

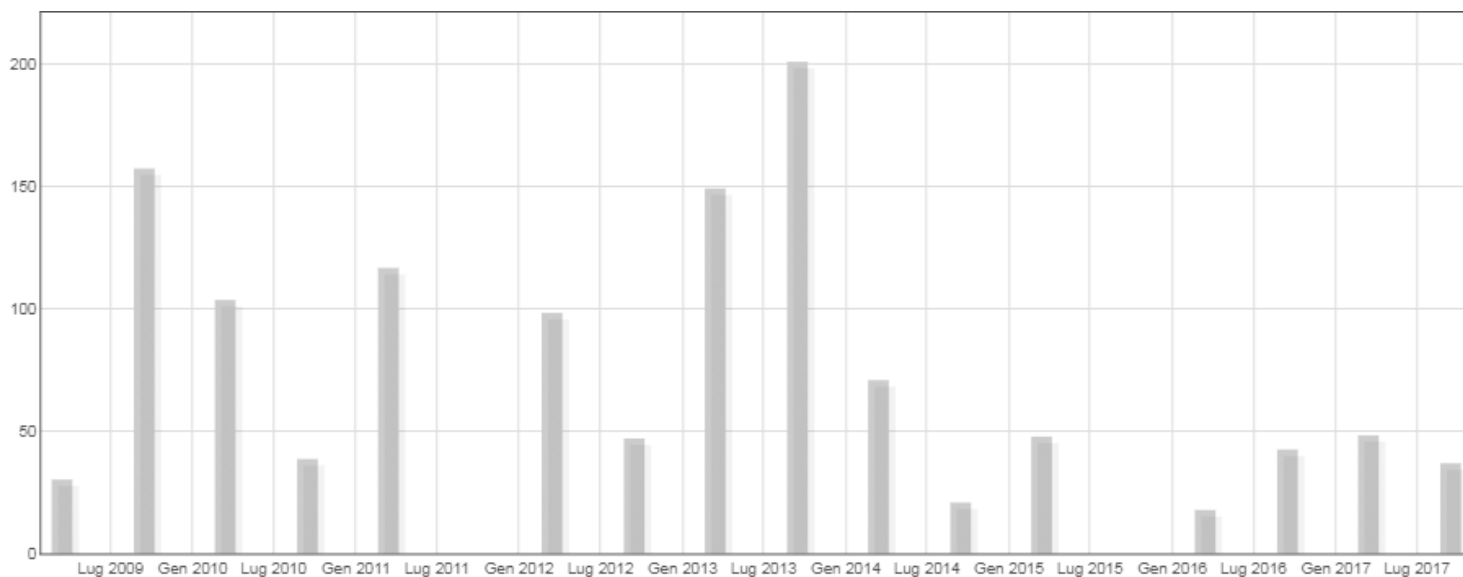
## Portafoglio: Cli ETF Easy NO Short

## COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 20/03/2008 a 10/10/2017

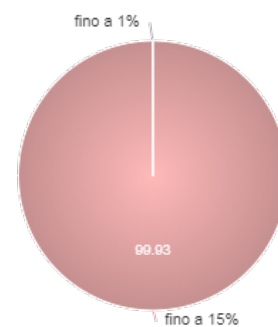
Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.%	Quantità	Contro valore	Peso %
 iShares S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	Etf e Etc	19,72	21,47	8,91%	391,00	8.395,75	30,02%
 Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	Etf e Etc	215,00	224,54	4,44%	49,00	11.002,46	39,34%
 Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	Etf e Etc	50,65	61,07	20,58%	140,00	8.549,80	30,57%
 Liquidità						20,80	0,07%
<b>Totale</b>						<b>27.968,8</b>	

Tutti i valori sono espressi in EUR



## Composizione di portafoglio

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	99,93%
Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,07%



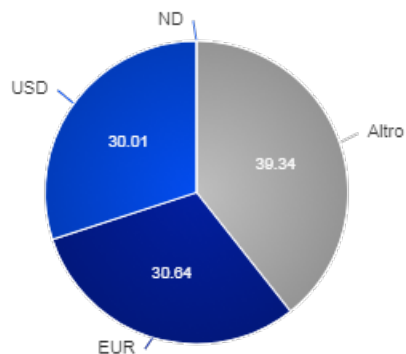
## Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
Globale / Aree multiple	39,34%
Europa	30,64%
America del Nord	30,02%



## Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
EUR	30,64%
USD	30,01%
ND	0,01%
GBP	0,00%
Altro	39,34%



## Esposizione per Asset del portafoglio:

Esposizione per Asset	Peso %
Azioni	99,93%
Liquidità	0,07%



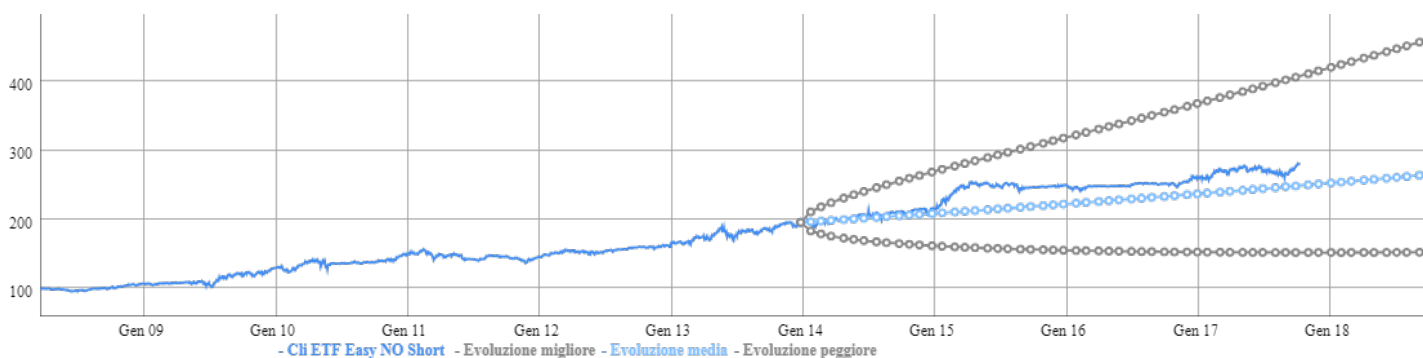
Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 20/03/2008 - 10/10/2017



