

Caratteristiche della linea

Tema dell'investimento	
Inizio gestione	21-02-2012
Limite di VaR	-14%
Livello di rischio massimo	Medio alto
Soglia minima di ingresso	€ 25000

Risultati della gestione

Evoluzione della linea



Dettaglio del portafoglio

Scomposizione per strumento

Strumento	Valuta	Peso
ANIMA STR HIGH POT EUR-I	EUR	3.96%
BLACKROCK STR LG/ST EQ-D2EUR	EUR	7.08%
ELEV-ABS LRET EUR FD-IEURA	EUR	4.99%
EXANE OVERDRIVE FUND-A EUR	EUR	5.82%
FID-ABSLT RTRN GLB EQT-Y PFE	EUR	6.96%
FONDITALIA FLEXIBLE ITALY CLASSE T	EUR	8.97%
JPM EUREQ ABSAL-C PERF AEUR	EUR	9.12%
JPM US SEL EQ PL-I2	EUR	2.91%
JUPMER GBL EQ ABRET-I EUR AC	EUR	10.07%
LUMY-B MLCX C ALPHA U-B5EURA	EUR	3.97%
MAN ALPHA SELECT ALTER-ILEUR	EUR	7.92%
MAN EVENT DRVN ALTNT-INH EUR	EUR	7.99%
NB BERMAN EVT DRIVN F-I5	EUR	6.99%
Q UCITSF-QUANTICA MAN FT-I2E	EUR	3.54%
U ACCESS-CAM AB RET-B EUR	EUR	2.54%
WIN AL DIVER MAC FD-I1C E EU	EUR	5.12%
WT PHYSICAL GOLD-EUR DLY HDG	EUR	2.05%

Tipologia dell'investimento

Il portafoglio della Linea di gestione è costruito con strumenti finanziari che rappresentano asset class o strategie d'investimento con andamento tendenzialmente non legato ai mercati azionari e con lo scopo di ottenere un rendimento assoluto positivo. La misura scelta per rappresentare il rischio del portafoglio è il "Value at Risk" (VaR). Il limite di VaR non costituisce in alcun modo garanzia di risultato della gestione, bensì un criterio di controllo del rischio del portafoglio. La probabilità di non subire perdite superiori al livello di perdita espresso dal VaR della gestione è pari al 95%, con un orizzonte temporale di un anno. La performance della gestione in un qualsiasi periodo annuale potrebbe tuttavia essere inferiore al VaR dichiarato a causa di eventi statisticamente non prevedibili. Gli investimenti in Paesi Emergenti non possono superare il 40%.

Dati Rischio

VaR Annuo	-6.00%
Volatilità realizzata Annualizzata	2.26%

Performance cumulate

1 MESE	0.64%
3 MESI	2.48%
6 MESI	4.59%
YTD	1.16%
1 ANNO	5.55%
3 ANNI	14.27%
5 ANNI	20.71%