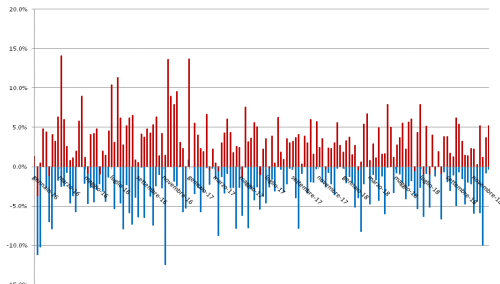


Lux Commodity Volatility

Portafoglio diversificato e costituito da una selezione di 4 Commodity con pari esposizione, scelte tra le seguenti: Copper, Coffee, Cotton, Crude Oil, Gold, Grains, Palladium, Platinum, Wheat, Silver.

Strategy

Gestione della volatilità acquistando posizioni sempre al ribasso e rivendendo al rialzo su livelli fissi. La strategia mira a guadagnare dalla volatilità dei mercati sottostanti accumulando con minimi trade giornalieri la volatilità dei mercati. Il paniere scelto ha caratteristiche di diversificazione implicita al suo interno coprendo quattro settori di materie prime differenti.



Il grafico mostra settimanalmente l'andamento della migliore e peggiore commodity del paniere. Si può notare come sia altamente discordante. Questo presuppone che il paniere riesca a rimanere stabile pur avendo al suo interno notevole volatilità, da cui il modello stesso acquisisce rendimento.

Possiamo assimilare il modello ad una obbligazione con le seguenti caratteristiche

Prezzo di sottoscrizione: 100

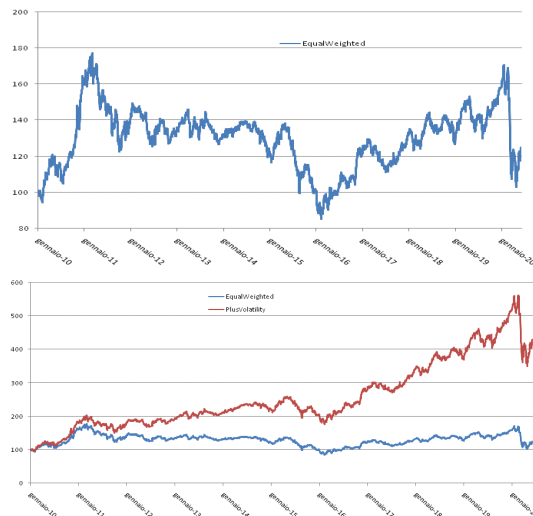
Cedola mensile: 1% circa, quantificabile in base alla volatilità delle commodity

Capitale: variabile a seconda delle variazioni del paniere sottostante

Assenza di rischio fallimento in quanto il paniere è costituito esclusivamente da materie prime.

Investimento totalmente liquido e disinvestibile in ogni momento e in Euro.

Durata dell'investimento consigliata : 4 anni.



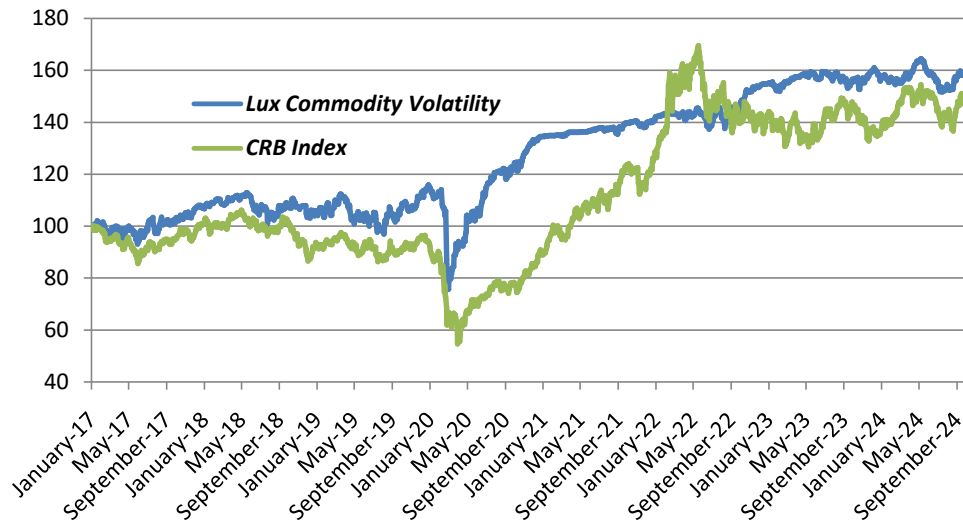
Il primo grafico mostra l'andamento del paniere scelto nel corso degli ultimi 7 anni. Il secondo mostra l'andamento storico del paniere negli ultimi 10 anni, riga blu.

