



Pietro Calì

CONSULENZA FINANZIARIA
& CAPITAL MANAGEMENT

DIAGNOSI DI PORTAFOGLIO



teste

Commento**Outlook macroeconomico globale**

- L'inflazione continua a scendere verso i livelli target e le banche centrali sono sempre più fiduciose riguardo al suo andamento futuro, per cui nei prossimi mesi assisteremo alle prime riduzioni dei tassi.
- I mercati finanziari scontano tagli più rapidi di quelli che le autorità monetarie hanno indicato di essere pronte ad attuare. Questa divergenza di vedute non modificherà la traiettoria a medio termine della politica monetaria, ma sarà probabilmente causa di volatilità di mercato nella misura in cui i trader rivedranno le loro aspettative.
- I futuri tagli dei tassi saranno verosimilmente accompagnati da una performance discreta, anche se non spettacolare, dell'economia. Gli Stati Uniti sembrano avviati a mantenere il loro primato grazie alla buona tenuta mostrata dalla crescita negli ultimi mesi. Tuttavia, il rallentamento della Cina è probabilmente destinato a proseguire, in quanto il sostegno pubblico sembra finalizzato solo a gestire i rischi al ribasso anziché a stimolare la crescita.
- Alla fine del 2023 l'attività nel Regno Unito e nell'Eurozona ha registrato una netta decelerazione, poiché l'effetto della stretta monetaria ha raggiunto il culmine. Il miglioramento dei redditi reali e l'allentamento della politica monetaria dovrebbero dare impulso all'attività economica, ma il rimbalzo sarà prevedibilmente modesto e posticipato verso la seconda parte dell'anno.
- L'inflazione dell'area euro continua a scendere verso il target di medio periodo, anche se la volatilità e la vischiosità dei dati a breve termine dovrebbero indurre la Banca centrale europea (BCE) a mantenere invariata la sua politica per il momento. Nel Regno Unito l'inflazione ha sorpreso al ribasso nel quarto trimestre del 2023, ma le pressioni sui prezzi rimangono elevate.
- Nel breve termine, sia la BCE che la Bank of England rimarranno probabilmente focalizzate sul ritmo della disinflazione nel settore dei servizi, prima di avviare un allentamento. Data la maggiore rilevanza degli effetti di secondo ordine nel Regno Unito, è plausibile che la Bank of England rimanga in attesa più a lungo, per poi tagliare i tassi più aggressivamente.
- I rischi politici e geopolitici sono elevati e rimarranno tali per il resto dell'anno. Le elezioni statunitensi saranno il tema dominante in ambito economico, ma oltre la metà della popolazione mondiale andrà alle urne nel corso di quest'anno.

Quantalys raccoglie e calcola dati su più di 20 000 fondi. Allo stesso modo viene raccolta l'anagrafica e la documentazione ufficiale (Prospetti e KIID). Per tutti i fondi, classificati in più di 140 categorie Quantalys, vengono calcolate la performance quotidiane su diversi periodi e numerosi indicatori (volatilità, Sharpe, Information ratio, Sortino skewness, kurtosis, upside e downside capture ratio, etc.).

Quantalys Data permette di ricevere e utilizzare i data Quantalys: con la possibilità di selezionare i fondi di proprio interesse e la frequenza di ricezione è possibile creare flussi dati in diversi formati (csv, txt, xml). È inoltre possibile utilizzare i dati Quantalys in diversi contesti (siti internet, extranet) e applicazioni per un'efficienza ottimale.

Scheda identificativa

Titolare
Tipo investimento

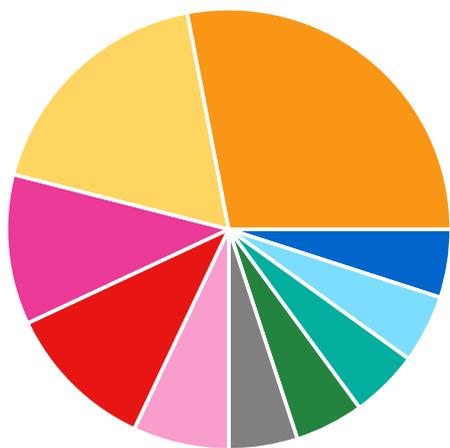
Investimenti finanziari

Valore del portafoglio

0,00 EUR

25/03/2024

Allocation dei prodotti



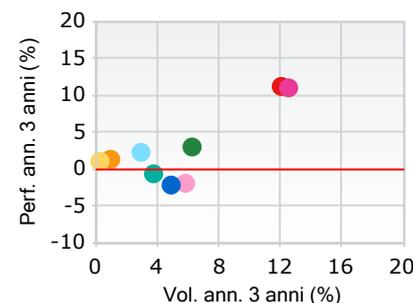
28,0%	Soprano Pronti Termine Obbli. A
18,0%	Amundi Cash EUR A2 EUR C
11,0%	Amundi Pioneer Global Equity G EUR C
11,0%	Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc
7,0%	Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C
5,0%	Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C
5,0%	Anima Alto Potenziale Europa A
5,0%	Eurizon Diversificato Etico EUR Acc
5,0%	Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR
5,0%	Altri

Performance cumulativa

1 mese :	1,54 %	YTD :	3,32 %
1 anno :	8,13 %	2023 :	5,73 %
3 anni :	11,10 %	2022 :	-3,93 %
5 anni :	23,86 %	2021 :	8,35 %
ITD :	104,13 %		

Performance anno civile

Rend./Rischio al 25/03/2024

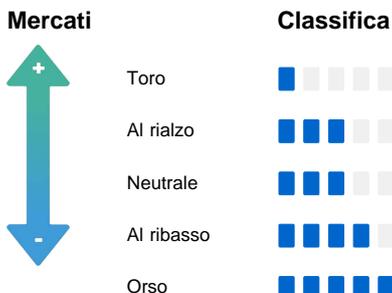


Composizione del portafoglio

Nome	ISIN	Rating	Peso %	Montante € NAV €	Categoria	Rischio
Soprano Pronti Termine Obbli. A	IT0005038648	☆☆☆☆☆	28,0	- 5,17	Obbligazionario Euro	
Amundi Cash EUR A2 EUR C	LU0568620560	☆☆☆☆☆	18,0	- 101,54	Monetari Europa	1/7
Amundi Pioneer Global Equity G EUR C	LU1883833862	☆☆☆☆☆	11,0	- 8,40	Azionario Globale	4/7
Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc	IT0001080446	☆☆☆☆☆	11,0	- 25,95	Azionario Globale	
Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C	LU1883329788	☆☆☆☆☆	7,0	- 5,55	Bilanciati Prudenti	3/7
Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C	LU1882440099	☆☆☆☆☆	5,0	- 6,21	Flessibili	3/7
Anima Alto Potenziale Europa A	IT0001355665	☆☆☆☆☆	5,0	- 3,53	Performance assoluta euro	
Eurizon Diversificato Etico EUR Acc	IT0001052742	☆☆☆☆☆	5,0	- 10,66	Bilanciati Prudenti	
Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR	LU1529955046	☆☆☆☆☆	5,0	- 123,65	Obbligazionario Altre Valute	3/7
Altri			5,0	- -		

Il dettaglio completo dei fondi è visibile nella sezione: "Zoom prodotti: perf. cumulative".

Barometro



Diversificazione	25,76 %	■■■■■
Qualità dei fondi	3,8	■■■■■
Fondo ESG	90,0 %	■■■■■
Spese correnti medie	1,00 %	■■■■■

Allocation del portafoglio

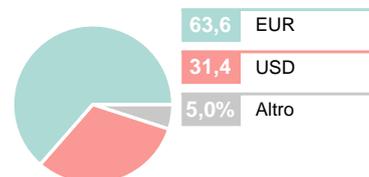


Indicatori di rischio

SRI 1 2 3 4 5 6 7

Volatilità a 3 anni	3,68 %	■■■■■
Max DD 3 anni	5,28 %	■■■■■
DSR 3 anni	2,61 %	■■■■■

Esposizione valutaria



Performance rolling

Dati	1 sett.	1 mese	3 mesi	6 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	8 anni	10 anni
Performance cumulativa TWR (%)	0,55	1,54	3,51	6,16	8,13	11,10	23,86	31,03	39,89
Performance annualizzata TWR (%)	-	-	-	-	8,13	3,57	4,37	3,44	3,41
Volatilità (%)	-	-	1,96	3,08	3,02	3,68	4,89	4,50	4,66
Sharpe ratio	-	-	5,52	2,84	1,48	0,64	0,79	0,73	0,71
Max drawdown (%)	-0,11	-0,19	-0,40	-1,41	-2,01	-5,28	-11,46	-11,46	-11,46

Performance anno civile

Dati	YTD	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017
Performance (%)	3,32	5,73	-3,93	8,35	3,94	8,35	-3,20	1,69
Volatilità (%)	-	3,25	4,73	3,39	8,03	3,32	4,84	2,08
Sharpe ratio	-	0,76	-0,83	2,63	0,56	2,66	-0,57	1,03
Max drawdown	0,40	2,01	5,28	1,51	11,46	2,21	5,04	1,96

