

# PT 1FQ - Fondi Quotati

## Model Portfolio EUR

**Periodo** 31/01/2017 - 31/01/2020  
**Benchmark** Italy Fideuram Balanced Group

**Profilo Rischio (1-7)** 4  
**Orizz. Investimento** 5-7

### Descrizione

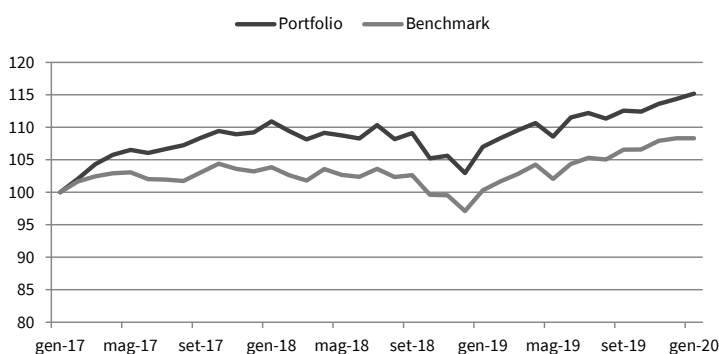
Obiettivo dell'investimento è generare risultati stabili nel lungo periodo, mantenendo una bassa correlazione e un maggiore rapporto rischio-rendimento rispetto a investimenti alternativi e benchmark. La strategia è dinamica e può cambiare nel tempo adeguandosi alla tendenza e volatilità dei mercati finanziari e al profilo di rischio-rendimento del portafoglio

### Rendimenti %

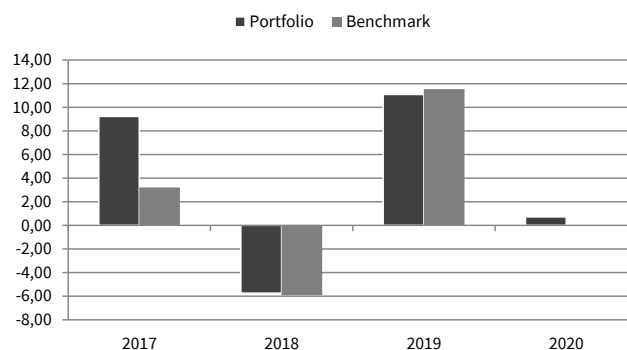
|                  | 1m   | 3m   | 6m   | 9m   | YTD  | 1a   | 3a    | 5a | 10a | Periodo |
|------------------|------|------|------|------|------|------|-------|----|-----|---------|
| <b>Portfolio</b> | 0,72 | 2,47 | 2,64 | 4,09 | 0,72 | 7,66 | 15,19 | -- | --  | 15,19   |
| <b>Benchmark</b> | 0,00 | 1,60 | 2,86 | 3,88 | 0,00 | 8,00 | 8,32  | -- | --  | 8,32    |

Yield 12m % -

### Rendimenti Cumulati (m)



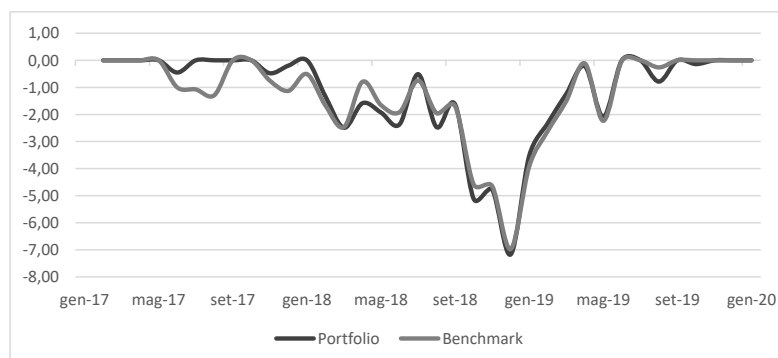
### Rendimenti Annuali %



### Rendimenti Mensili %

|             | Gen  | Feb   | Mar   | Apr  | Mag   | Giu   | Lug  | Ago   | Sep  | Ott   | Nov   | Dic   | Anno         |
|-------------|------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|-------|--------------|
| <b>2017</b> |      | 2,05  | 2,24  | 1,39 | 0,72  | -0,45 | 0,58 | 0,54  | 1,06 | 0,97  | -0,48 | 0,28  | <b>9,23</b>  |
| <b>2018</b> | 1,54 | -1,34 | -1,17 | 0,93 | -0,35 | -0,45 | 1,90 | -1,97 | 0,86 | -3,54 | 0,36  | -2,51 | <b>-5,74</b> |
| <b>2019</b> | 3,92 | 1,25  | 1,11  | 1,04 | -1,87 | 2,72  | 0,61 | -0,79 | 1,10 | -0,14 | 1,05  | 0,68  | <b>11,08</b> |
| <b>2020</b> | 0,72 |       |       |      |       |       |      |       |      |       |       |       | <b>0,72</b>  |

