

PT ETF1B - BALANCED

Model Portfolio EUR

Periodo 31/01/2017 - 31/01/2020

Profilo Rischio (1-7)

4

Benchmark 50% Bloomberg Barclays Global-Aggregate Total Return Index Value Hedged Eur 50% Msci World Eur

Orizz. Investimento

5-7

Descrizione

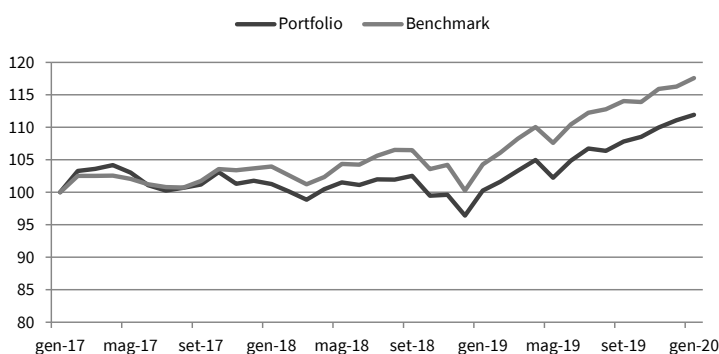
The investment objective of the portfolio is to generate modest long term capital appreciation with a secondary objective of preserving capital. This portfolio will generally feature significant exposure to global equity and fixed income markets in order to balance the two objectives. The strategy will invest in a universe of more than 130 ETP with more than 250M AUM in EUR currency.

Rendimenti %

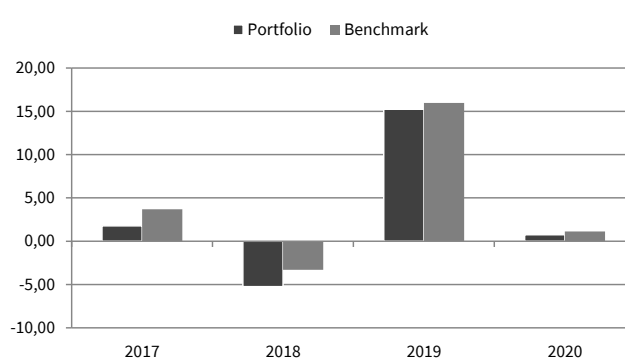
	1m	3m	6m	9m	YTD	1a	3a	5a	10a	Periodo
Portfolio	0,74	3,14	4,86	6,62	0,74	11,63	11,93	--	--	11,93
Benchmark	1,13	3,23	4,75	6,84	1,13	12,75	17,59	--	--	17,59

Yield 12m % -

Rendimenti Cumulati (m)



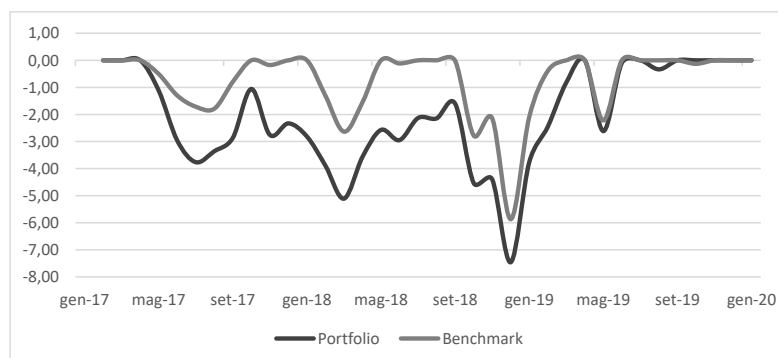
Rendimenti Annuali %



Rendimenti Mensili %

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Sep	Ott	Nov	Dic	Anno
2017		3,28	0,31	0,58	-1,12	-1,87	-0,82	0,42	0,51	1,86	-1,72	0,44	1,77
2018	-0,50	-1,11	-1,27	1,63	1,03	-0,39	0,84	-0,01	0,55	-2,98	0,14	-3,20	-5,25
2019	3,99	1,36	1,68	1,59	-2,62	2,59	1,77	-0,33	1,36	0,64	1,34	1,03	15,23
2020	0,74												0,74

