

Portafoglio: Example

Data della revisione

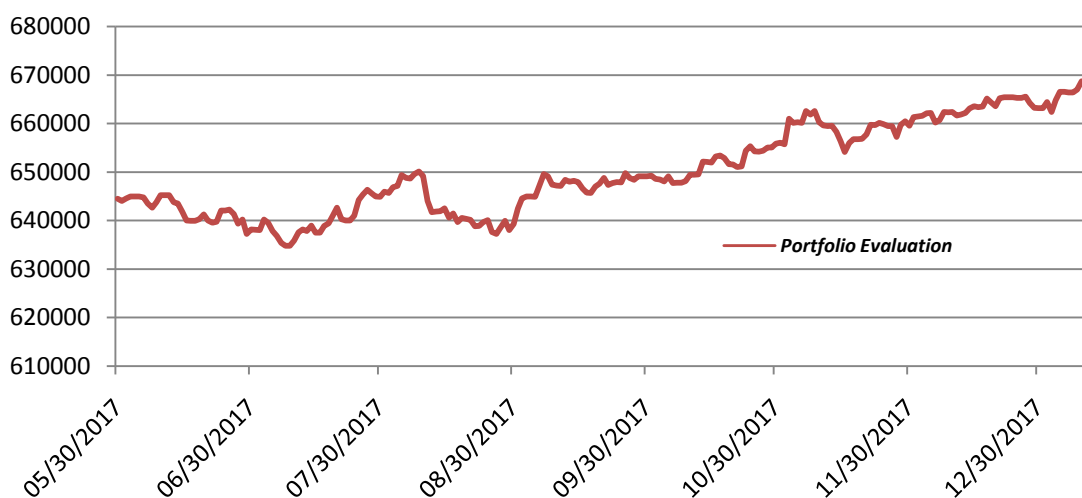
01/12/2018

PORTFOLIO

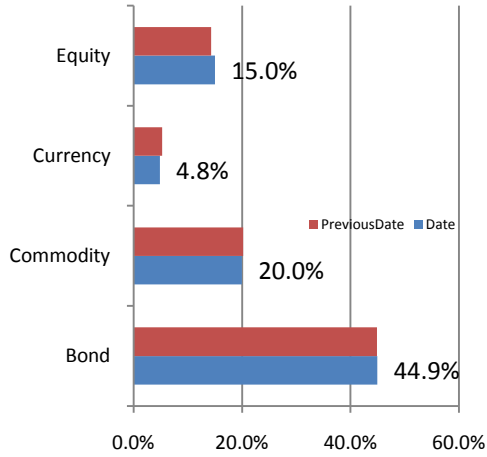
Financial Engineering

Name	Ticker	Weight	Price	Value	Date
ETF Lyxor ETF EuroMTS 1-3Y	EM13.IM	422.10676	125.62	53025	01/12/2018
ETF Lyxor ETF EuroMTS 7-10Y	EM710.IM	590.40683	171.86	101467	01/12/2018
ETF Lyxor ETF FTSE MIB	ETFMIB.IM	2396.0915	22.86	54763	01/12/2018
ETF iShares DJ Euro STOXX 50	EUE.IM	491.57582	36.65	18014	01/12/2018
ETF iShares Eur Corporate Bond	IBCX.IM	347.68551	135.48	47104	01/12/2018
ETF iShares Markit iBoxx Euro High Yield MTF	IHYG.IM	305.08339	107.58	32821	01/12/2018
ETF iShares S&P 500 Index Fund MTF	IUSA.IM	910.89787	22.78	20750	01/12/2018
ETF Lyxor ETF Japan Topix	JPN.IM	46.86631	134.84	6319	01/12/2018
Schroder ISF Global Convertible Bond A EUR Hedged Acc	LU0352097439	938.79565	142.18	133477	01/12/2018
Lux Copper Strategy	LuxCopper	3.0954492	10757.10	33298	01/12/2018
Lux Cotton Strategy	LuxCotton	2.9215111	11574.06	33814	01/12/2018
Lux Crude Oil Strategy	LuxCrudeoil	3.1008547	10757.90	33359	01/12/2018
Lux Currency Strategy	LuxCurrency	15.314313	2100.68	32170	01/12/2018

