

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



Dettaglio del portafoglio

| Scomposizione per strumento | | |
|------------------------------------|--------|--------|
| Strumento | Valuta | Peso |
| ANIMA STR HIGH POT EUR-I | EUR | 3.02% |
| BLRC SYS US EQ ABS RTR-D2E H | EUR | 5.10% |
| BSF-AS PAC DIV EQ A/R-D2EURH | EUR | 5.01% |
| CANDR MONEY MARKET-V-C | EUR | 4.01% |
| ELEV-ABS LRET EUR FD-IEURA | EUR | 4.05% |
| EXANE OVERDRIVE FUND-A EUR | EUR | 11.92% |
| FID-ABSLT RTRN GLB EQT-Y PFE | EUR | 5.06% |
| FONDITALIA FLEXIBLE ITALY CLASSE T | EUR | 13.02% |
| JPM EUREQ ABSAL-C PERF AEUR | EUR | 9.08% |
| LUMY-B MLCX C ALPHA U-B5EURA | EUR | 3.83% |
| MAN ALPHA SELECT ALTER-ILEUR | EUR | 8.11% |
| MAN EVENT DRVN ALTNT-INH EUR | EUR | 10.05% |
| NB BERMAN EVT DRIVN F-I5 | EUR | 7.00% |
| Q UCITSF-QUANTICA MAN FT-I2E | EUR | 1.99% |
| U ACCESS-CAM AB RET-B EUR | EUR | 2.97% |
| WIN AL DIVER MAC FD-I1C E EU | EUR | 3.92% |
| WT PHYSICAL GOLD-EUR DLY HDG | EUR | 1.86% |

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 | -5.07% |
| Volatilità realizzata Annualizzata | 2.18% |

