

PT 1AR - Abs Return

Model Portfolio EUR

Periodo 31/01/2017 - 31/01/2020
Benchmark Italy Fideuram Flexible Group

Profilo Rischio (1-7) 3
Orizz. Investimento 3-5

Descrizione

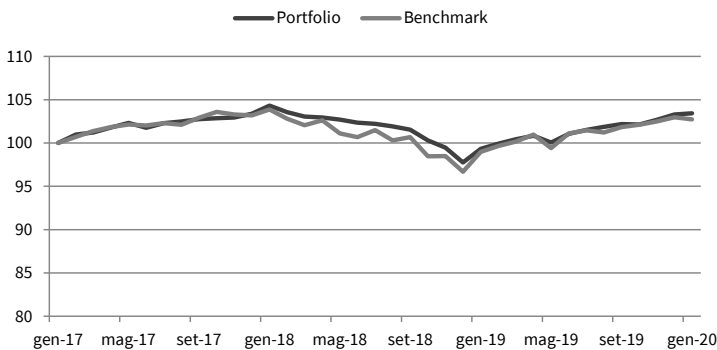
La gestione ha l'obiettivo di incrementare il capitale generando rendimenti assoluti. La gestione attiva prevede un'esposizione rilevante in strumenti finanziari decorrelati dall'andamento dei mercati, che utilizzano strategie tipiche dei fondi hedge, absolute e total return. Oscillazioni medio-basse dei corsi. Strumenti utilizzati: prevalentemente prodotti, bilanciati, alternativi e delle materie prime o con profilo di rischio assimilabile.

Rendimenti %

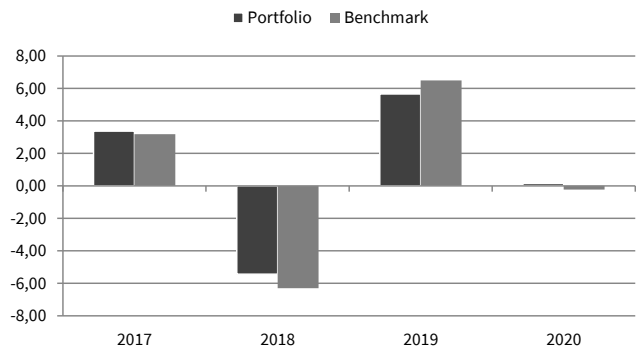
	1m	3m	6m	9m	YTD	1a	3a	5a	10a	Periodo
Portfolio	0,15	1,29	1,90	2,57	0,15	4,13	3,44	--	--	3,44
Benchmark	-0,22	0,62	1,26	1,76	-0,22	3,81	2,74	--	--	2,74

Yield 12m % 0,39

Rendimenti Cumulati (m)



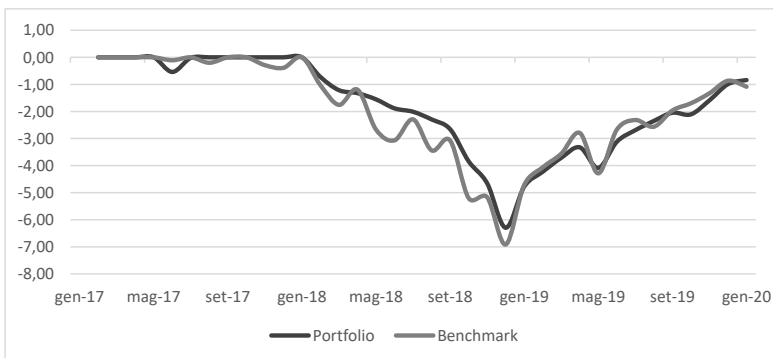
Rendimenti Annuali %



Rendimenti Mensili %

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Sep	Ott	Nov	Dic	Anno
2017		0,96	0,24	0,58	0,51	-0,54	0,52	0,19	0,28	0,09	0,08	0,42	3,37
2018	0,91	-0,73	-0,49	-0,11	-0,23	-0,34	-0,13	-0,29	-0,37	-1,22	-0,85	-1,72	-5,44
2019	1,62	0,58	0,54	0,40	-0,79	1,01	0,44	0,35	0,31	-0,06	0,53	0,61	5,66
2020	0,15												0,15

Drawdown Storico (m) %



Statistiche (m) %

	Portfolio	Benchmark
Rend. Ann.%	1,13	0,91
Rischio Ann.%	2,30	3,24
Return/Risk Ratio	0,49	0,28
% Mesi Positivi	61,11	61,11
Max Drawdown %	6,30	6,92
Periodo Recupero	0,00	0,00
VaR95 Ann. %	3,25	5,58
cVaR95 Ann. %	5,09	6,99
Sharpe	0,13	0,09
Sortino	0,21	0,12
Info Ratio	0,12	--
Alfa	0,05	--
Beta	0,58	--
Correl	0,82	--

Tutti i valori di performance e rendimento presenti nel report sono calcolati al lordo di commissioni, costi di trading, management fees, performance fees, spese e tasse, ove applicabili.

Le informazioni sono fornite al solo scopo informativo e non devono essere utilizzate o considerate come un'offerta o una sollecitazione al pubblico risparmio o alla sottoscrizione di titoli o altri strumenti finanziari. Né Pairstech Capital Management LLP ("Pairstech") né alcuna delle sue affiliate fornisce alcuna garanzia sulla completezza, accuratezza, o idoneità di qualsiasi informazione contenuta in qualsiasi parte del documento e che non sia esente da errori. Pairstech non si assume alcuna responsabilità per eventuali perdite o danni che possono sorgere direttamente o indirettamente dall'utilizzo di tali informazioni. Mentre le informazioni fornite sono state ottenute da fonti ritenute attendibili, né Pairstech né alcuna delle sue affiliate testimonia la sua precisione o completezza. Pairstech si riserva il diritto di modificare qualsiasi dato senza limitazioni o preavviso. I valori citati per ogni particolare investimento sono indicativi e sono soggetti a variazioni. I rendimenti passati non dovrebbero essere considerati come un'indicazione o una garanzia di rendimenti futuri e non viene fornita nessuna garanzia, esplicita o implicita, per i rendimenti futuri.