La riga rossa mostra il nav complessivo della strategia, ossia riga blu sommata alla cedola mensile del 1 per cento creata dalla volatilità.

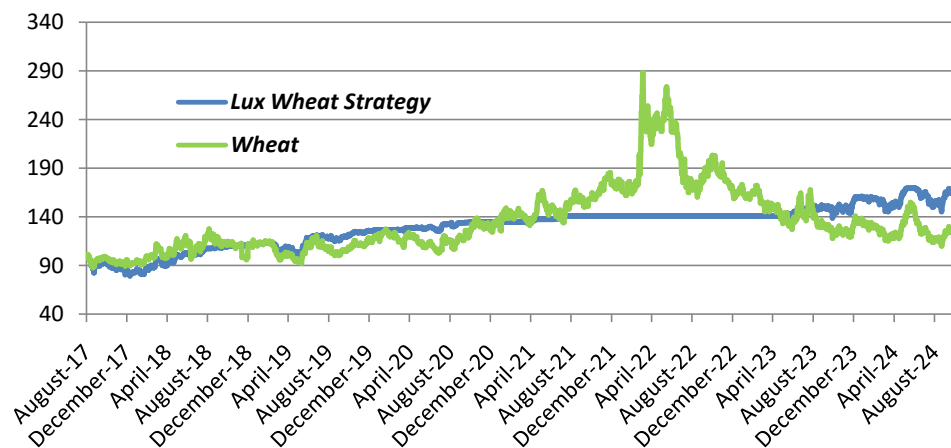
Si nota come in assenza della cedola di volatilità l'investimento in un paniere di questo genere porterebbe ad un rendimento praticamente nullo. Il fatto che, invece, la volatilità sia acquisita tramite acquisti e vendite continui porta a creare un rendimento notevole nel corso del tempo.

