

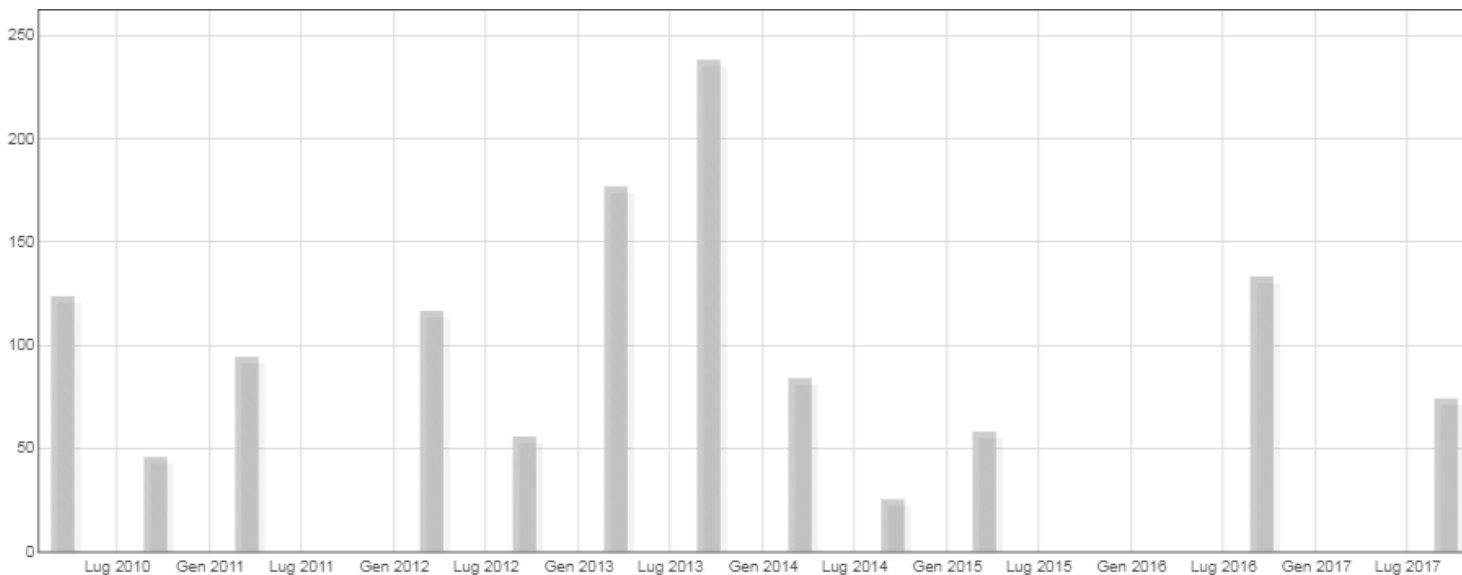
Portafoglio: Easy CLI + Europa core (Big Four)

COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 01/01/2010 a 11/10/2017

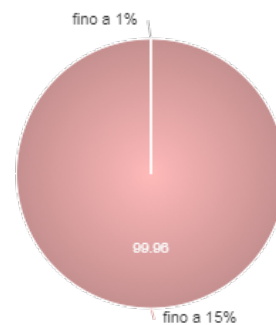
Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var.%	Quantità	Contro valore	Peso %
Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	Etf e Etc	214,91	224,54	4,48%	61,00	13.696,94	39,48%
Lyxor UCITS ETF S&P 500	Etf e Etc	20,21	22,03	9,00%	473,00	10.417,83	30,03%
Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	Etf e Etc	50,60	61,07	20,70%	173,00	10.565,11	30,45%
Liquidità						12,30	0,04%
Totale						34.692,17	

Tutti i valori sono espressi in EUR



Composizione di portafoglio

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
■ Strumenti azionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 15%	99,96%
■ Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,04%



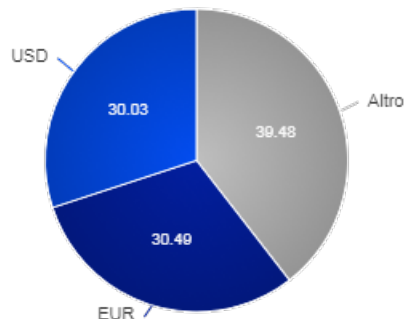
Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
■ Globale / Aree multiple	39,48%
■ Europa	30,49%
■ America del Nord	30,03%



