

Portafoglio: Cli ETF Easy NO Short

COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 20/03/2008 a 17/01/2017

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.%	Quantità	Contro valore	Peso %
iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	Etf e Etc	19,35	21,10	9,04%	367,00	7.744,62	29,84%
Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	Etf e Etc	214,14	213,43	-0,33%	43,70	9.326,89	35,93%
Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	Etf e Etc	50,25	52,89	5,26%	133,00	7.034,37	27,10%
Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	Etf e Etc	151,32	153,27	1,29%	12,00	1.839,24	7,09%
Liquidità						12,49	0,05%
Totale						25.957,61	

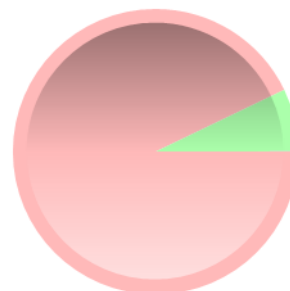
Tutti i valori sono espressi in EUR

PIANO CEDOLARE

Strumento	Cedole passate	Cedole previste
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 \$	331,62	0,00
Totale	1142,22	0,00

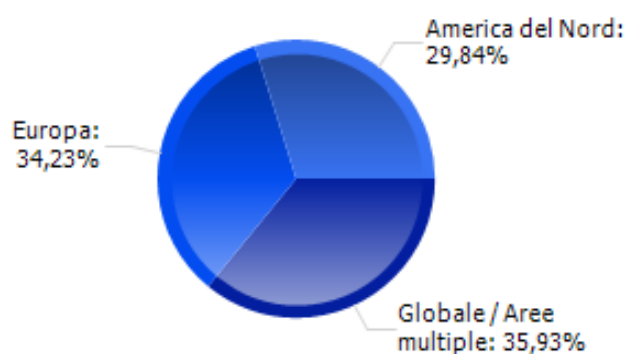
Composizione del portafoglio:

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	92,87%
Strumenti obbligazionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 5%	7,09%
Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,05%



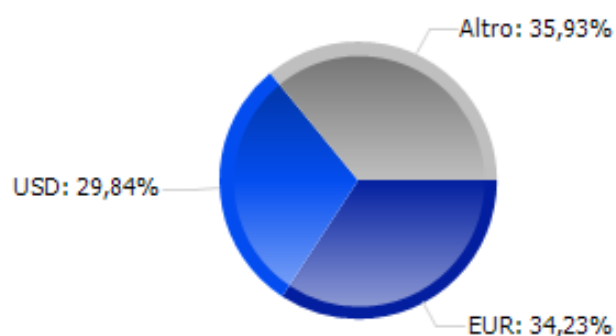
Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
Globale / Aree multiple	35,93%
Europa	34,23%
America del Nord	29,84%



Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
EUR	34,23%
USD	29,84%
Altro	35,93%



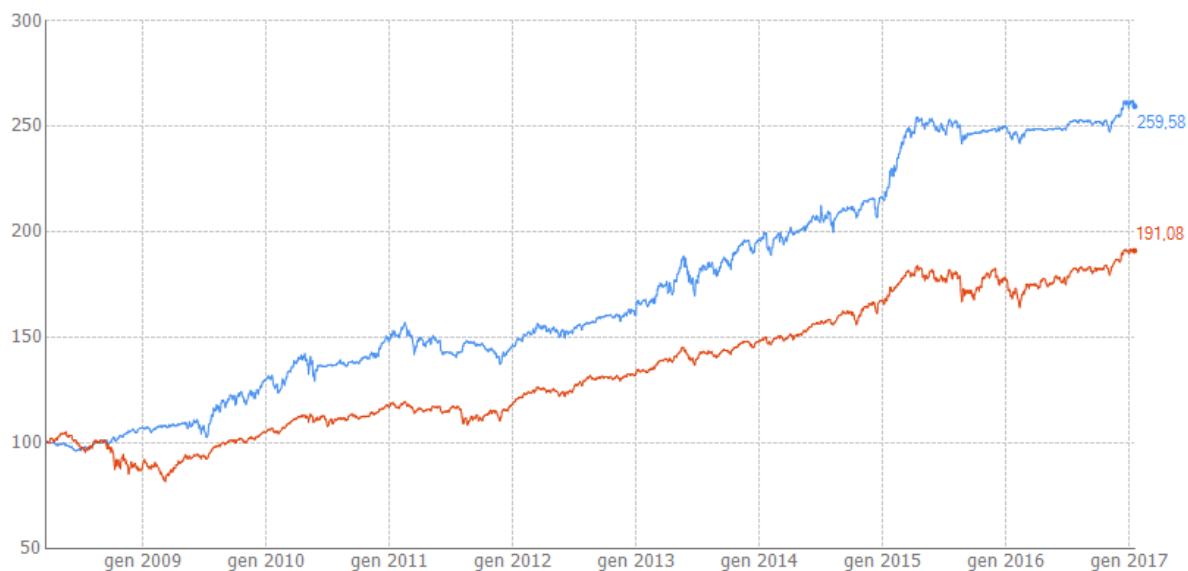
Evoluzione del portafoglio, periodo: 20/03/2008 - 17/01/2017



Patrimonio a inizio periodo: 10.000,00 EUR

Patrimonio a fine periodo: 25.957,61 EUR

Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 20/03/2008 - 17/01/2017

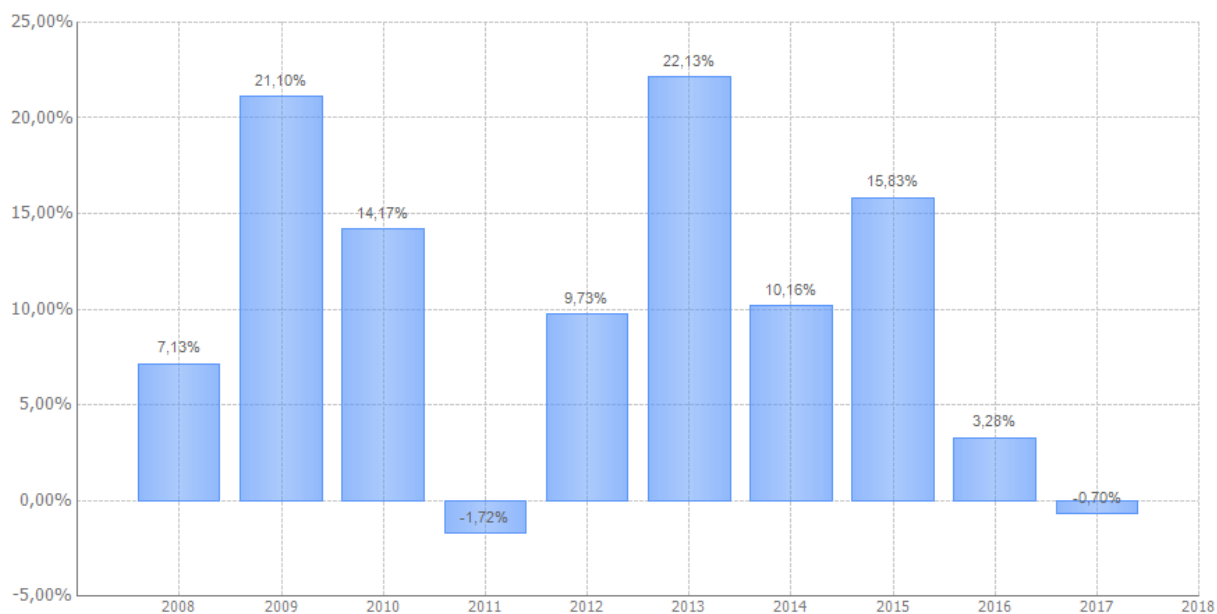


■ Cli ETF Easy NO Short

■ 50 ML EUR BROAD 3-5y+50MSCI WRL

ANALISI

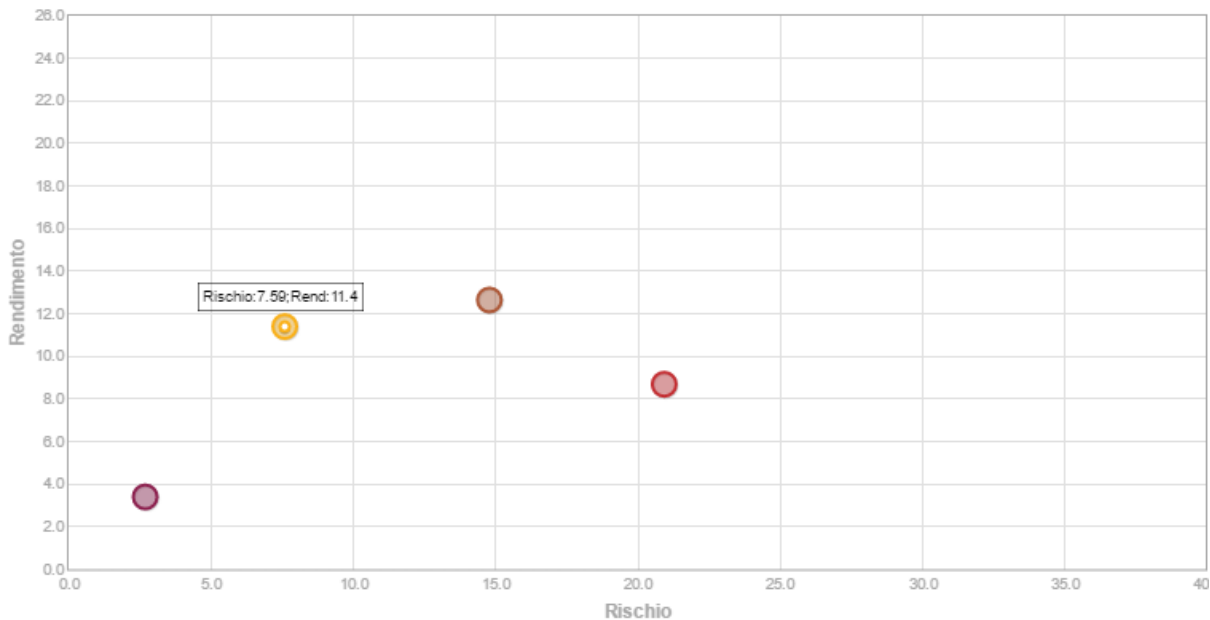
Rendimento annualizzato: 11,4%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	-0,70%	2,78%	1,33%	1,43	3,00	1,11%
1 anno	6,10%	2,87%	1,38%	1,28	2,66	2,31%
3 anni	30,02%	5,76%	2,18%	1,62	4,28	5,91%
5 anni	73,85%	6,21%	2,64%	1,86	4,37	9,99%
10 anni		7,59%	3,59%	1,36	2,87	
Da inizio periodo	159,58%	7,59%	3,59%	1,36	2,87	12,62%

RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 20/03/2008 a 17/01/2017



Nome	Rendimento*	Rischio*
■ Cli ETF Easy NO Short	11,40 %	7,59 %
■ Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	-	-
■ iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	12,65 %	14,78 %
■ Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	8,69 %	20,92 %
■ Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	3,40 %	2,69 %

* valori annualizzati