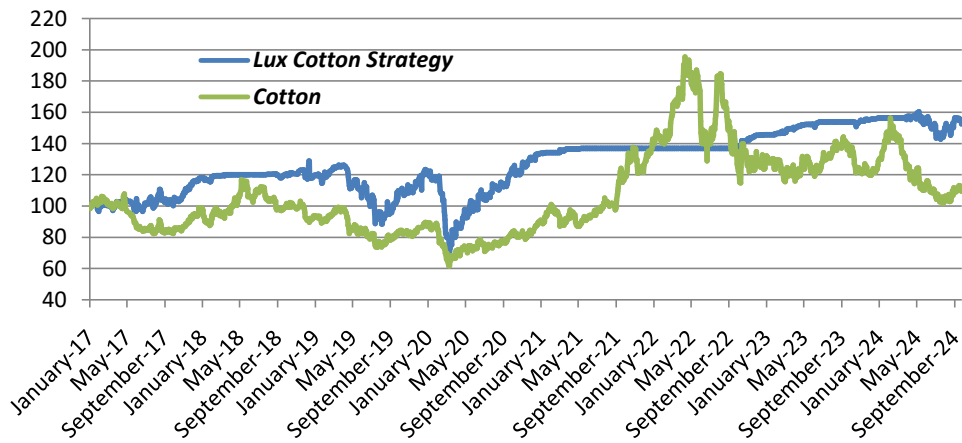
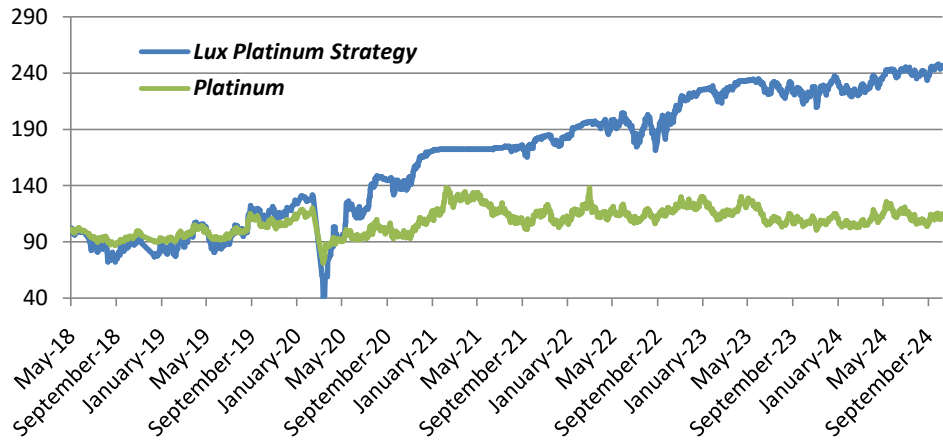
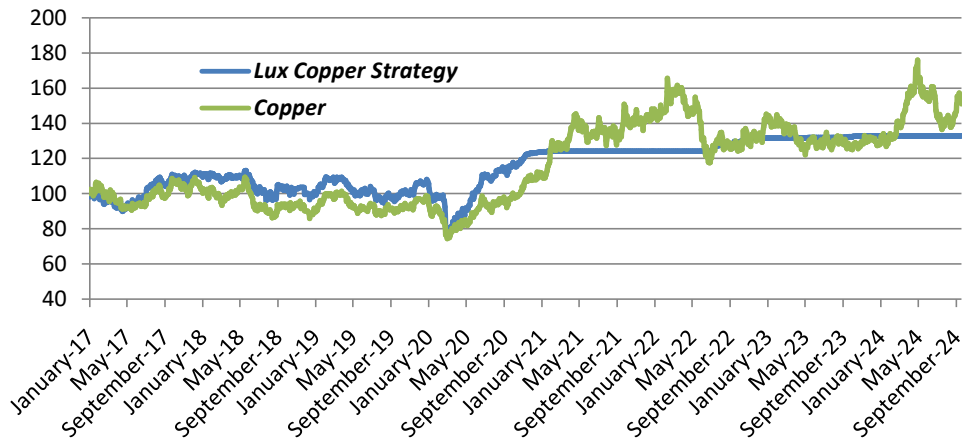
....e il track record paragonato ai principali indici di asset rischiosi.

Si noti la minimizzazione del rischio tra la strategia e il suo stesso paniere...



....e il track record delle diverse componenti analizzate singolarmente.





Portafoglio: LuxVolatilityCommodity

Data della revisione
10/16/2024

Equity Asset Class

Financial Engineering

Disponibile tramite

Segregated Account presso il broker Avatrade:

Costo Fisso: 0%, anche in termini di spread sugli strumenti tradati in quanto viene recuperato lo spread in ogni transazione.

Costo Variabile: 30% High Water Mark mensile, ossia il 30% del rendimento solo se il valore complessivo del portafoglio supera i massimi.

Da Settembre 2024..

Certificato quotato a Francoforte:

Costo fisso: 1% annuo

Costo variabile: 20% HWM

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.

LuxQuantum
Financial Engineering & Investment Strategies
Info@luxquantum.com