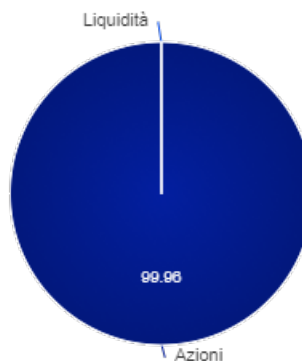
Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
EUR	30,49%
USD	30,03%
Altro	39,48%

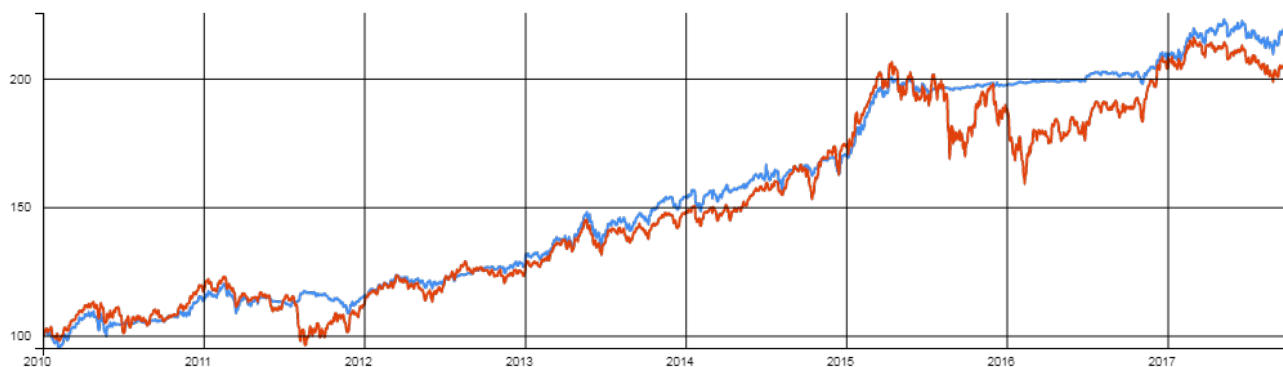


Esposizione per Asset del portafoglio:

Esposizione per Asset	Peso %
Azioni	99,96%
Liquidità	0,04%



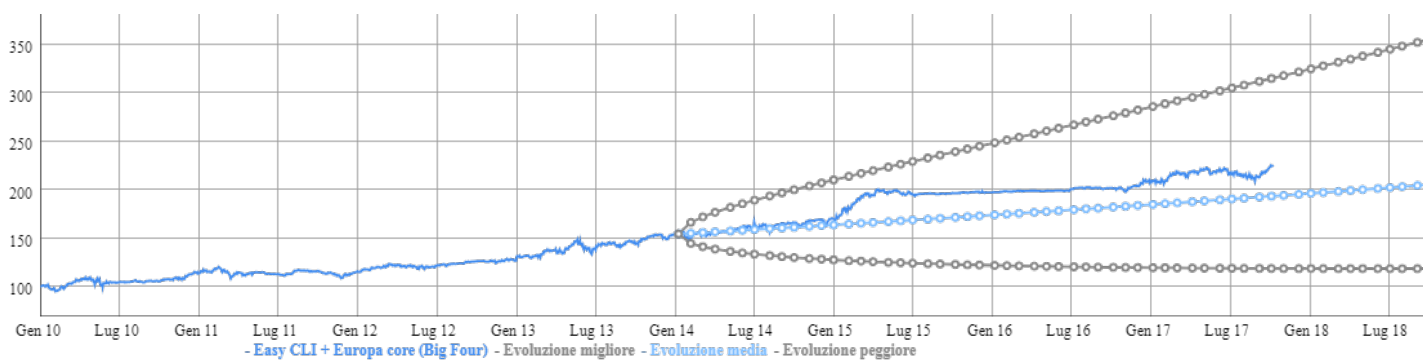
Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 01/01/2010 - 10/10/2017



Easy CLI + Europa core (Big Four)

MSCI World (EUR)

