

## Portafoglio: Cli ETF Easy NO Short

## COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 20/03/2008 a 05/12/2016

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var. %	Quantità	Contro valore	Peso %
 iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	Etf e Etc	18,67	20,54	10,01%	274,00	5.627,28	22,10%
 Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	Etf e Etc	49,83	50,00	0,33%	106,00	5.299,47	20,81%
 Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	Etf e Etc	151,32	152,62	0,86%	95,00	14.498,90	56,95%
 Liquidità						34,36	0,13%
<b>Totale</b>						<b>25.460,01</b>	

Tutti i valori sono espressi in EUR

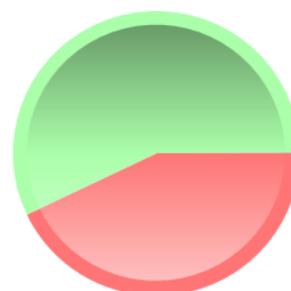
**PIANO CEDOLARE**

<b>Strumento</b>	<b>Cedole passate</b>	<b>Cedole previste</b>
iShares MSCI World UCITS ETF Dis \$	469,80	0,00
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF Dis EUR	340,79	0,00
iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	306,26	0,00
<b>Totale</b>	<b>1116,85</b>	<b>0,00</b>

## GRAFICO PIANO CEDOLARE

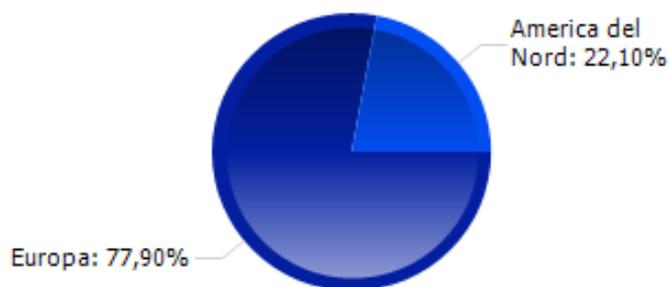
### Composizione del portafoglio:

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
■ Strumenti azionari ed assimilabili a media volatilità	fino a 20%	42,92%
■ Strumenti obbligazionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 5%	56,95%
■ Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,13%



### Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
■ Europa	77,90%
■ America del Nord	22,10%



## Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
EUR	77,90%
USD	22,10%



## Evoluzione del portafoglio, periodo: 20/03/2008 - 05/12/2016



Patrimonio a inizio periodo: 10.000,00 EUR

Patrimonio a fine periodo: 25.460,01 EUR

Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 20/03/2008 - 05/12/2016

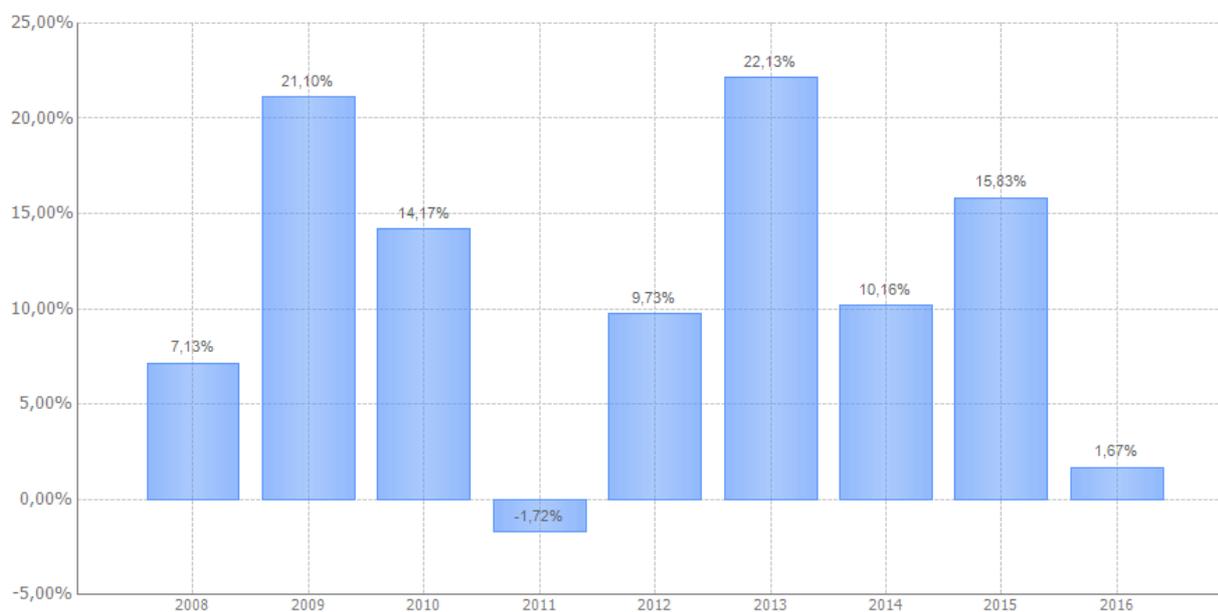


■ Cli ETF Easy NO Short

■ 50 ML EUR BROAD 3-5y+50MSCI WRL

## ANALISI

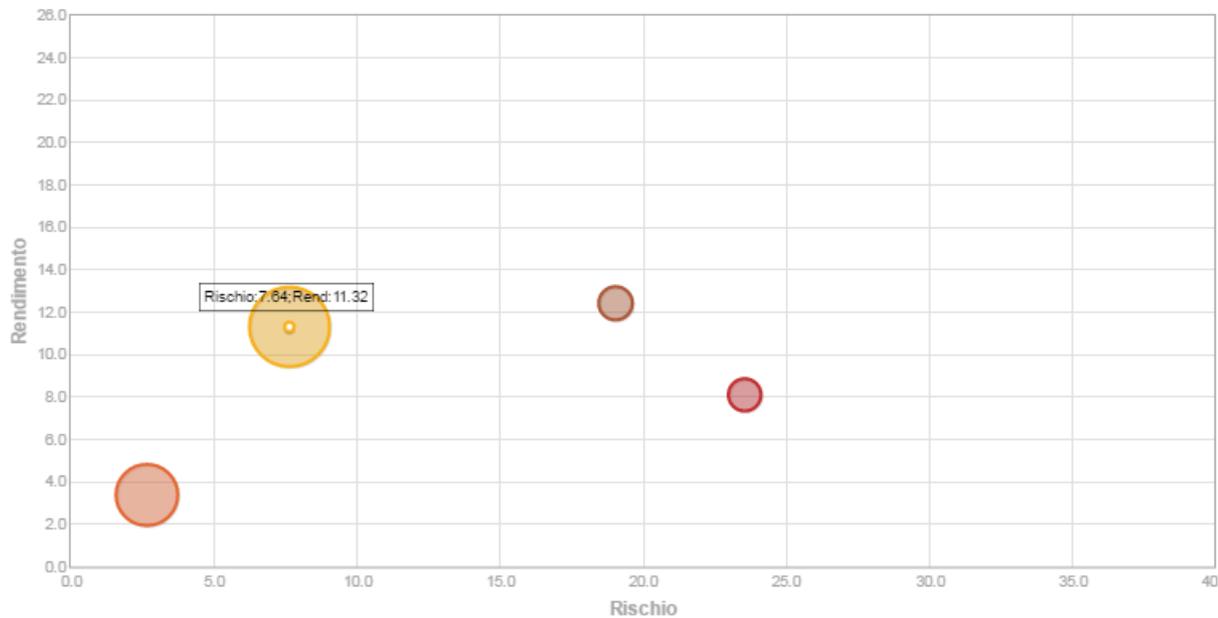
Rendimento annualizzato: 11,32%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	1,67%	2,80%	1,38%	0,88	1,78	3,33%
1 anno	2,64%	2,80%	1,38%	0,88	1,78	3,33%
3 anni	33,13%	5,80%	2,18%	1,50	4,00	5,91%
5 anni	78,05%	6,42%	2,64%	1,87	4,55	9,99%
10 anni		7,64%	3,60%	1,33	2,82	
Da inizio periodo	154,60%	7,64%	3,60%	1,33	2,82	12,62%

## RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 20/03/2008 a 05/12/2016



Nome	Rendimento*	Rischio*
<span style="color: orange;">■</span> Cli ETF Easy NO Short	11,32 %	7,64 %
<span style="color: red;">■</span> Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	3,39 %	2,66 %
<span style="color: brown;">■</span> iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	12,43 %	19,03 %
<span style="color: darkred;">■</span> Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	8,11 %	23,54 %

\* valori annualizzati