### Drawdown Storico (m) %



### Statistiche (m) %

|                   | Portfolio | Benchmark |
|-------------------|-----------|-----------|
| Rend. Ann.%       | 4,83      | 2,70      |
| Rischio Ann.%     | 5,15      | 4,57      |
| Return/Risk Ratio | 0,94      | 0,59      |
| % Mesi Positivi   | 66,67     | 55,56     |
| Max Drawdown %    | 7,17      | 6,97      |
| Periodo Recupero  | 6,00      | 7,00      |
| VaR95 Ann. %      | 7,29      | 7,64      |
| cVaR95 Ann. %     | 10,49     | 9,32      |
| Sharpe            | 0,21      | 0,24      |
| Sortino           | 0,44      | 0,28      |
| Info Ratio        | 1,13      | --        |
| Alfa              | 0,16      | --        |
| Beta              | 1,05      | --        |
| Correl            | 0,93      | --        |

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.

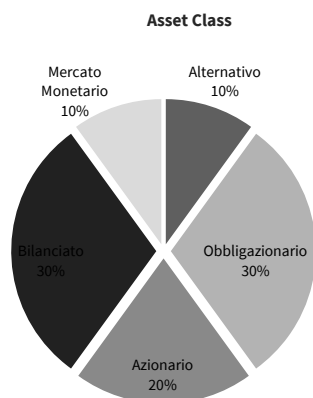
# PT 1FQ - Fondi Quotati

## Model Portfolio EUR

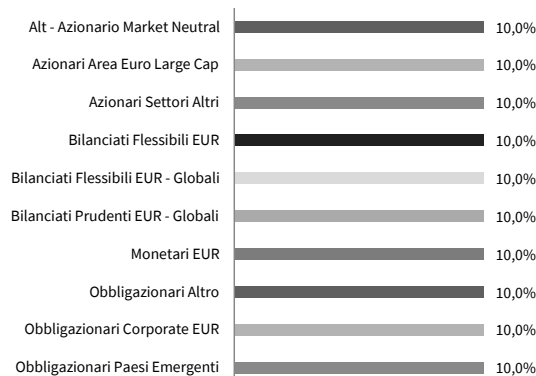
Periodo 31/01/2017 - 31/01/2020  
Benchmark Italy Fideuram Balanced Group

Profilo Rischio (1-7) 4  
Orizz. Investimento 5-7

### Composizione Portafoglio



### Top 10 Categorie



| Sottostante   | Peso % | Divisa | Asset Class       | Categoria                           |
|---|--------|--------|-------------------|-------------------------------------|
| New Millennium - Global Equities L EUR                            | 10,00  | EUR    | Azionario         | Azionari Settori Altri              |
| New Millennium - Augustum Corporate Bond L EUR                    | 10,00  | EUR    | Obbligazionario   | Obbligazionari Corporate EUR        |
| Pharus Sicav - Liquidity Q EUR                                    | 10,00  | EUR    | Mercato Monetario | Monetari EUR                        |
| Alessia Volcor Beta Zero Q EUR                                    | 10,00  | EUR    | Alternativo       | Alt - Azionario Market Neutral      |
| TCW Funds - Emerging Markets Income Fund ATF E EUR                | 10,00  | EUR    | Obbligazionario   | Obbligazionari Paesi Emergenti      |
| TCW Funds - Emerging Markets Local Currency Income Fund ATFHE EUR | 10,00  | EUR    | Obbligazionario   | Obbligazionari Altro                |
| HPS - Basic Fund Q EUR  | 10,00  | EUR    | Bilanciato        | Bilanciati Flessibili EUR           |
| CompAM Fund - SB Bond Q EUR                                       | 10,00  | EUR    | Bilanciato        | Bilanciati Prudenti EUR - Globali   |
| CompAM Fund - SB Equity Q EUR                                     | 10,00  | EUR    | Bilanciato        | Bilanciati Flessibili EUR - Globali |
| 8a+ Eiger Q EUR   | 10,00  | EUR    | Azionario         | Azionari Area Euro Large Cap        |

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.