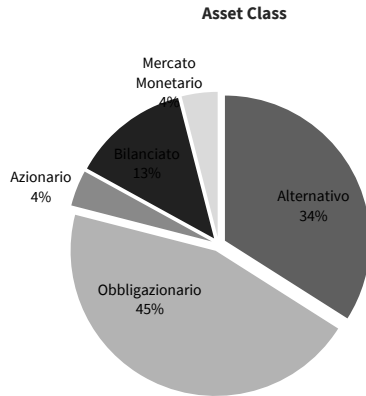
PT 1AR - Abs Return

Model Portfolio EUR

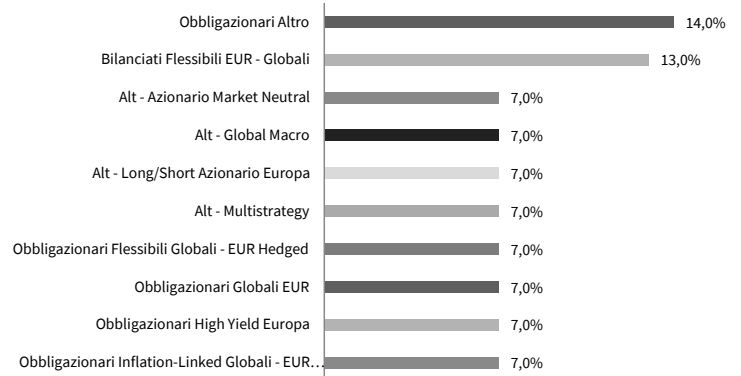
Periodo 31/01/2017 - 31/01/2020
Benchmark Italy Fideuram Flexible Group

Profilo Rischio (1-7) 3
Orizz. Investimento 3-5

Composizione Portafoglio



Top 10 Categorie



Sottostante

Sottostante	Peso %	Divisa	Asset Class	Categoria
Schroder International Selection Fund - US Dollar Bond EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Altro
Dual Return Fund - Vision Microfinance P Accu EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Globali EUR
Nordea 1 SICAV - European High Yield Bond Fund EUR EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario High Yield Europa
Finlabo Investments Sicav - Dynamic Equity P EUR	7,00	EUR	Alternativo	Alt - Long/Short Azionario Europa
Lemanik SICAV - Global Strategy Fund R EUR	7,00	EUR	Alternativo	Alt - Global Macro
LEMANIK SICAV - Flex Quantitative HR6 A EUR	7,00	EUR	Bilanciato	Bilanciati Flessibili EUR - Globali
GAM Star Fund PLC - Cat Bond Fund A EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Altro
DNCA Invest - Miuri B EUR	7,00	EUR	Alternativo	Alt - Azionario Market Neutral
Schroder International Selection Fund - Strategic Credit AA EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Flessibili Globali - EUR Hedged
Pictet TR - Diversified Alpha P EUR	7,00	EUR	Alternativo	Alt - Multistrategy
GAM Multibond - Global Inflation Linked Bond EUR	7,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Inflation-Linked Globali - EUR Hedged
BANOR Sicav - Rosemary R EUR	6,00	EUR	Bilanciato	Bilanciati Flessibili EUR - Globali
Schroder International Selection Fund - EURO Liquidity A AC EUR	4,00	EUR	Mercato Monetario	Monetari - Altro
Financiere de l'Echiquier - Entrepreneurs C EUR	4,00	EUR	Azionario	Azionari Europa Small Cap
Rubrics Global Fixed Income UC B EUR	3,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionario Globali EUR-Hedged
Schroder GAIA Egerton Equity AA EUR	3,00	EUR	Alternativo	Alt - Long/Short Azionario Internazionale
Schroder GAIA Sirios US Equity AA Accu EUR	3,00	EUR	Alternativo	Alt - Long/Short Azionario US

Tutti i valori di performance e rendimento presenti nel report sono calcolati al lordo di commissioni, costi di trading, management fees, performance fees, spese e tasse, ove applicabili.

Le informazioni sono fornite al solo scopo informativo e non devono essere utilizzate o considerate come un'offerta o una sollecitazione al pubblico risparmio o alla sottoscrizione di titoli o altri strumenti finanziari. Né Pairstech Capital Management LLP ("Pairstech") né alcuna delle sue affiliate fornisce alcuna garanzia sulla completezza, accuratezza, o idoneità di qualsiasi informazione contenuta in qualsiasi parte del documento e che non sia esente da errori. Pairstech non si assume alcuna responsabilità per eventuali perdite o danni che possono sorgere direttamente o indirettamente dall'utilizzo di tali informazioni. Mentre le informazioni fornite sono state ottenute da fonti ritenute attendibili, né Pairstech né alcuna delle sue affiliate testimonia la sua precisione o completezza. Pairstech si riserva il diritto di modificare qualsiasi dato senza limitazioni o preavviso. I valori citati per ogni particolare investimento sono indicativi e sono soggetti a variazioni. I rendimenti passati non dovrebbero essere considerati come un'indicazione o una garanzia di rendimenti futuri e non viene fornita nessuna garanzia, esplicita o implicita, per i rendimenti futuri.