Zoom prodotti: perf. cumulative

Peso %	Nome	Codice ISIN	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	Data	Rating
28,00	Soprarno Pronti Termine Obbli. A	IT0005038648	0,68 %	3,54 %	3,90 %	3,58 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
18,00	Amundi Cash EUR A2 EUR C	LU0568620560	0,90 %	3,45 %	3,01 %	1,80 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
11,00	Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc	IT0001080446	9,54 %	26,48 %	36,69 %	81,99 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
11,00	Amundi Pioneer Global Equity G EUR C	LU1883833862	10,95 %	23,80 %	37,43 %	81,50 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
7,00	Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C	LU1883329788	0,64 %	2,33 %	-5,81 %	7,44 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
5,00	Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR	LU1529955046	1,00 %	-1,41 %	9,16 %	12,32 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
5,00	Anima Alto Potenziale Europa A	IT0001355665	3,88 %	4,31 %	6,86 %	25,94 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
5,00	Eurizon Diversificato Etico EUR Acc	IT0001052742	0,04 %	3,55 %	-2,04 %	6,41 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
5,00	Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C	LU1882440099	1,75 %	3,57 %	-6,49 %	3,40 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
3,00	Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc	LU0533033238	8,01 %	13,26 %	34,83 %	68,40 %	25/03/2024	☆☆☆☆☆
2,00	WisdomTree Physical Gold EUR	JE00B1VS3770	7,48 %	7,99 %	34,55 %	73,63 %	25/03/2024	

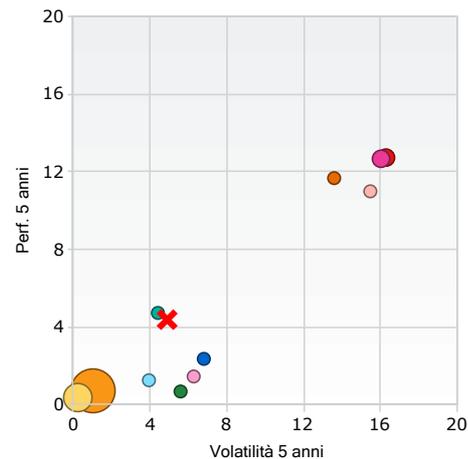
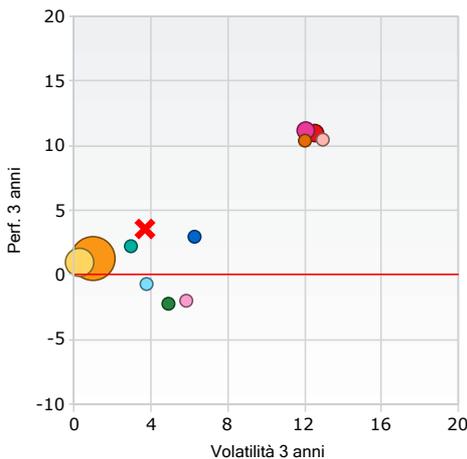
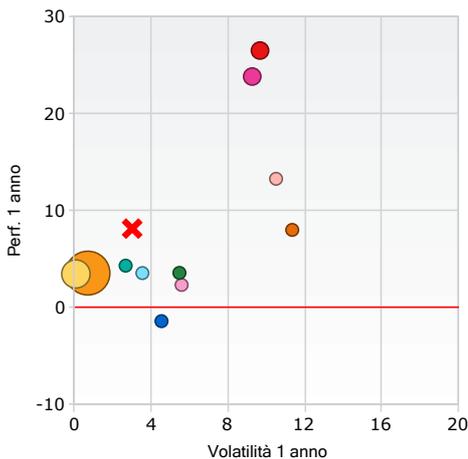
Serie storica base 100 dal 25/03/2021 al 25/03/2024



Performance e indici su 3 anni al 25/03/2024

Nome	Perf. cum.	Perf. ann.	Volatilità	Max drawdown	Sortino	Sharpe ratio
Esempio Diagnosi di Portafoglio	11,10	3,57	3,68	5,28	0,90	0,64

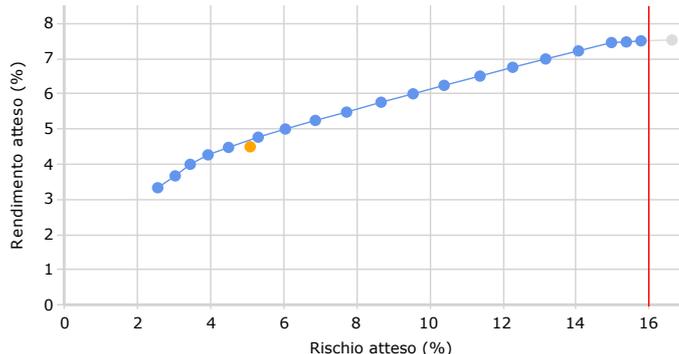
Analisi rendimento rischio



- Soprarro Pronti Termine Obbli. A
- Amundi Cash EUR A2 EUR C
- Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc
- Amundi Pioneer Global Equity G EUR C
- Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C
- Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR
- Eurizon Diversificato Etico EUR Acc
- Anima Alto Potenziale Europa A
- Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C
- Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc
- WisdomTree Physical Gold EUR

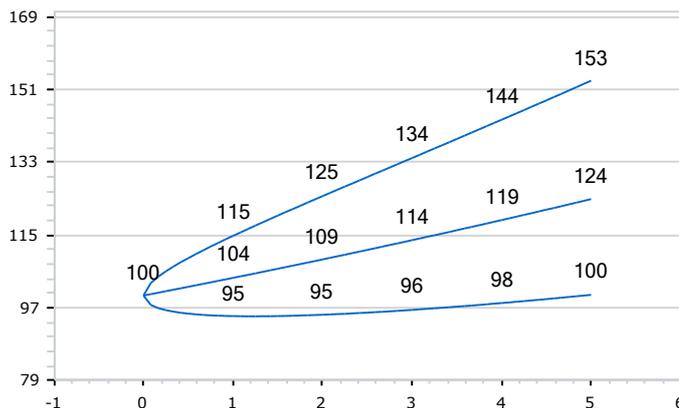
Rendimento/Rischio attesi

● Portafoglio (Rend. atteso 4,50 % Vol. attesa 5,07 %)



Abbiamo rappresentato la frontiera efficiente Quantalys che comprende 20 asset allocation. A ciascuna di queste asset allocation efficienti corrispondono un rendimento e un rischio attesi. L'asset allocation attuale del portafoglio è rappresentato dal punto arancione.

Evoluzione probabilistica



Questo grafico rappresenta l'evoluzione statistica nel 95% dei casi dell'asset allocation del portafoglio su 5 anni. La curva superiore rappresenta l'ipotesi più favorevole, la curva inferiore la meno favorevole e quella centrale l'evoluzione media.

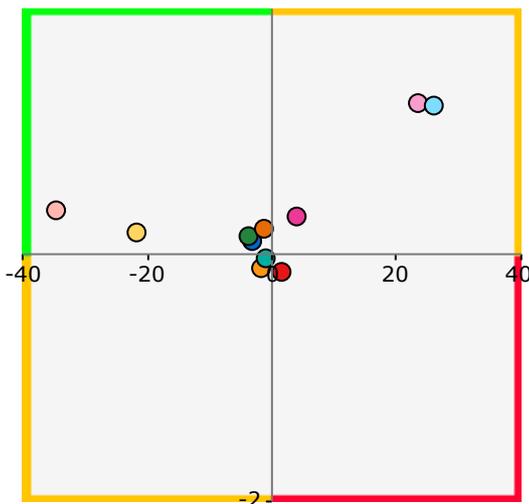
Questo grafico non dà nessuna garanzia di rendimento e rischio ed è fornito solo a titolo illustrativo. Poggia sulle ipotesi di rendimento, rischio e covarianze attese da ciascuna delle asset class dell'allocation del portafoglio, sulla normalità della distribuzione dei rendimenti. Tali ipotesi non sono necessariamente verificate.

