

## Portafoglio: Easy CLI + Europa core (Big Four)

### COMPOSIZIONE

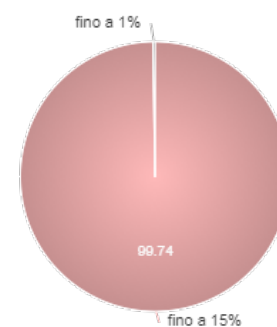
Periodo di analisi: da 22/12/2012 a 22/12/2017

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.%	Quantità	Contro valore	Peso %
Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World [FR0011079466]	Etf e Etc	214,91	232,55	8,21%	61,00	14.185,55	39,58%
Lyxor UCITS ETF S&P 500 [LU0496786574]	Etf e Etc	20,21	23,05	14,05%	473,00	10.900,29	30,42%
Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv. [FR0010344887]	Etf e Etc	50,60	61,60	21,75%	173,00	10.656,80	29,74%
Liquidità						94,40	0,26%
<b>Totale</b>						<b>35.837,03</b>	

Tutti i valori sono espressi in EUR

### Composizione di portafoglio

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	99,74%
Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,26%



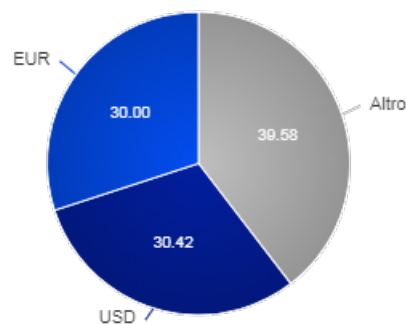
## Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
■ Globale / Aree multiple	39,58%
■ America del Nord	30,42%
■ Europa	30,00%



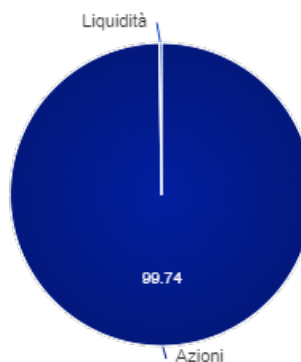
## Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
■ USD	30,42%
■ EUR	30,00%
■ Altro	39,58%



## Esposizione per Asset del portafoglio:

Esposizione per Asset	Peso %
■ Azioni	99,74%
■ Liquidità	0,26%



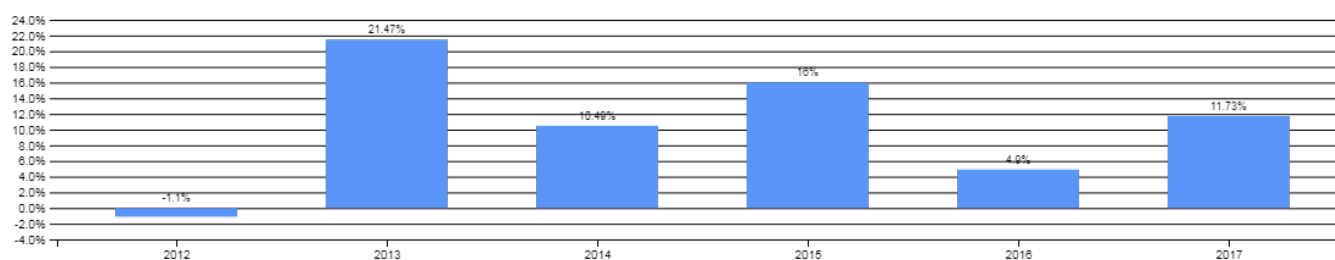
Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 22/12/2012 - 22/12/2017



- Easy CLI + Europa core (Big Four)
- MSCI World (EUR)

## ANALISI

Rendimento annualizzato: 12,53%

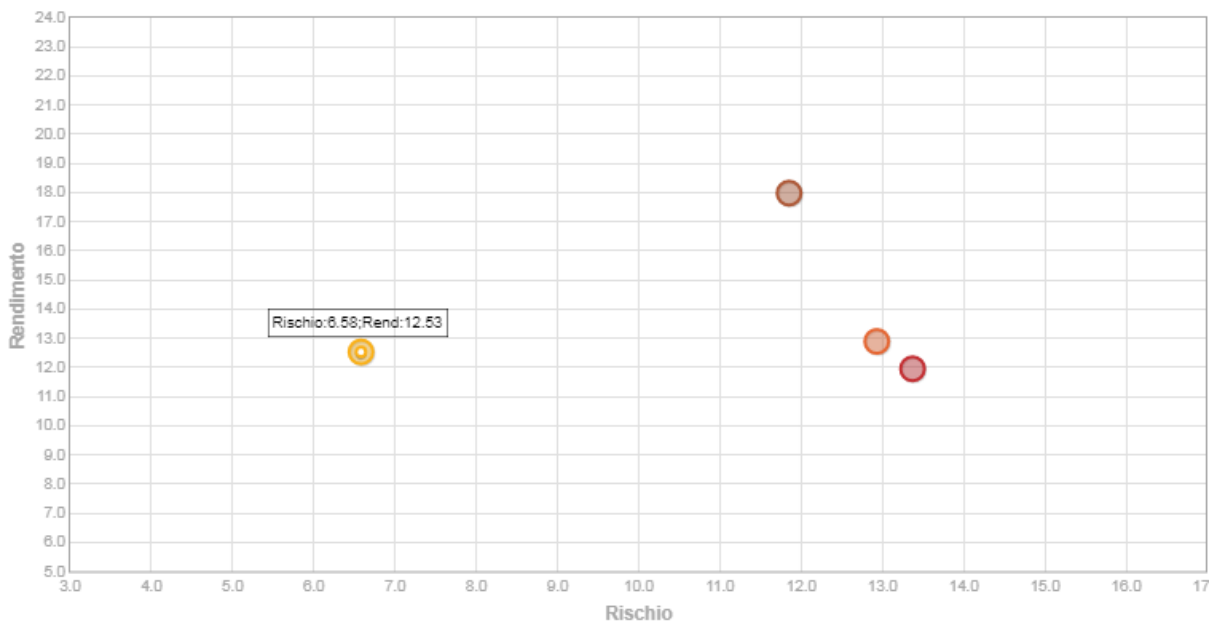


Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	11,73%	7,57%	1,97%	1,48	5,70	6,09%
1 anno	11,00%	7,57%	1,97%	1,48	5,70	6,09%
3 anni	37,13%	5,67%	1,56%	1,52	5,50	6,09%
5 anni	80,48%	6,58%	2,40%	1,87	5,14	9,73%

Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio	80,48%	6,58%	2,40%	1,87	5,14	9,73%

## RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 22/12/2012 a 22/12/2017



Nome	Rendimento*	Rischio*
Easy CLI + Europa core (Big Four)	12,53 %	6,58 %
Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	12,89 %	12,93 %
Lyxor UCITS ETF S&P 500	17,98 %	11,85 %
Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	11,95 %	13,37 %

\* valori annualizzati