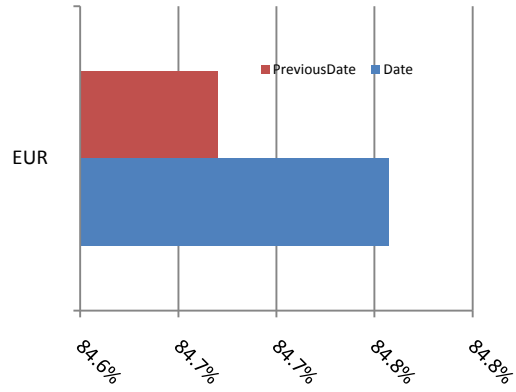
Date	Portfolio Evaluation
01/12/2018	665666.3416



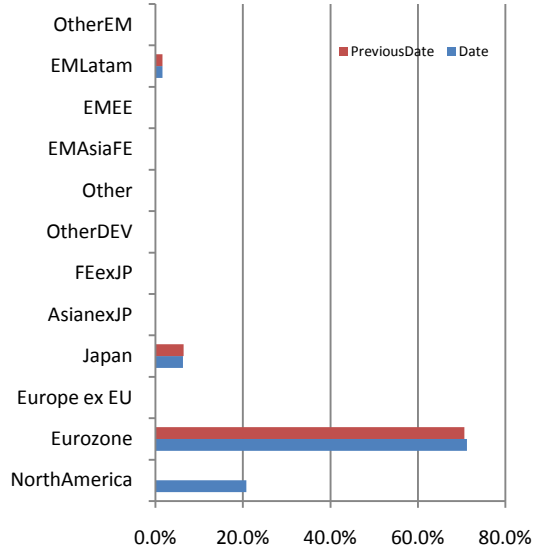
Esposizione per Asset Class



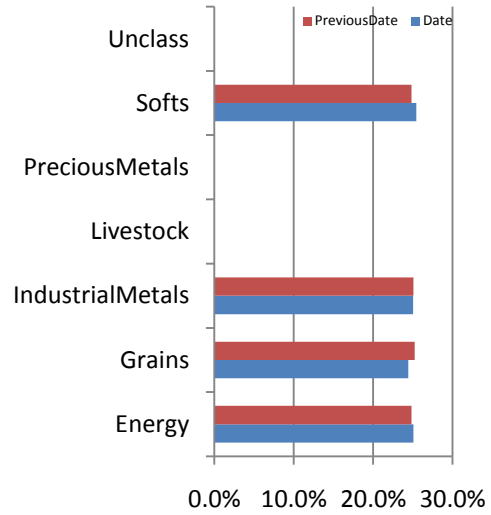
Stima dell'esposizione valutaria



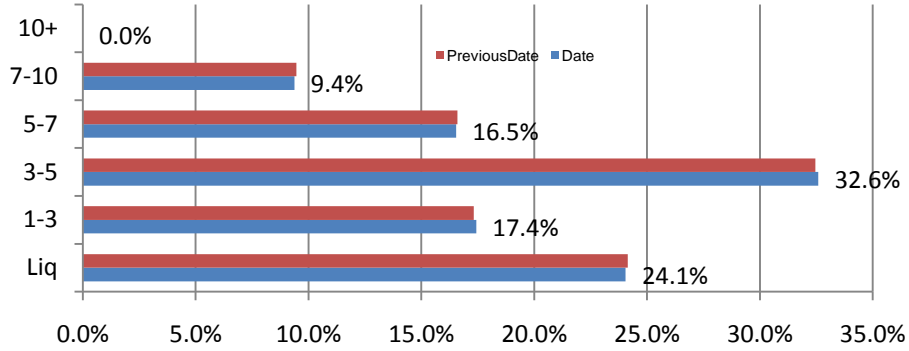
Esposizione Equity per aree geografiche



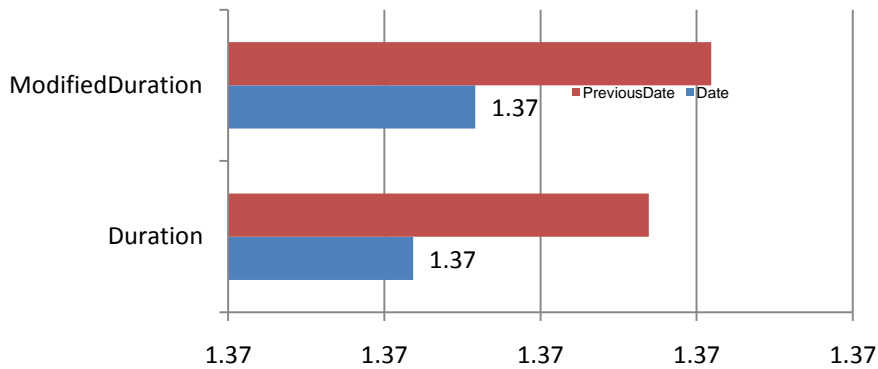
Esposizione Commodity per Settore



