

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

### COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 01/01/2011 a 05/12/2016

| Strumento  | Tipologia | Prezzo medio di carico | Prezzo attuale | Var.% | Quantità | Contro valore    | Peso % |
|--|-----------|------------------------|----------------|-------|----------|------------------|--------|
|  Lyxor UCITS ETF S&P 500                            | Etf e Etc | 19,19                  | 21,09          | 9,89% | 333,00   | 7.021,31         | 22,25% |
|  Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv. | Etf e Etc | 49,83                  | 50,00          | 0,33% | 133,00   | 6.649,34         | 21,07% |
|  Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade      | Etf e Etc | 150,68                 | 152,62         | 1,29% | 117,00   | 17.856,54        | 56,59% |
|  Liquidità  |           |                        |                |       |          | 25,86            | 0,08%  |
| <b>Totale</b>  |           |                        |                |       |          | <b>31.553,04</b> |        |

Tutti i valori sono espressi in EUR

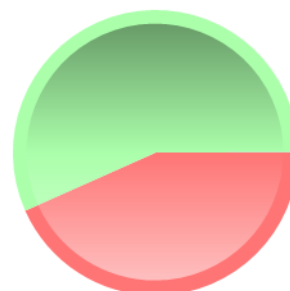
**PIANO CEDOLARE**

| <b>Strumento</b>                        | <b>Cedole passate</b> | <b>Cedole previste</b> |
|---|-----------------------|------------------------|
| iShares MSCI World UCITS ETF Dis \$     | 347,14                | 0,00                   |
| iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF Dis EUR | 252,87                | 0,00                   |
| iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$        | 249,47                | 0,00                   |
| Lyxor UCITS ETF S&P 500                 | 64,46                 | 63,27                  |
| <b>Totale</b>                           | <b>913,95</b>         | <b>63,27</b>           |

## GRAFICO PIANO CEDOLARE

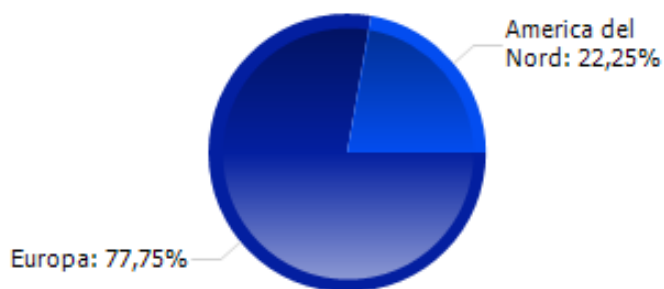
### Composizione del portafoglio:

| Caratteristiche   | Volatilità | Peso % |
|---|------------|--------|
| ■ Strumenti azionari ed assimilabili a media volatilità       | fino a 20% | 43,33% |
| ■ Strumenti obbligazionari ed assimilabili a bassa volatilità | fino a 5%  | 56,59% |
| ■ Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima      | fino a 1%  | 0,08%  |



### Esposizione geografica del portafoglio:

| Esposizione geografica | Peso % |
|------------------------|--------|
| ■ Europa               | 77,75% |
| ■ America del Nord     | 22,25% |

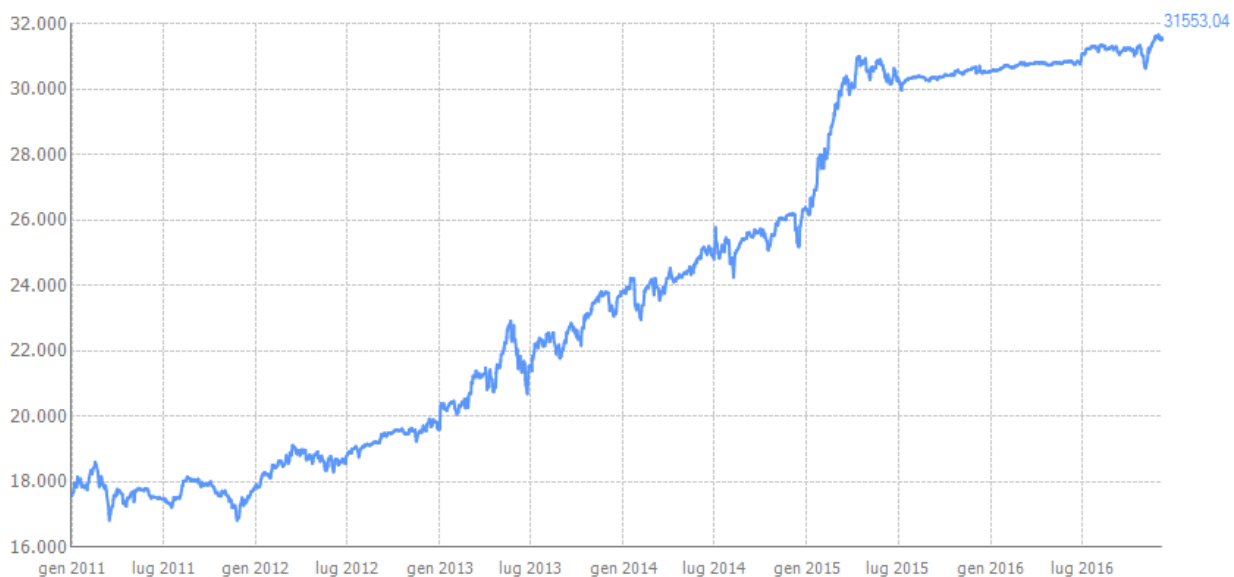


## Esposizione valutaria del portafoglio:

| Esposizione valutaria | Peso % |
|-----------------------|--------|
| EUR                   | 77,75% |
| USD                   | 22,25% |



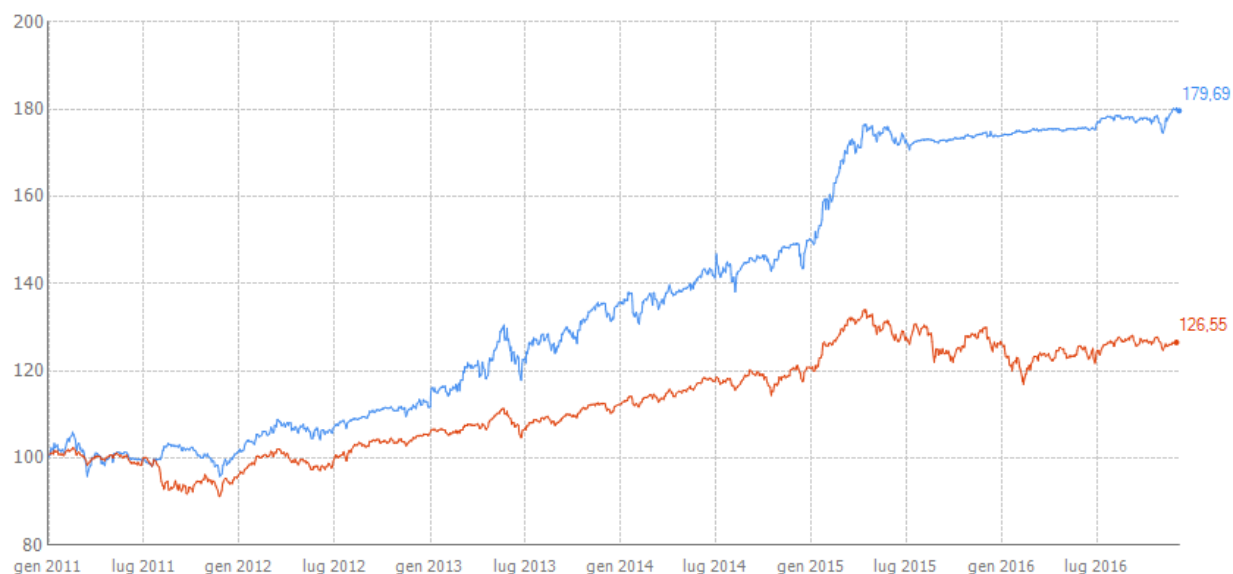
## Evoluzione del portafoglio, periodo: 01/01/2011 - 05/12/2016