	1 anno	3 anni	5 anni	8 anni	10 anni	12 anni
Rendimento medio cumulato atteso (%)	4,37	13,71	23,87	40,85	53,44	67,16
Perdita massima / Rendimento minimo a scadenza (%)	-5,10	-3,56	0,14	7,63	13,58	20,24
Perdita massima / Rendimento minimo sul periodo (%)	-5,10	-5,15	-5,15	-5,15	-5,15	-5,15

Contribuzioni a 3 anni

Aumenta la performance

Diminuisce il rischio



Aumenta il rischio

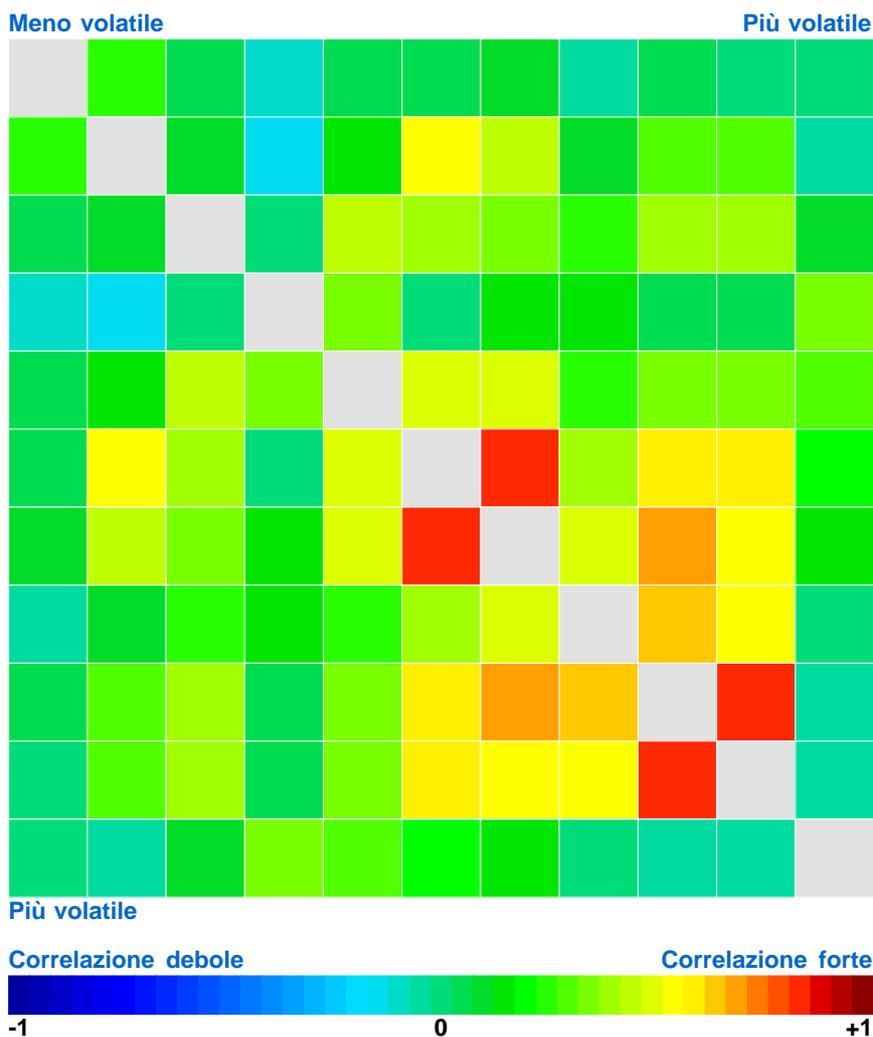
Il grafico individua il contributo al rischio e alla performance dei fondi in portafoglio. Più un fondo si posiziona a sinistra, più contribuisce a diminuire il rischio del portafoglio. Più è in alto, più contribuisce ad aumentare la performance. Queste contribuzioni prendono in considerazione il peso del fondo nel portafoglio e vengono calcolate su un periodo di 3 anni.

Diminuisce la performance

Performance portafoglio: 3,57 % Volatilità del portafoglio: 3,68 %

Prodotto	Vol. senza il prodotto	Perf. del prodotto	Contrib. al rischio	Contrib. alla perf.	Peso (%)
Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C	3,74	-2,21	-1,77	-0,11	5,00
Amundi Cash EUR A2 EUR C	4,48	0,99	-21,82	0,18	18,00
Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C	3,62	-1,97	1,52	-0,14	7,00
Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc	3,53	10,46	3,95	0,31	3,00
Amundi Pioneer Global Equity G EUR C	2,81	11,17	23,47	1,23	11,00
Anima Alto Potenziale Europa A	3,79	2,24	-3,21	0,11	5,00
Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc	2,72	10,97	26,03	1,21	11,00
Eurizon Diversificato Etico EUR Acc	3,71	-0,68	-1,03	-0,03	5,00
Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR	3,82	2,96	-3,81	0,15	5,00
Soprano Pronti Termine Obbli. A	4,95	1,28	-34,78	0,36	28,00
WisdomTree Physical Gold EUR	3,72	10,39	-1,31	0,21	2,00

Correlazioni in funzione delle condizioni di mercato



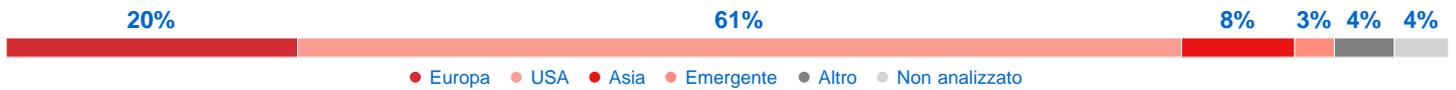
Matrice delle correlazioni 3 anni

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
1 Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR	1,00	0,02	-0,11	0,07	0,39	-0,09	0,04	0,16	0,19	0,05	0,37
2 Anima Alto Potenziale Europa A	0,02	1,00	0,14	0,44	0,13	0,07	0,44	0,38	0,30	0,40	0,48
3 Soprano Pronti Termine Obbli. A	-0,11	0,14	1,00	0,33	-0,01	0,29	0,57	0,50	0,12	0,34	0,16
4 Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc	0,07	0,44	0,33	1,00	-0,05	0,07	0,65	0,71	0,66	0,89	0,36
5 WisdomTree Physical Gold EUR	0,39	0,13	-0,01	-0,05	1,00	0,01	0,21	0,18	0,04	0,00	0,31
6 Amundi Cash EUR A2 EUR C	-0,09	0,07	0,29	0,07	0,01	1,00	0,08	0,13	-0,04	0,04	0,09
7 Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C	0,04	0,44	0,57	0,65	0,21	0,08	1,00	0,86	0,40	0,63	0,52
8 Eurizon Diversificato Etico EUR Acc	0,16	0,38	0,50	0,71	0,18	0,13	0,86	1,00	0,52	0,60	0,52
9 Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc	0,19	0,30	0,12	0,66	0,04	-0,04	0,40	0,52	1,00	0,55	0,25
10 Amundi Pioneer Global Equity G EUR C	0,05	0,40	0,34	0,89	0,00	0,04	0,63	0,60	0,55	1,00	0,36
11 Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C	0,37	0,48	0,16	0,36	0,31	0,09	0,52	0,52	0,25	0,36	1,00

Verde :buon potenziale di diversificazione (correlazione inferiore a 0.6)
 Arancione :potenziale di diversificazione medio (correlazione tra 0.6 e 0.9)
 Rosso :scarso potenziale di diversificazione (correlazione superiore a 0.9)