Cli ETF Easy NO Short

MSCI World (EUR)

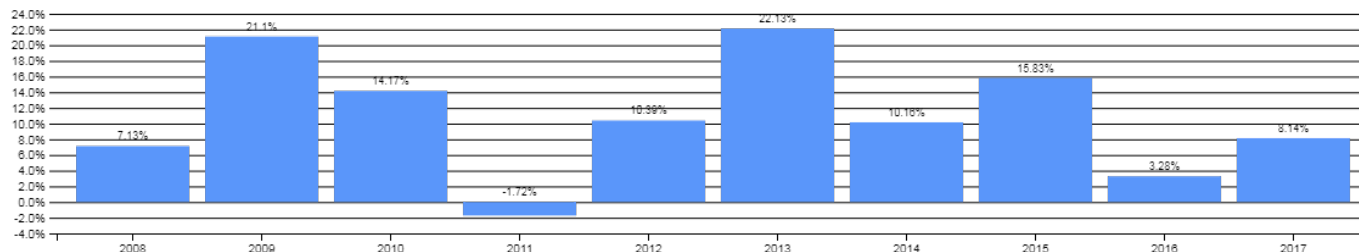
Cono di volatilità calcolato sul periodo:



percentile: 95 %

## ANALISI

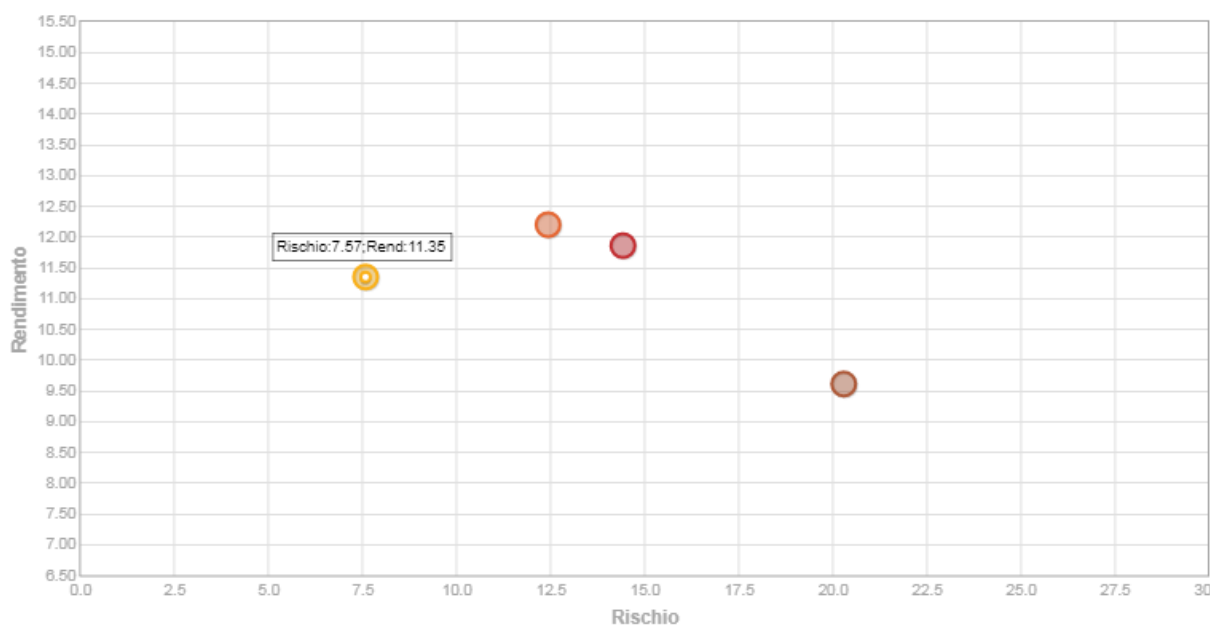
Rendimento annualizzato: 11,35%







Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	8,14%	7,22%	1,89%	1,33	5,09	6,08%
1 anno	10,95%	6,61%	1,71%	1,74	6,73	6,08%
3 anni	33,22%	6,58%	2,20%	1,41	4,20	6,08%
5 anni	74,47%	6,69%	2,71%	1,73	4,26	9,99%
10 anni		7,57%	3,48%	1,36	2,95	
Da inizio	179,69%	7,57%	3,48%	1,36	2,95	12,62%

## RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 20/03/2008 a 10/10/2017



Nome	Rendimento*	Rischio*
 Cli ETF Easy NO Short	11,35 %	7,57 %
 Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	12,20 %	12,42 %
 Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	9,61 %	20,28 %
 iShares S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	11,86 %	14,41 %

\* valori annualizzati