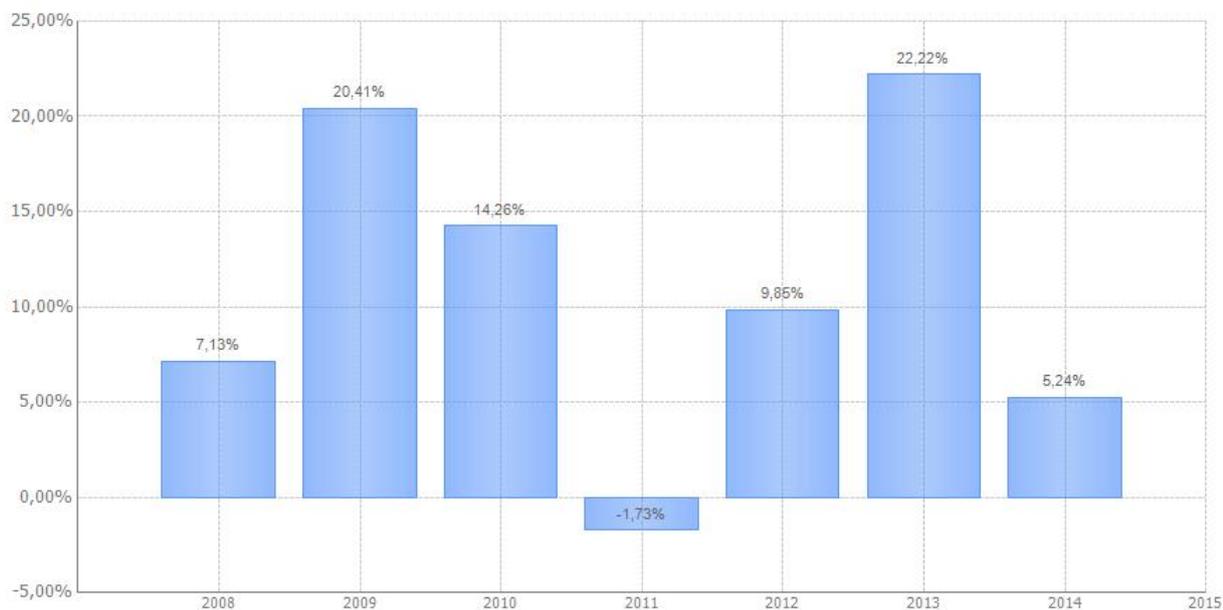


■ Cli ETF Easy NO Short

■ BSCI117

**ANALISI**

Rendimento annualizzato: 12,28%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	5,24%	9,00%	5,76%	1,31	29,76	5,40%
1 anno	17,84%	9,95%	5,86%	1,78	43,06	5,40%
3 anni	45,57%	9,04%	5,35%	1,42	34,31	10,02%
5 anni	89,25%	10,66%	6,40%	1,19	28,39	12,68%
Da inizio periodo	105,88%	9,96%	5,99%	1,11	26,35	12,68%