Analisi della quota azionaria

Mappatura per zona geografica



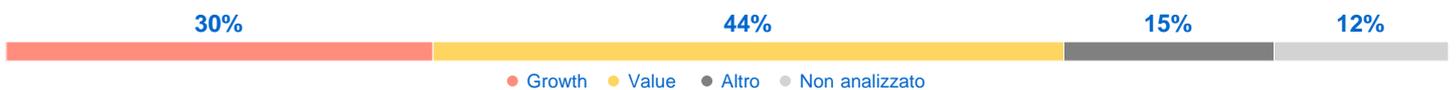
Mappatura per settori



Mappatura per capitalizzazione



Mappatura per stile

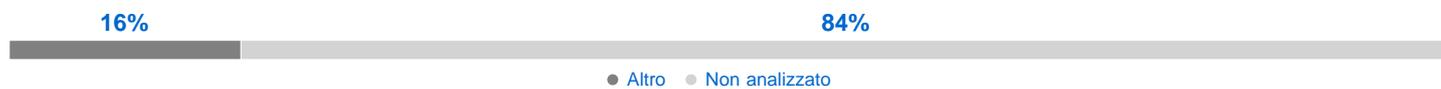


Analisi della quota obbligazionaria

Mappatura per zona geografica



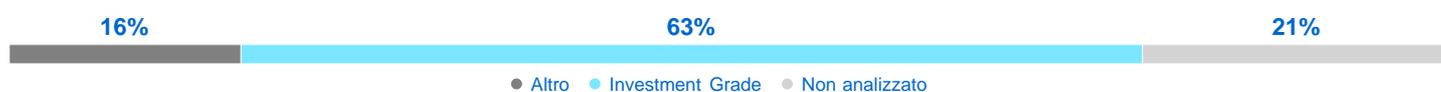
Mappatura per emittente



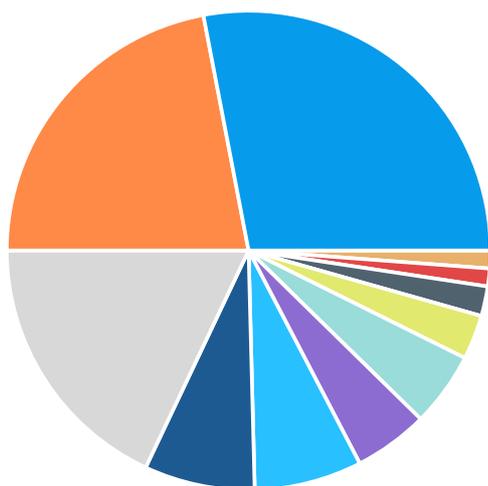
Mappatura per duration



Mappatura per rating

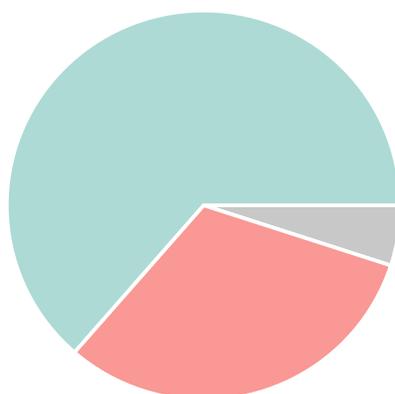


Portafoglio per asset class



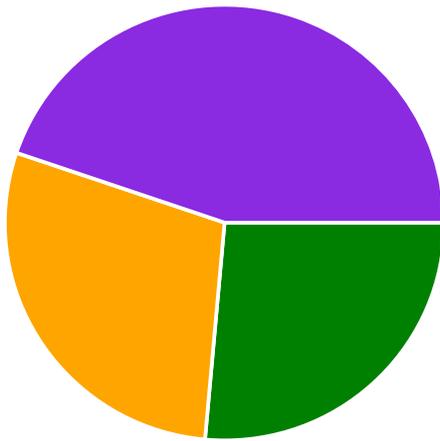
18,0%	Liquidità
28,0%	Obblig. euro breve term.
7,2%	Obblig. Euro all maturit.
7,4%	Obblig. Globale
1,2%	Az. Europa
1,2%	Az. USA
22,0%	Az. Globale
5,0%	Performance Assoluta
5,0%	Flessibili dinamici
2,0%	Commodities
3,0%	Az. Salute

Esposizione valutaria



63,6%	EUR
31,4%	USD
5,0%	Altro

Ripartizione azioni e obbligazioni



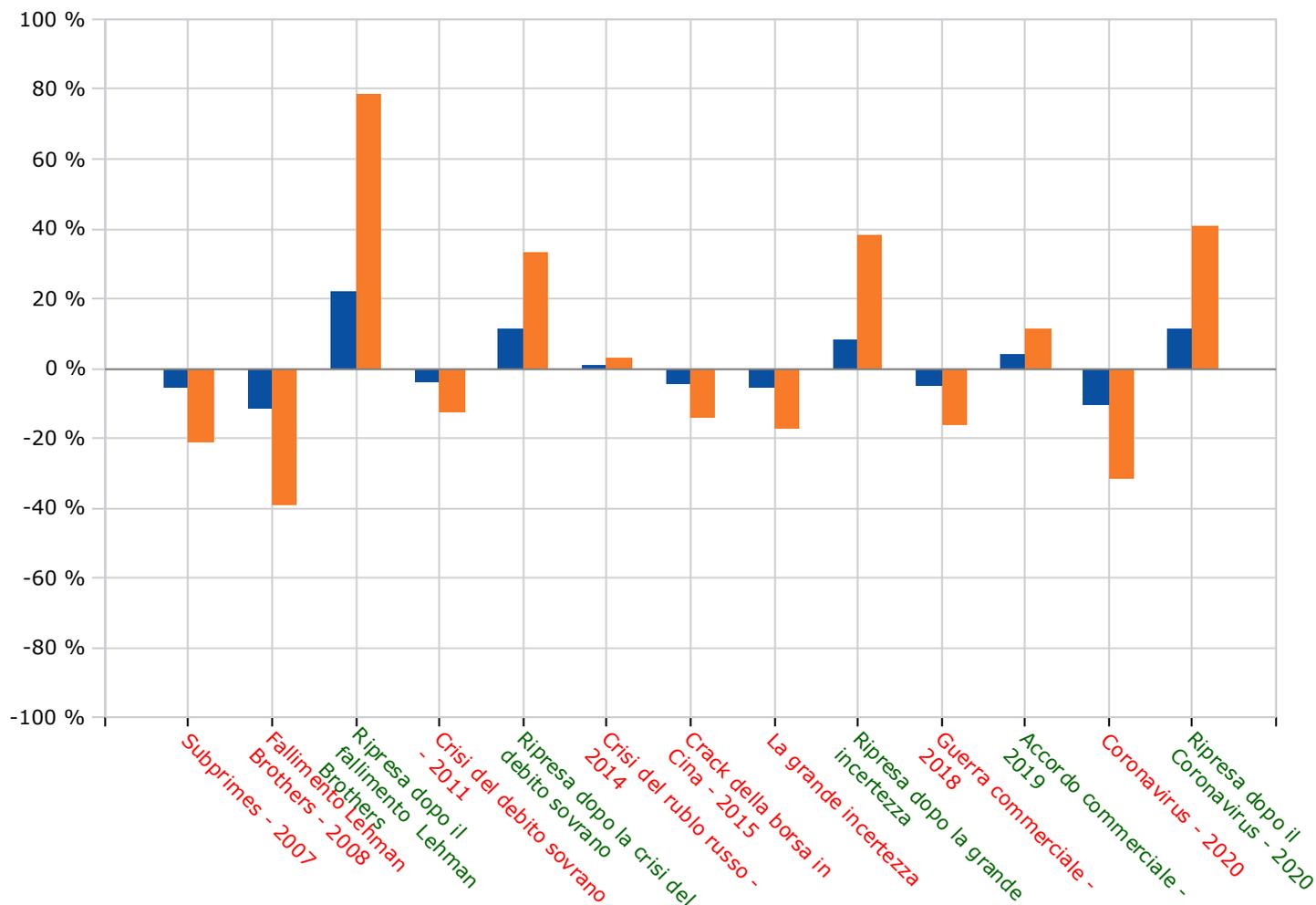
28,8% Azioni

44,8% Obbligazioni

26,4% Altri

Il portafoglio confrontato alla storia

- Portafoglio
- MSCI World Index



Scenari	Perf. portafoglio	Perf. benchmark	Delta
Subprimes - 2007	-5,29 %	-21,24 %	15,95 %
Fallimento Lehman Brothers - 2008	-11,23 %	-39,27 %	28,04 %
Ripresa dopo il fallimento Lehman Brothers	22,37 %	78,65 %	-56,27 %
Crisi del debito sovrano - 2011	-3,83 %	-12,52 %	8,69 %
Ripresa dopo la crisi del debito sovrano	11,61 %	33,13 %	-21,53 %
Crisi del rublo russo - 2014	0,79 %	3,01 %	-2,22 %
Crack della borsa in Cina - 2015	-4,22 %	-13,87 %	9,64 %
La grande incertezza	-5,80 %	-17,48 %	11,68 %
Ripresa dopo la grande incertezza	8,53 %	37,95 %	-29,42 %
Guerra commerciale - 2018	-4,95 %	-16,18 %	11,23 %
Accordo commerciale - 2019	3,99 %	11,25 %	-7,26 %
Coronavirus - 2020	-10,53 %	-31,70 %	21,18 %
Ripresa dopo il Coronavirus - 2020	11,58 %	40,74 %	-29,16 %

Scheda identificativa - Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR - LU1529955046

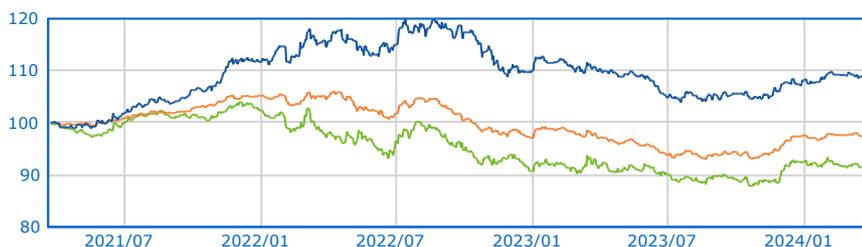
NAV

Società	Eurizon Capital SA
Società delegata	Eurizon SLJ Capital Ltd
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Obbligazionari paesi emergenti
Benchmark dichiarato	Bloomberg China Aggregate Bond Index® (rendement total)...
Categoria Quantalys	Obbligazionario altre valute
Benchmark di categoria	ICE BofA Global Broad Market Index
Gestore	Eurizon SLJ Capital LTD
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 6

123,65 EUR
25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024



● Eurizon Fund Bond Aggregate RMB R EUR ● Obblig. altre valute
● ICE BofA Global Broad Market Index

