

Portafoglio: Cli ETF Easy NO Short

COMPOSIZIONE

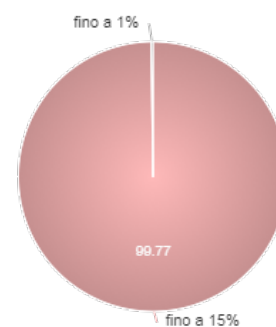
Periodo di analisi: da 22/12/2007 a 22/12/2017

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.%	Quantità	Contro valore	Peso %
iShares S&P 500 UCITS ETF USD (Dist) [IE0031442068]	Etf e Etc	19,72	22,53	14,24%	391,00	8.807,28	30,48%
Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World [FR0011079466]	Etf e Etc	215,00	232,55	8,16%	49,00	11.394,95	39,44%
Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv. [FR0010344887]	Etf e Etc	50,65	61,60	21,63%	140,00	8.624,00	29,85%
Liquidità						65,38	0,23%
Totale						28.891,6	

Tutti i valori sono espressi in EUR

Composizione di portafoglio

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	99,77%
Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,23%



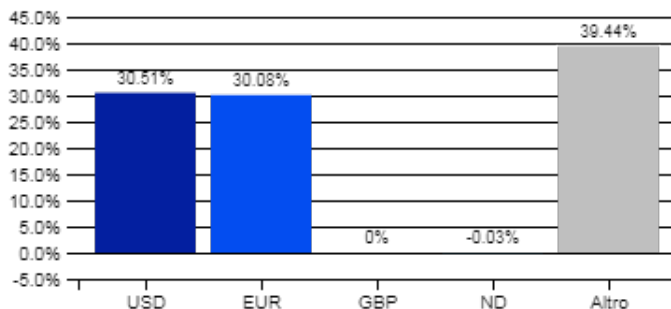
Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
Globale / Aree multiple	39,44%
America del Nord	30,48%
Europa	30,08%



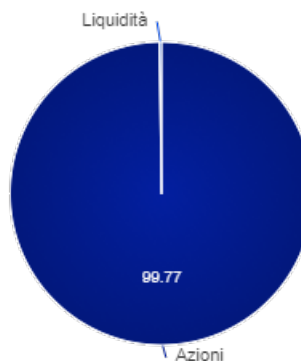
Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
USD	30,51%
EUR	30,08%
GBP	0,00%
ND	-0,03%
Altro	39,44%



Esposizione per Asset del portafoglio:

Esposizione per Asset	Peso %
Azioni	99,77%
Liquidità	0,23%



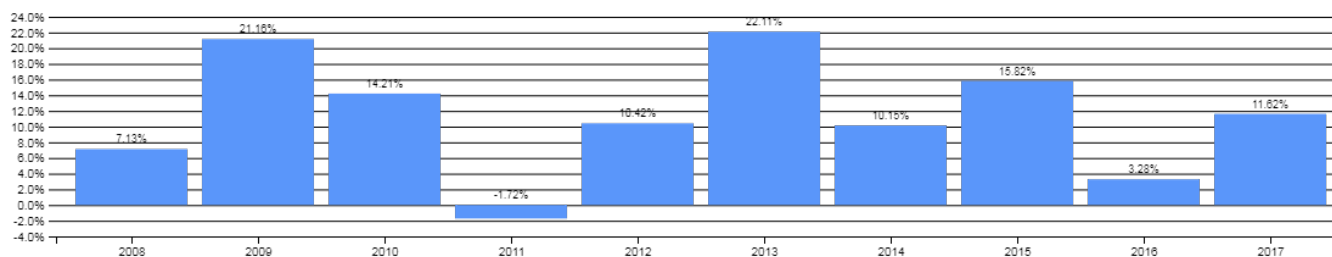
Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 20/03/2008 - 22/12/2017



- Cli ETF Easy NO Short
- MSCI World (EUR)

ANALISI

Rendimento annualizzato: 11,48%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	11,62%	7,52%	1,97%	1,48	5,65	6,07%
1 anno	10,89%	7,52%	1,97%	1,48	5,65	6,07%
3 anni	34,66%	6,02%	2,27%	1,33	3,52	6,07%
5 anni	77,56%	6,85%	2,74%	1,75	4,38	9,98%

Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
10 anni		7,58%	3,46%	1,38	3,01	
Da inizio	188,92%	7,58%	3,46%	1,38	3,01	12,61%

RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 22/12/2007 a 22/12/2017



Nome	Rendimento*	Rischio*
■ Cli ETF Easy NO Short	11,48 %	7,58 %
■ Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	12,40 %	12,31 %
■ iShares S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	12,18 %	14,32 %
■ Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus. Goods&Serv.	9,49 %	20,17 %

* valori annualizzati