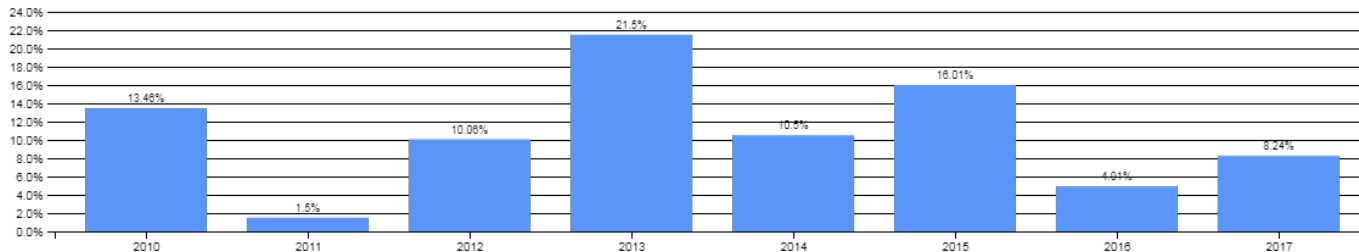
Cono di volatilità calcolato sul periodo:



percentile: 95 %

ANALISI

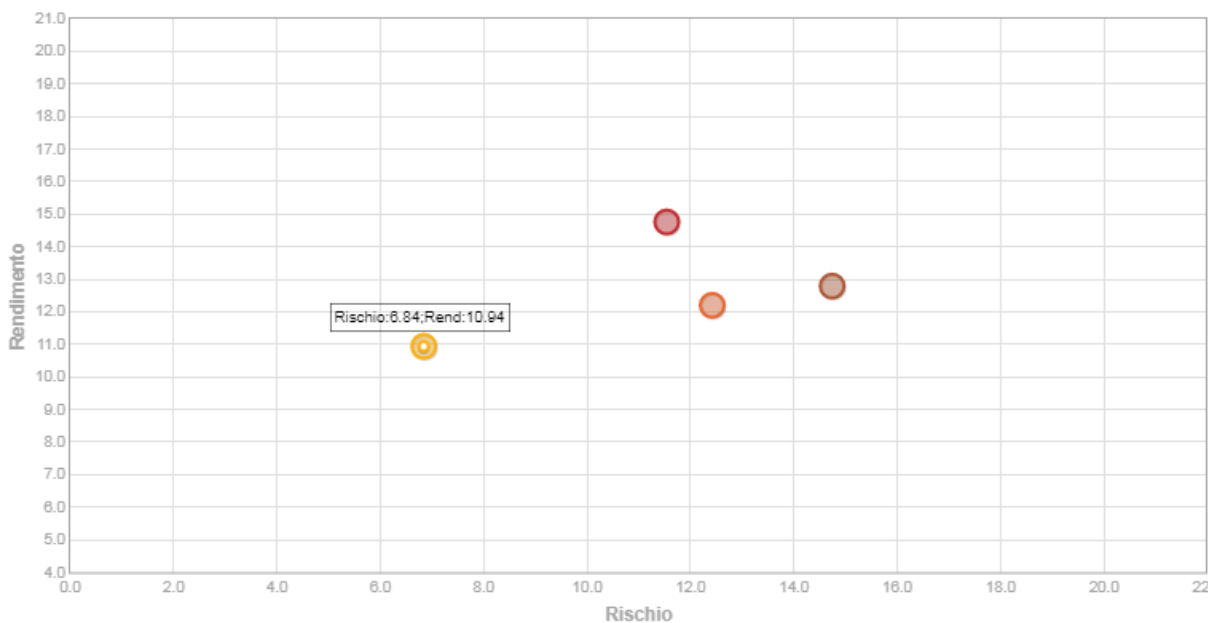
Rendimento annualizzato: 10,94%







Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	8,24%	7,28%	1,90%	1,34	5,14	6,09%
1 anno	11,08%	6,66%	1,72%	1,75	6,78	6,09%
3 anni	36,12%	6,25%	1,46%	1,60	6,82	6,09%
5 anni	77,27%	6,41%	2,36%	1,85	5,02	9,74%
Da inizio	124,17%	6,84%	2,97%	1,57	3,62	9,74%

RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 01/01/2010 a 11/10/2017



Nome	Rendimento*	Rischio*
 Easy CLI + Europa core (Big Four)	10,94 %	6,84 %
 Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	12,20 %	12,42 %
 Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	12,79 %	14,74 %
 Lyxor UCITS ETF S&P 500	14,76 %	11,54 %

* valori annualizzati