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,02 %	-0,08 %
Perf. 4 settimane	0,23 %	0,01 %
Perf. YTD	1,00 %	0,08 %
Perf. 1 anno	-1,41 %	-0,40 %
Perf. 3 anni	9,16 %	-2,42 %
Perf. 5 anni	12,32 %	1,10 %
Perf. 8 anni	-	2,97 %
Perf. 10 anni	-	13,05 %
Performance annue		
Perf. 2023	-1,71 %	0,41 %
Perf. 2022	-1,47 %	-7,70 %
Perf. 2021	16,45 %	6,46 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	3,63 %	-0,34 %
Volatilità	6,27 %	4,12 %
Sharpe ratio	0,40	-0,35

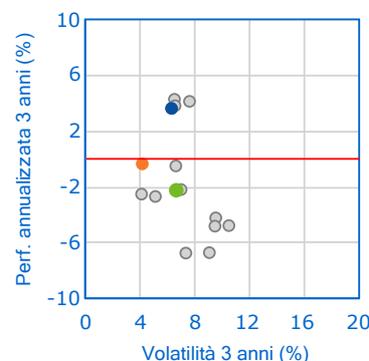
Barometro Quantalys

	Mercati	Classifica
	Toro	■■■■■
	Al rialzo	■■■■■
	Neutrale	■■■■■
	Al ribasso	■■■■■
Orso	■■■■■	

Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	21 / 62	2 ■■■■
3 mesi	25 / 62	2 ■■■■
6 mesi	15 / 62	1 ■■■■
YTD	28 / 62	2 ■■■■
1 anno	26 / 55	2 ■■■■
3 anni	7 / 36	1 ■■■■
5 anni	3 / 27	1 ■■■■
8 anni	-	- ■■■■
10 anni	-	- ■■■■

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 6,27 %	■■■■■ Eccellente
Perdita max. -13,48 %	■■■■■ Eccellente
DSR 4,17 %	■■■■■ Eccellente
Beta bear 0,45	■■■■■ Medio
VAR -1,33 %	■■■■■ Eccellente

SRI 1 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,40	■■■■■ Eccellente
Information 0,90	■■■■■ Buono
Ratio (IR) 0,60	■■■■■ Eccellente
Sortino 0,60	■■■■■ Eccellente
Omega 1,16	■■■■■ Eccellente
Calmar 0,18	■■■■■ Eccellente

Caratteristiche generali

Tipo	Fondo
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	142,21 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	-11,13 %
Spese massime	
Sottoscrizione	1,5 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	1,3 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	1,54 %
Commissioni di Gestione	1,55 %
Costi di Transazione	0,45 %

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Anima Alto Potenziale Europa A - IT0001355665

NAV

Società	Anima SGR
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Flessibili
Benchmark dichiarato	-
Categoria Quantalys	Performance assoluta multi-strategia
Benchmark di categoria	Cat: Performance assoluta multi-strategia
Gestore	Lars Schickentanz
Valutazione ISR globale	SFDR
✗ Non ISR	Articolo 6

3,53 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024



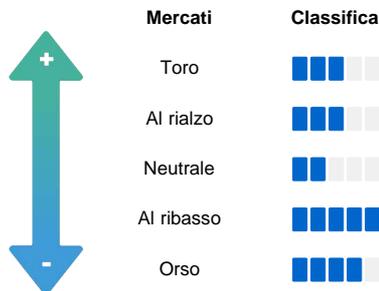
● Anima Alto Potenziale Europa A ● Perf. assoluta multi-strategia

● Cat: Performance assoluta multi-strategia

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	0,31 %	-0,05 %
Perf. 4 settimane	2,55 %	1,42 %
Perf. YTD	3,88 %	3,19 %
Perf. 1 anno	4,31 %	6,78 %
Perf. 3 anni	6,86 %	6,44 %
Perf. 5 anni	25,94 %	12,87 %
Perf. 8 anni	26,26 %	14,52 %
Perf. 10 anni	28,98 %	21,98 %
Performance annue		
Perf. 2023	-0,18 %	3,61 %
Perf. 2022	0,77 %	-4,64 %
Perf. 2021	4,03 %	6,65 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	1,81 %	1,96 %
Volatilità	3,11 %	2,80 %
Sharpe ratio	0,22	0,30

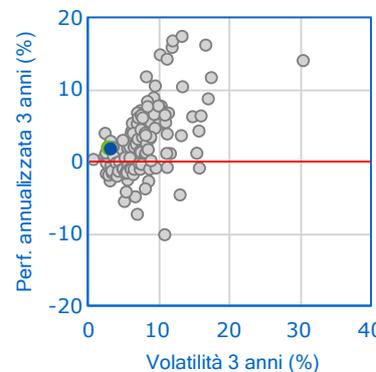
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	125 / 320	2 ■ ■ ■ ■ ■
3 mesi	184 / 319	3 ■ ■ ■ ■ ■
6 mesi	162 / 318	3 ■ ■ ■ ■ ■
YTD	167 / 319	3 ■ ■ ■ ■ ■
1 anno	192 / 296	3 ■ ■ ■ ■ ■
3 anni	114 / 262	2 ■ ■ ■ ■ ■
5 anni	54 / 201	2 ■ ■ ■ ■ ■
8 anni	46 / 116	2 ■ ■ ■ ■ ■
10 anni	42 / 87	2 ■ ■ ■ ■ ■

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 3,11 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
Perdita max. -4,40 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
DSR 2,12 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
Beta bear 0,80	■ ■ ■ ■ ■ Medio
VAR -0,60 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,22	■ ■ ■ ■ ■ Medio
Information Ratio (IR) -0,04	■ ■ ■ ■ ■ Medio
Sortino 0,33	■ ■ ■ ■ ■ Buono
Omega 1,09	■ ■ ■ ■ ■ Medio
Calmar 0,16	■ ■ ■ ■ ■ Buono

Caratteristiche generali

Tipo	Fondo
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 31/07/2023	1.120,44 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	-15,25 %
Spese massime	
Sottoscrizione	4 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	1,6 %
Performance fee	Si
Spese correnti	1,72 %
Commissioni di Gestione	-
Costi di Transazione	-

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Soprarno Pronti Termine Obbli. A - IT0005038648

NAV

Società **Soprarno SGR**
 Tipo investitore **Retail**
 Cat. Assogestioni **Obbligazionari euro governativi breve termine**
 Benchmark dichiarato **Mts Bot**
 Categoria Quantalys **Obbligazionario Euro breve termine**
 Benchmark di categoria **ICE BofA 1-3 Year Euro Broad Market Index**
 Gestore **Claudio Cavaletti**
 Valutazione ISR globale **SFDR**
Articolo 8

5,17 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

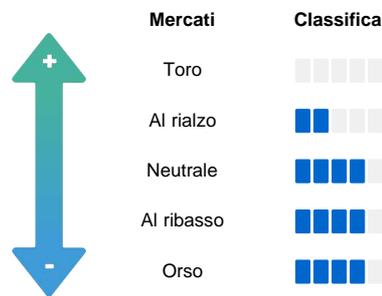


● Soprarno Pronti Termine Obbli. A ● Obblig. Euro breve term.
 ● ICE BofA 1-3 Year Euro Broad Market Index

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,04 %	-0,02 %
Perf. 4 settimane	0,35 %	0,39 %
Perf. YTD	0,68 %	0,61 %
Perf. 1 anno	3,54 %	3,81 %
Perf. 3 anni	3,90 %	0,52 %
Perf. 5 anni	3,58 %	1,29 %
Perf. 8 anni	3,36 %	1,07 %
Perf. 10 anni	-	2,12 %
Performance annue		
Perf. 2023	3,90 %	3,87 %
Perf. 2022	-0,76 %	-3,54 %
Perf. 2021	-0,08 %	-0,25 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	1,20 %	0,08 %
Volatilità	0,96 %	1,11 %
Sharpe ratio	0,08	-0,94

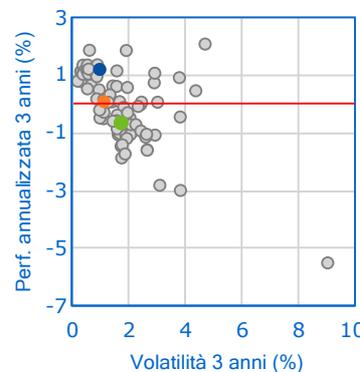
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	115 / 240	2
3 mesi	150 / 237	3
6 mesi	162 / 235	3
YTD	118 / 240	2
1 anno	118 / 224	3
3 anni	27 / 205	1
5 anni	46 / 183	1
8 anni	40 / 136	2
10 anni	-	-

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 0,96 %	Buono
Perdita max. -1,90 %	Eccellente
DSR 0,73 %	Buono
Beta bear 0,34	Medio
VAR -0,14 %	Buono

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,08	Eccellente
Information Ratio (IR) 1,28	Eccellente
Sortino 0,11	Eccellente
Omega 1,05	Eccellente
Calmar 0,04	Eccellente