Patrimonio a inizio periodo: 17.559,84 EUR

Patrimonio a fine periodo: 31.553,04 EUR

Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 01/01/2011 - 05/12/2016

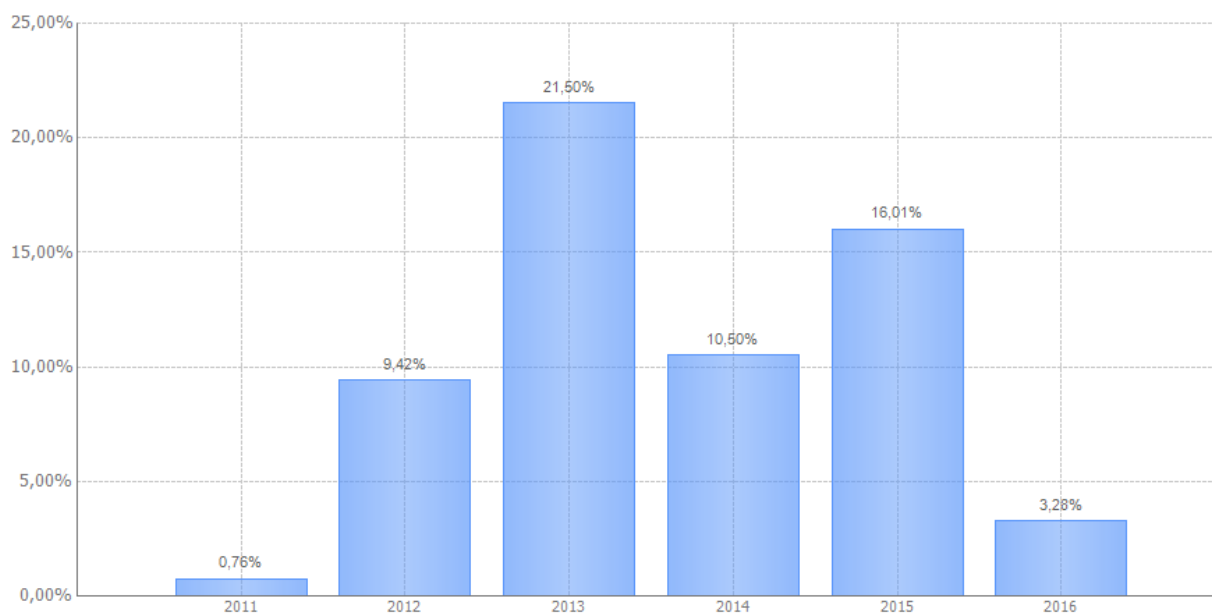


■ Easy CLI + Europa core (Big Four)

■ Ind. Fideuram Fondi Bilanciati

## ANALISI

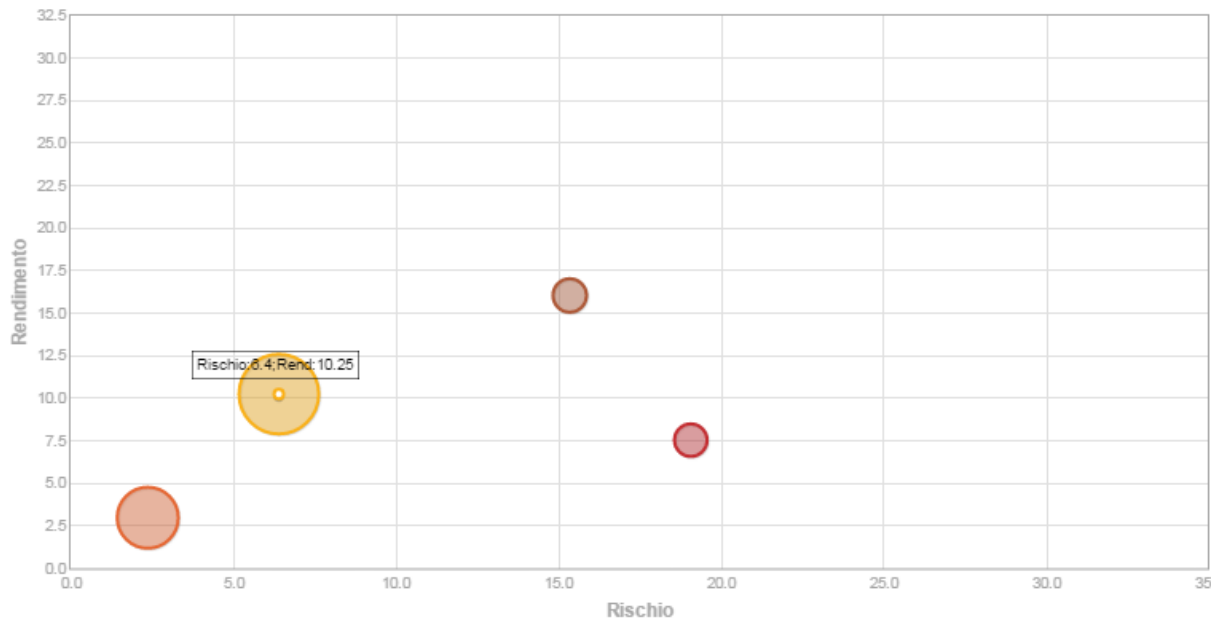
Rendimento annualizzato: 10,25%



| Periodo           | Rendimento | Volatilità | Volatilità negativa | Sharpe | Sortino | Draw Down |
|-------------------|------------|------------|---------------------|--------|---------|-----------|
| Da inizio anno    | 3,28%      | 2,49%      | 0,84%               | 1,20   | 3,55    | 2,28%     |
| 1 anno            | 3,25%      | 2,49%      | 0,84%               | 1,20   | 3,55    | 2,28%     |
| 3 anni            | 35,78%     | 5,43%      | 1,47%               | 1,73   | 6,39    | 5,93%     |
| 5 anni            | 80,12%     | 6,11%      | 2,28%               | 1,99   | 5,35    | 9,74%     |
| Da inizio periodo | 78,38%     | 6,40%      | 3,01%               | 1,52   | 3,24    | 9,74%     |

## RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 01/01/2011 a 05/12/2016



| Nome  | Rendimento* | Rischio* |
|---|-------------|----------|
| <span style="color: yellow;">■</span> Easy CLI + Europa core (Big Four)               | 10,25 %     | 6,40 %   |
| <span style="color: orange;">■</span> Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade   | 2,98 %      | 2,37 %   |
| <span style="color: brown;">■</span> Lyxor UCITS ETF S&P 500                          | 16,05 %     | 15,34 %  |
| <span style="color: red;">■</span> Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv. | 7,54 %      | 19,06 %  |

\* valori annualizzati