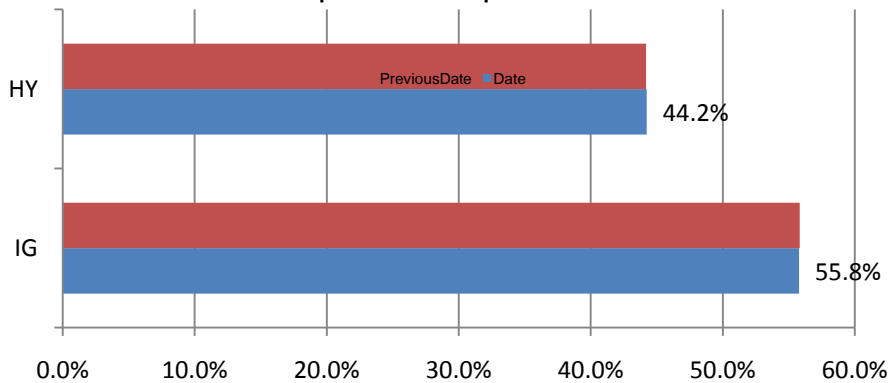
Esposizione Bond per Scadenza



Rischio Portafoglio Bond



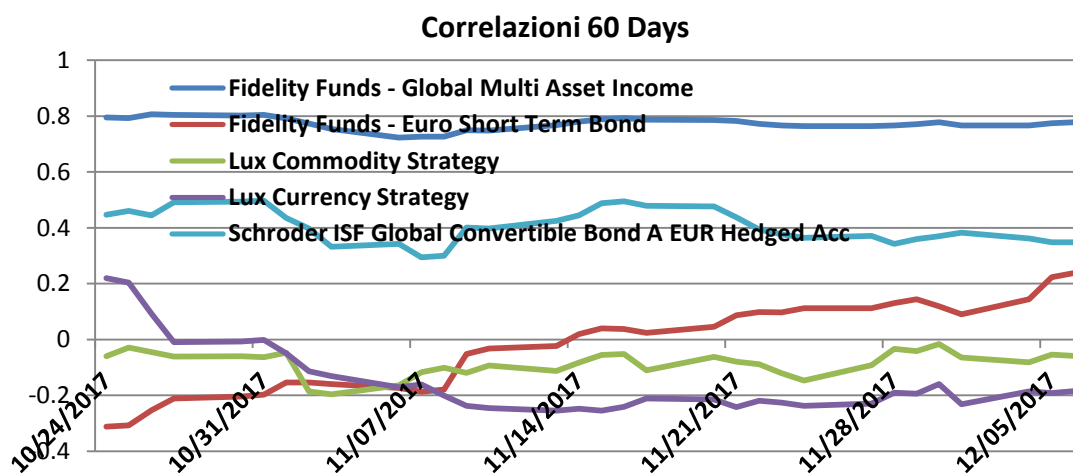
Esposizione Bond per Sectors



Standard Deviation

Portafolio	3.01%
ETF iShares S&P 500 Index Fund MTF	8.94%
ETF iShares FTSE BRIC 50	12.36%
ETF LYXOR ETF Commodities CRB	10.40%
ETF iShares Markit iBoxx Euro High Yield MTF	3.03%
ETF db x-trackers II - Emerging Markets Liquid Eurobond Index	3.06%

Correlazioni Tra Asset Class nell'ultimo periodo a 60 giorni tra mercato azionario europeo e altre asset class



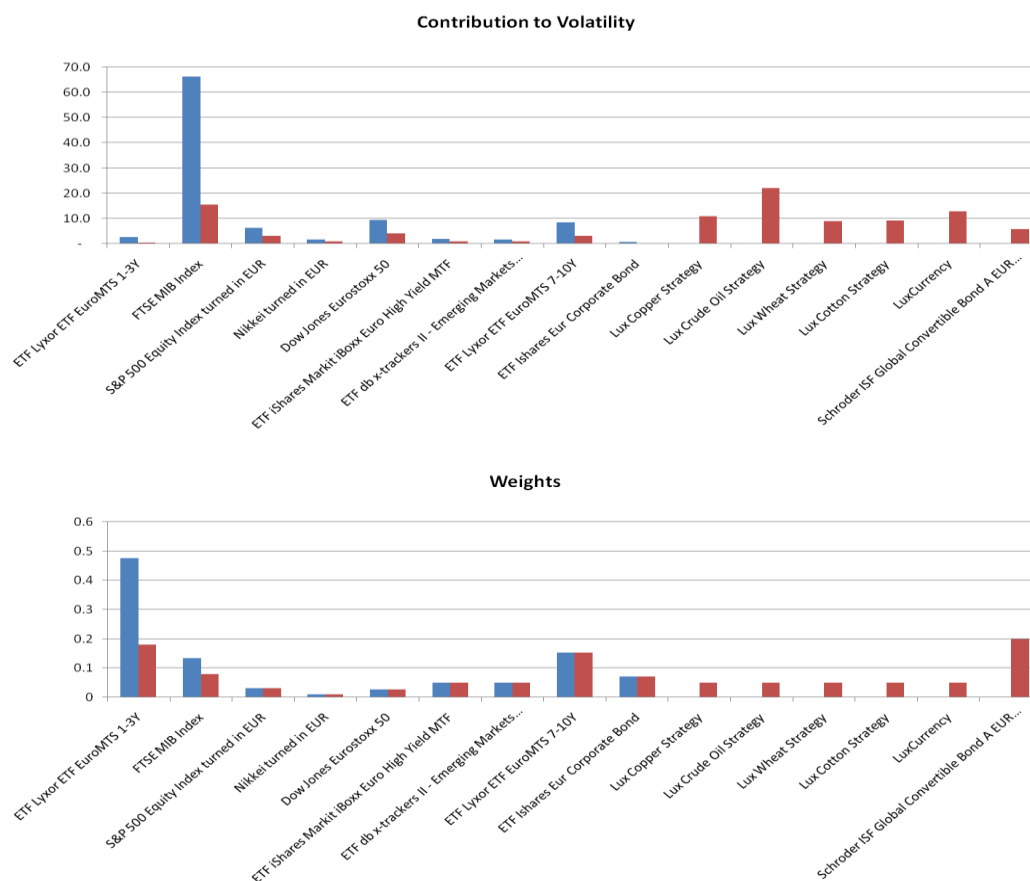
Commenti

Il grafico mostra la contribuzione al rischio di ogni singola asset class

In blu il portafoglio attuale con i relativi pesi percentuali

In rosso la proposta di nuovo portafoglio con nuovi pesi

si noti come l'allocazione considera più fonti di rischio e rendimento



Disclaimer

Analisi e Ricerche

Il documento deve essere inteso come fonte di informazione e non può, in nessun caso, essere considerato un'offerta o una sollecitazione all'acquisto o alla vendita di prodotti finanziari.

Le informazioni contenute in questo documento sono frutto di notizie e opinioni che possono essere modificate in qualsiasi momento senza preavviso.

Portafogli

Qualsiasi decisione di investimento che venga presa in relazione all'utilizzo di informazioni ed analisi contenute nel presente documento è di esclusiva responsabilità dell'investitore, che deve considerare i contenuti espressi come strumenti di informazione, analisi e supporto alle decisioni.

I portafogli presentati, fatto salvo una esplicita dichiarazione, non forniscono alcuna garanzia formale di rendimento o di tutela del capitale.