Caratteristiche generali

	Fondo
Tipo	Distribuzione
Accumul./Distribuz.	No
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 29/02/2024	43,50 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	3,69 %
Spese massime	
Sottoscrizione	0,5 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	0,18 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,29 %
Commissioni di Gestione	-
Costi di Transazione	-

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc - IT0001080446

NAV

Società	Eurizon Capital SGR SpA
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Azionari internazionali
Benchmark dichiarato	95% MSCI World in euro+5% Barclays Euro Treasury Bills ...
Categoria Quantalys	Azionario globale
Benchmark di categoria	MSCI World NR
Gestore	Claudio Marchetti
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 8

25,95 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

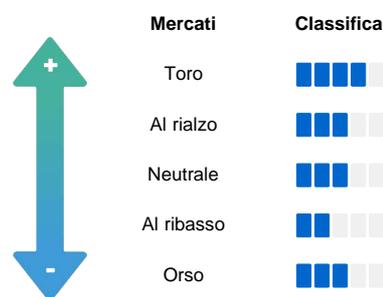


● Eurizon Azioni Internazionali EUR Acc ● Az. globale ● MSCI World NR

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,38 %	-0,27 %
Perf. 4 settimane	3,47 %	2,57 %
Perf. YTD	9,54 %	7,87 %
Perf. 1 anno	26,48 %	19,67 %
Perf. 3 anni	36,69 %	19,87 %
Perf. 5 anni	81,99 %	56,01 %
Perf. 8 anni	122,76 %	95,77 %
Perf. 10 anni	164,82 %	132,07 %
Performance annue		
Perf. 2023	18,78 %	14,19 %
Perf. 2022	-13,31 %	-16,41 %
Perf. 2021	29,84 %	23,23 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	11,49 %	6,49 %
Volatilità	12,56 %	11,69 %
Sharpe ratio	0,83	0,46

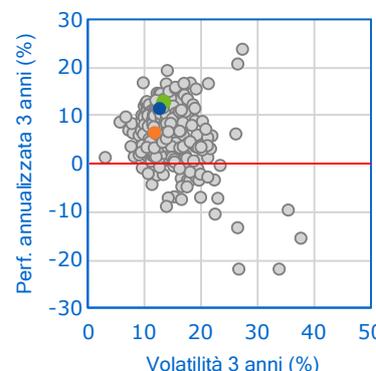
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	1106 / 1907	3
3 mesi	1051 / 1896	3
6 mesi	637 / 1867	2
YTD	776 / 1906	2
1 anno	460 / 1779	2
3 anni	255 / 1292	1
5 anni	174 / 917	1
8 anni	163 / 605	2
10 anni	142 / 476	2

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 12,56 %	Buono
Perdita max. -17,09 %	Buono
DSR 8,61 %	Buono
Beta bear 1,03	Scarso
VAR -2,96 %	Buono

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,83	Eccellente
Information Ratio (IR) -0,32	Medio
Sortino 1,20	Eccellente
Omega 1,35	Eccellente
Calmar 0,60	Buono

Caratteristiche generali

Tipo	Fondo
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 31/10/2016	747,26 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	-3,58 %
Spese massime	
Sottoscrizione	1,5 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	1,8 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	1,87 %
Commissioni di Gestione	-
Costi di Transazione	-

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'eshaustività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - WisdomTree Physical Gold EUR - JE00B1VS3770

NAV

Società	ETF Securities Jersey
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	-
Benchmark dichiarato	Spot Gold LBMA specifications
Categoria Quantalys	Commodities
Benchmark di categoria	S&P GSCI TR
Gestore	-
Valutazione ISR globale	SFDR
✗ Non ISR	-

188,00 EUR

25/03/2024

Categoria senza rating
Rating Quantalys

Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

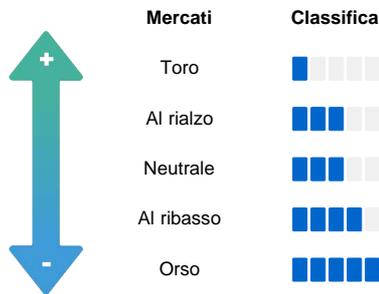


● WisdomTree Physical Gold EUR ● Commodities ● S&P GSCI TR

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	0,03 %	0,52 %
Perf. 4 settimane	7,48 %	5,15 %
Perf. YTD	7,48 %	3,79 %
Perf. 1 anno	7,99 %	2,13 %
Perf. 3 anni	34,55 %	25,68 %
Perf. 5 anni	73,63 %	48,99 %
Perf. 8 anni	-	72,71 %
Perf. 10 anni	-	33,50 %
Performance annue		
Perf. 2023	9,52 %	-6,32 %
Perf. 2022	5,69 %	12,98 %
Perf. 2021	3,15 %	22,80 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	9,21 %	6,44 %
Volatilità	11,77 %	13,99 %
Sharpe ratio	0,69	0,38

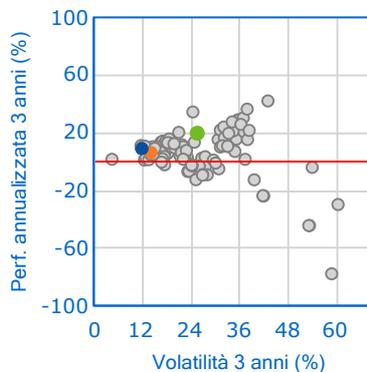
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	61 / 189	2
3 mesi	46 / 184	1
6 mesi	22 / 184	1
YTD	57 / 189	2
1 anno	30 / 182	1
3 anni	80 / 172	2
5 anni	30 / 152	1
8 anni	40 / 123	2
10 anni	12 / 116	1

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 11,77 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
Perdita max. -11,86 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
DSR 7,06 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
Beta bear 0,01	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente
VAR -2,33 %	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,69	■ ■ ■ ■ ■ Buono
Information Ratio (IR) -0,43	■ ■ ■ ■ ■ Medio
Sortino 1,15	■ ■ ■ ■ ■ Buono
Omega 1,29	■ ■ ■ ■ ■ Buono
Calmar 0,68	■ ■ ■ ■ ■ Eccellente

Caratteristiche generali

Tipo	CDI
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	4.238,80 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	5,46 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Nessuno
Rimborso	Nessuno
Gestione	Nessuno
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	-
Commissioni di Gestione	-
Costi di Transazione	-

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Amundi Cash EUR A2 EUR C - LU0568620560

NAV

Società **Amundi Luxembourg**
 Società delegata **Amundi Asset Management**
 Tipo investitore **Retail**
 Cat. Assogestioni **Fondi di mercato monetario Euro**
 Benchmark dichiarato **Euribor à 3 mesi**
 Categoria Quantalys **Monetari Euro**
 Benchmark di categoria **Ester**
 Gestore **Baptiste Loubert**

101,54 EUR

25/03/2024



Rating Quantalys

Valutazione ISR globale



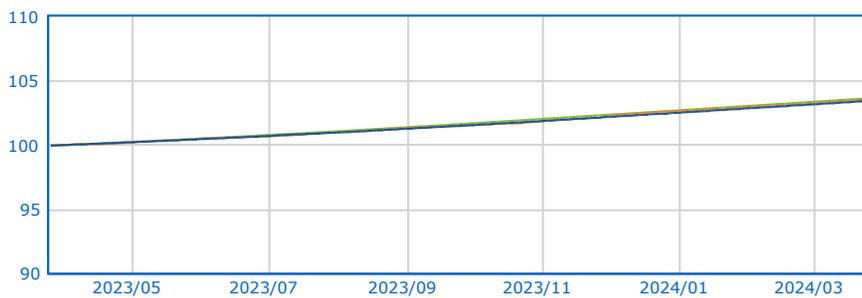
Riconoscimenti



SFDR

Articolo 8

Serie storica base 100 dal 26/03/2023 al 25/03/2024

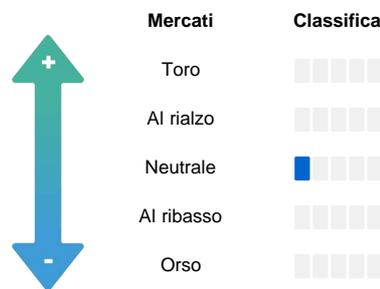


● Amundi Cash EUR A2 EUR C ● Monetari Euro ● Ester

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	0,03 %	0,01 %
Perf. 4 settimane	0,29 %	0,31 %
Perf. YTD	0,90 %	0,85 %
Perf. 1 anno	3,45 %	3,54 %
Perf. 3 anni	3,01 %	3,12 %
Perf. 5 anni	1,80 %	2,42 %
Perf. 8 anni	0,47 %	1,47 %
Perf. 10 anni	0,43 %	1,58 %
Performance annue		
Perf. 2023	3,01 %	3,26 %
Perf. 2022	-0,26 %	-0,60 %
Perf. 2021	-0,82 %	-0,49 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	0,89 %	0,94 %
Volatilità	0,26 %	0,32 %
Sharpe ratio	-0,90	-0,57