Drawdown Storico (m) %



Statistiche (m) %

	Portfolio	Benchmark
Rend. Ann.%	3,83	5,55
Rischio Ann.%	5,63	5,38
Return/Risk Ratio	0,68	1,03
% Mesi Positivi	63,89	61,11
Max Drawdown %	7,46	5,87
Periodo Recupero	4,00	3,00
VaR95 Ann. %	9,37	8,16
cVaR95 Ann. %	10,71	11,38
Sharpe	0,24	0,25
Sortino	0,32	0,49
Info Ratio	-0,87	--
Alfa	-0,13	--
Beta	0,98	--
Correl	0,94	--

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.

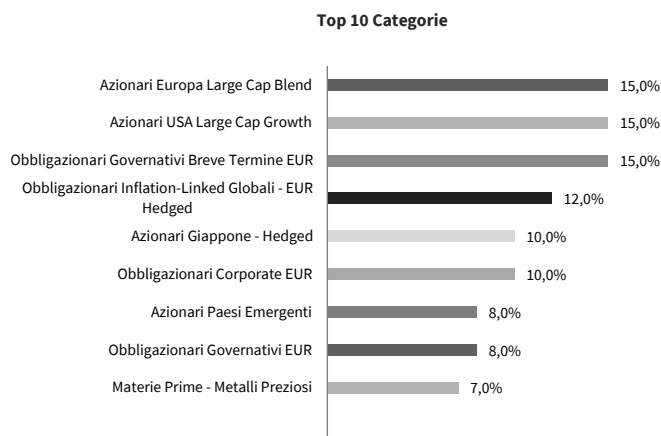
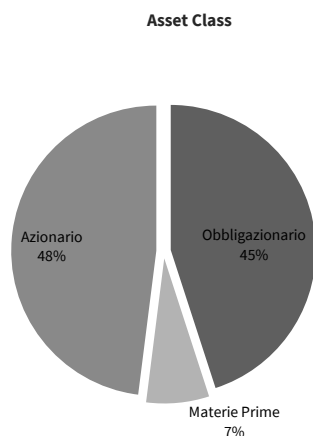
PT ETF1B - BALANCED

Model Portfolio EUR

Periodo 31/01/2017 - 31/01/2020
Benchmark 50% Bloomberg Barclays Global-Aggregate Total Return Index Value Hedged Eur 50% Msci World Eur

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

Composizione Portafoglio



Sottostante

Sottostante	Peso %	Divisa	Asset Class	Categoria
Db X-Trackers Msci Europe Index Ucits Etf Dr	15,00	EUR	Azionario	Azionari Europa Large Cap Blend
Lyxor Euromts 1-3Y Investment Grade Dr Ucits Etf	15,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionari Governativi Breve Termine EUR
Ishares Nasdaq 100 Ucits Etf Usd Acc	15,00	EUR	Azionario	Azionari USA Large Cap Growth
Db X-Trackers Ii Global Inflation-Linked Bond Ucits Etf Dr	12,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionari Inflation-Linked Globali - EUR Hedged
Db X-Trackers Ii Eur Corporate Bond Ucits Etf Dr	10,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionari Corporate EUR
Ishares Msci Japan Eur Hedged Ucits Etf Acc	10,00	EUR	Azionario	Azionari Giappone - Hedged
Lyxor Euromts 3-5Y Investment Grade Dr Ucits Etf	8,00	EUR	Obbligazionario	Obbligazionari Governativi EUR
Lyxor Msci Emerging Markets Ucits Etf	8,00	EUR	Azionario	Azionari Paesi Emergenti
Etf's Physical Gold	7,00	EUR	Materie Prime	Materie Prime - Metalli Preziosi

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.