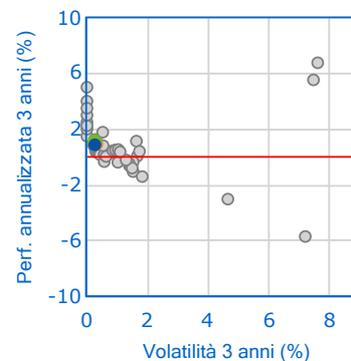
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	141 / 249	3
3 mesi	171 / 249	3
6 mesi	167 / 247	3
YTD	130 / 249	3
1 anno	157 / 237	3
3 anni	155 / 229	3
5 anni	157 / 213	3
8 anni	128 / 176	3
10 anni	121 / 167	3

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 0,26 %	Eccellente
Perdita max. -1,21 %	Scarso
DSR 0,05 %	Medio
Beta bear 1,33	Pessimo
VAR -0,02 %	Scarso

SRI **1** 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe -0,90	Scarso
Information -5,59	Pessimo
Ratio (IR) -4,70	Pessimo
Sortino 0,14	Pessimo
Omega -0,19	Scarso

Caratteristiche generali

Tipo	SICAV
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	1.628,51 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	9,34 %
Spese massime	
Sottoscrizione	4,5 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	0,75 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,3 %
Commissioni di Gestione	0,46 %
Costi di Transazione	0,03 %

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C - LU1883329788

NAV

Società	Amundi Luxembourg
Società delegata	Amundi SGR SpA
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Bilanciati obbligazionari
Benchmark dichiarato	80 % Bloomberg Euro Aggregate Bond Index + 20 % MSCI Wo...
Categoria Quantalys	Bilanciati prudenti globale
Benchmark di categoria	25% MSCI World + 75% ICE BofA Global Broad Market
Gestore	Bovalini Enrico
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 8

5,55 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024



● Amundi Gbl Multi-Asset Conserv F EUR C ● Bilanc. Prud. Global
● 25% MSCI World + 75% ICE BofA Global Broad Market

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,23 %	-0,07 %
Perf. 4 settimane	1,54 %	1,15 %
Perf. YTD	0,64 %	1,66 %
Perf. 1 anno	2,33 %	6,81 %
Perf. 3 anni	-5,81 %	-0,26 %
Perf. 5 anni	7,44 %	6,20 %
Perf. 8 anni	11,66 %	9,80 %
Perf. 10 anni	-	16,47 %
Performance annue		
Perf. 2023	3,83 %	6,57 %
Perf. 2022	-11,89 %	-10,90 %
Perf. 2021	3,26 %	4,16 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	-1,95 %	-0,19 %
Volatilità	5,80 %	4,19 %
Sharpe ratio	-0,53	-0,31

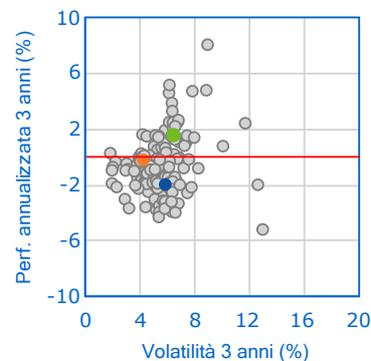
Barometro Quantalys

Mercati	Classifica
Toro	■■■■■
Al rialzo	■■■■■
Neutrale	■■■■■
Al ribasso	■■■■■
Orso	■■■■■

Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	466 / 510	4 ■■■■
3 mesi	357 / 505	3 ■■■■
6 mesi	415 / 502	4 ■■■■
YTD	415 / 507	4 ■■■■
1 anno	418 / 485	4 ■■■■
3 anni	272 / 385	3 ■■■■
5 anni	65 / 293	1 ■■■■
8 anni	32 / 180	1 ■■■■
10 anni	22 / 133	1 ■■■■

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 5,80 %	■■■■■ Scarso
Perdita max. -15,26 %	■■■■■ Medio
DSR 4,26 %	■■■■■ Medio
Beta bear 0,68	■■■■■ Medio
VAR -1,56 %	■■■■■ Scarso

SRI 1 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe -0,53	■■■■■ Scarso
Information -0,75	■■■■■ Scarso
Ratio (IR) -0,72	■■■■■ Scarso
Sortino -0,72	■■■■■ Scarso
Omega 0,83	■■■■■ Scarso
Calmar -0,20	■■■■■ Scarso

Caratteristiche generali

Tipo	SICAV
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	152,01 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	-6,11 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Nessuno
Rimborso	Nessuno
Gestione	Nessuno
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	2,05 %
Commissioni di Gestione	2,05 %
Costi di Transazione	0,29 %

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Eurizon Diversificato Etico EUR Acc - IT0001052742

NAV

Società	Eurizon Capital SGR SpA
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Obbligazionari misti
Benchmark dichiarato	65% Ethical Index Euro Government Bond 1-3 anni+20% Eth...
Categoria Quantalys	Bilanciati prudenti globale
Benchmark di categoria	25% MSCI World + 75% ICE BofA Global Broad Market
Gestore	Luca Naseddu
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 8

10,66 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

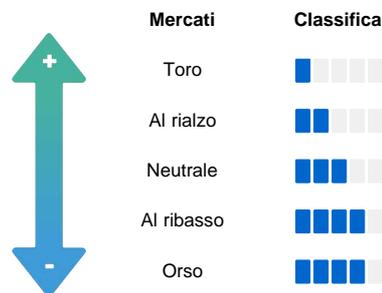


● Eurizon Diversificato Etico EUR Acc ● Bilanc. Prud. Global
● 25% MSCI World + 75% ICE BofA Global Broad Market

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,21 %	-0,07 %
Perf. 4 settimane	0,74 %	1,15 %
Perf. YTD	0,04 %	1,66 %
Perf. 1 anno	3,55 %	6,81 %
Perf. 3 anni	-2,04 %	-0,26 %
Perf. 5 anni	6,41 %	6,20 %
Perf. 8 anni	10,89 %	9,80 %
Perf. 10 anni	15,65 %	16,47 %
Performance annue		
Perf. 2023	5,71 %	6,57 %
Perf. 2022	-9,45 %	-10,90 %
Perf. 2021	3,69 %	4,16 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	-0,49 %	-0,19 %
Volatilità	3,75 %	4,19 %
Sharpe ratio	-0,43	-0,31

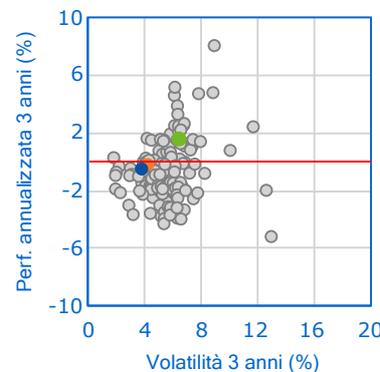
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	443 / 510	4
3 mesi	441 / 505	4
6 mesi	381 / 502	4
YTD	416 / 507	4
1 anno	339 / 485	3
3 anni	191 / 385	2
5 anni	111 / 293	2
8 anni	62 / 180	2
10 anni	57 / 133	2

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 3,75 %	Eccellente
Perdita max. -10,46 %	Buono
DSR 2,76 %	Eccellente
Beta bear 0,54	Buono
VAR -0,94 %	Eccellente

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe -0,43	Scarso
Information Ratio (IR) -0,52	Scarso
Sortino -0,58	Scarso
Omega 0,86	Scarso
Calmar -0,15	Scarso

Caratteristiche generali

Tipo	Fondo
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 31/10/2016	349,78 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	3,88 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Nessuno
Rimborso	Nessuno
Gestione	1 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	1,03 %
Commissioni di Gestione	-
Costi di Transazione	-

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc - LU053303238

NAV

Società	Amundi Asset Management
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Azionari salute
Benchmark dichiarato	MSCI Daily TR World Net Health Care USD
Categoria Quantalys	Azionario salute - farmaceutico
Benchmark di categoria	MSCI World Health Care NR
Gestore	Raphaël Dieterlen, Sébastien Foy
Valutazione ISR globale	SFDR
✗ Non ISR	Articolo 6

477,24 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

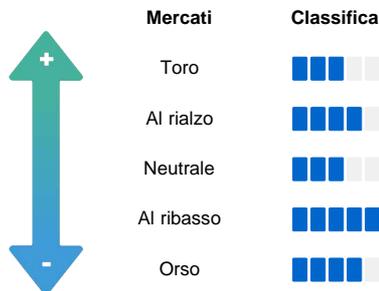


- Amundi MSCI World Health Care UE EUR Acc
- Az. salute - farmaceutico
- MSCI World Health Care NR

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,32 %	-0,22 %
Perf. 4 settimane	-0,37 %	-0,30 %
Perf. YTD	8,01 %	4,81 %
Perf. 1 anno	13,26 %	6,28 %
Perf. 3 anni	34,83 %	6,32 %
Perf. 5 anni	68,40 %	39,39 %
Perf. 8 anni	118,67 %	79,88 %
Perf. 10 anni	196,73 %	135,97 %
Performance annue		
Perf. 2023	-0,13 %	-1,61 %
Perf. 2022	0,47 %	-10,03 %
Perf. 2021	28,52 %	16,15 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	11,72 %	2,17 %
Volatilità	12,99 %	12,22 %
Sharpe ratio	0,82	0,09

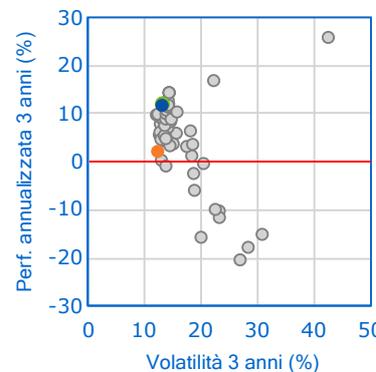
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	104 / 143	3
3 mesi	87 / 143	3
6 mesi	50 / 142	2
YTD	65 / 143	2
1 anno	38 / 139	2
3 anni	15 / 102	1
5 anni	13 / 72	1
8 anni	13 / 50	1
10 anni	9 / 37	1

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 12,99 %	■ Eccellente
Perdita max. -13,49 %	■ Eccellente
DSR 8,37 %	■ Buono
Beta bear 1,03	■ Medio
VAR -3,07 %	■ Buono

SRI

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,82	■ Eccellente
Information Ratio (IR) -0,10	■ Medio
Sortino 1,27	■ Eccellente
Omega 1,38	■ Eccellente
Calmar 0,78	■ Eccellente

Caratteristiche generali

Tipo	ETF
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	711,48 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	7,63 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Mediazione
Rimborso	Mediazione
Gestione	0,4 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,3 %
Commissioni di Gestione	0,3 %
Costi di Transazione	Nessuno

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'eshaustività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Amundi Pioneer Global Equity G EUR C - LU1883833862

NAV

Società	Amundi Luxembourg
Società delegata	Amundi Asset Management US
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Azionari internazionali
Benchmark dichiarato	100% MSCI World
Categoria Quantalys	Azionario globale
Benchmark di categoria	MSCI World NR
Gestore	Marco Pirondini
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 8

8,40 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

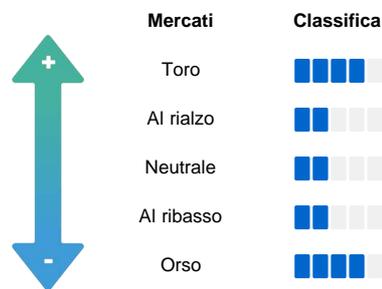


● Amundi Pioneer Global Equity G EUR C ● Az. globale ● MSCI World NR

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,32 %	-0,27 %
Perf. 4 settimane	4,96 %	2,57 %
Perf. YTD	10,95 %	7,87 %
Perf. 1 anno	23,80 %	19,67 %
Perf. 3 anni	37,43 %	19,87 %
Perf. 5 anni	81,50 %	56,01 %
Perf. 8 anni	-	95,77 %
Perf. 10 anni	-	132,07 %
Performance annue		
Perf. 2023	12,97 %	14,19 %
Perf. 2022	-6,84 %	-16,41 %
Perf. 2021	30,87 %	23,23 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	12,34 %	6,49 %
Volatilità	12,24 %	11,69 %
Sharpe ratio	0,92	0,46

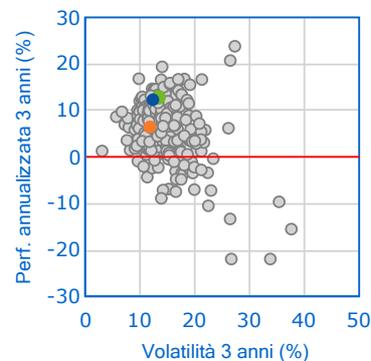
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	662 / 1907	2
3 mesi	706 / 1896	2
6 mesi	765 / 1867	2
YTD	582 / 1906	2
1 anno	952 / 1779	3
3 anni	205 / 1292	1
5 anni	208 / 917	1
8 anni	223 / 605	2
10 anni	166 / 476	2

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 12,24 %	Buono
Perdita max. -13,45 %	Eccellente
DSR 8,24 %	Eccellente
Beta bear 0,91	Medio
VAR -2,75 %	Buono

SRI 1 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe 0,92	Eccellente
Information -0,08	Medio
Ratio (IR) 1,36	Eccellente
Sortino 1,38	Eccellente
Omega 0,83	Eccellente

Caratteristiche generali

Tipo	SICAV
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	65,27 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	42,52 %
Spese massime	
Sottoscrizione	3 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	Nessuno
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	2 %
Commissioni di Gestione	2 %
Costi di Transazione	0,32 %

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.

Scheda identificativa - Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C - LU1882440099

NAV

Società	Amundi Luxembourg
Società delegata	Amundi SGR SpA
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	Flessibili
Benchmark dichiarato	-
Categoria Quantalys	Flessibili globale
Benchmark di categoria	50% MSCI World + 50% ICE BofA Global Broad Market
Gestore	Davide Cataldo
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 8

6,21 EUR

25/03/2024



Serie storica base 100 dal 26/03/2021 al 25/03/2024

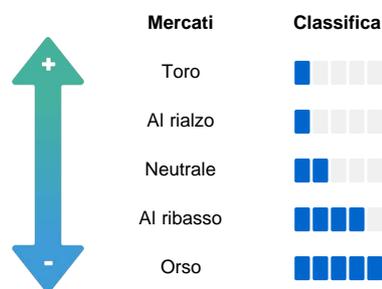


● Amundi Abs Ret Multi-Strategy E2 EUR C ● Fless. Global
● 50% MSCI World + 50% ICE BofA Global Broad Market

Performance

Perf. 25/03/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	-0,22 %	-0,11 %
Perf. 4 settimane	1,06 %	1,70 %
Perf. YTD	1,75 %	3,64 %
Perf. 1 anno	3,57 %	9,71 %
Perf. 3 anni	-6,49 %	5,03 %
Perf. 5 anni	3,40 %	18,29 %
Perf. 8 anni	4,34 %	28,75 %
Perf. 10 anni	6,98 %	38,00 %
Performance annue		
Perf. 2023	-0,54 %	7,64 %
Perf. 2022	-8,13 %	-12,07 %
Perf. 2021	0,53 %	9,84 %
Dati 3 anni al 29/02/2024		
Perf. annua	-2,85 %	1,52 %
Volatilità	4,92 %	6,25 %
Sharpe ratio	-0,81	0,06

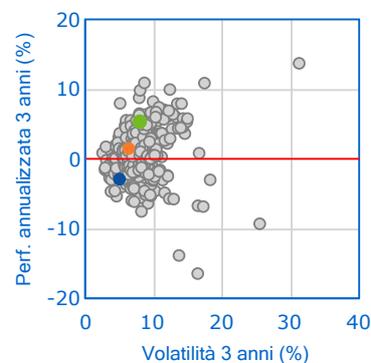
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 29/02/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	1252 / 1687	3
3 mesi	995 / 1673	3
6 mesi	864 / 1645	3
YTD	1234 / 1679	3
1 anno	1432 / 1608	4
3 anni	1187 / 1306	4
5 anni	858 / 1033	4
8 anni	586 / 662	4
10 anni	488 / 549	4

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 4,92 %	Eccellente
Perdita max. -16,81 %	Medio
DSR 3,69 %	Eccellente
Beta bear 0,30	Eccellente
VAR -1,18 %	Eccellente

SRI 1 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe -0,81	Pessimo
Information -1,13	Pessimo
Ratio (IR) -1,08	Pessimo
Sortino 0,76	Pessimo
Omega -0,23	Pessimo

Caratteristiche generali

Tipo	SICAV
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 25/03/2024	233,76 M
Variatione dell'AUM 3 mesi	-11,30 %
Spese massime	
Sottoscrizione	4 %
Rimborso	Nessuno
Gestione	Nessuno
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	1,35 %
Commissioni di Gestione	1,35 %
Costi di Transazione	1,03 %

© 2024 Quantalys. Le informazioni contenute su questa scheda sono di proprietà di Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità, né l'esclusività. Quantalys fornisce la presente scheda fondo esclusivamente a titolo indicativo. Essa non costituisce da parte di Quantalys un'offerta di acquisto, di vendita, di sottoscrizione o di servizio finanziario, né una sollecitazione all'acquisto di nessun prodotto di investimento. Leggere il prospetto del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative delle performance future. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 29/02/2024. Tutte le performance e i dati relativi sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nei casi di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro.