

Processo Costruzione
Portafoglio modello

Strumenti di Portafoglio



Modalità drifting weight: quote costanti

Modalità fixed weight: percentuali costanti

Steps da seguire per la costruzione:

- 1 Selezione dati: scelta degli asset sottostanti il portafoglio
- 2 Benchmark: assegnazione al portafoglio di un indice di riferimento (opzionale)
- 3 Dettagli portafoglio: costruzione del portafoglio

Selezione Rapporti Selezione **1** Selezione Dati Benchmark Dettagli Portafoglio

Model Portfolio - Selezione Dati

Tipo di Investimento: Fondi comuni italiani Selezione per: Categoria Visualizza: FC Az. America

Cerca: Nome Fondo Cerca

Selezione

- BA+ Investimenti-Cerro Torre EUR
- BA+ Investimenti-Eiger EUR
- Antonveneta Abn Amro-Master Azionario America EUR
- Bg Sgr Spa-Generali American Value EUR
- Bim Intermobil Sgr Spa-Azionario Usa EUR
- Bipitalia Gestioni Sgr-Henderson America EUR
- Bnl Gestioni Sgr-Azioni America EUR

Selezione personale

- Aletti-Gestiele America EUR**
- Anima-America EUR
- Arca-Arca Azioni America EUR
- Bipiemme Gest. Sgr Spa-Americhe EUR

Selezione Rapporti Selezione **2** Portafoglio Selezione Dati Benchmark Dettagli Portafoglio

Model Portfolio - Selezione D

Tipo di Investimento: Indici Selezione per: Fornitore Visualizza: Altri Az. Borse Intern.

Cerca: Nome Fondo Cerca

Selezione

- Giappone Tokio Topix
- Singapore Straits Times
- Taiwan Weighted
- USA Nasdaq Biotech

Selezione personale

- 3 In “Dettagli Portafoglio” viene definita l’anagrafica di portafoglio, ovvero nome, valuta, eventuale commento e tipologia dello stesso (Drifting e Fixed Weight).

Selezione Rapporti | Seleziona Portafoglio | Selezione Dati | Benchmark | **Dettagli Portafoglio** | Disconnetti | Supporto

Model Portfolio - Dettagli Portafoglio Database aggiornato al: 14/11/2007

3

— Dettagli Portafoglio

Nome : portf test Valuta : Euro (EUR) Fattore di Riduzione annuale (%) : 0

Commenti:

Benchmark: --

Drifting Weight Fixed Weight

- 4 Salvataggio dell’anagrafica di portafoglio



Salva: per salvare le informazioni di anagrafica sopra elencate

- 5 Assegnazione delle date di asset allocation, asset sottostanti, assegnazione dei pesi agli asset

Modifica

Aggiungi Titolo Rimuovi Titolo

Annulla Salva Pesi

11/01/2007 Aggiungi Data Rimuovi Data

Ribilancia

- 5 Data di asset allocation: definizione della data di creazione portafoglio ed eventuali date successive di asset allocation

Modifica

Aggiungi Titolo

Investimento Data Partenza 11/01/2006

11/01/2006 Aggiungi Data

http://mmia.money...

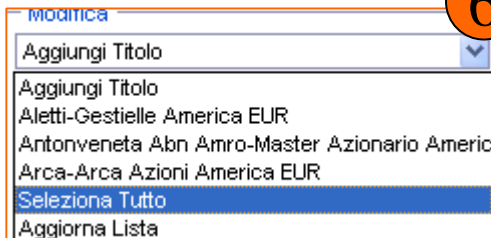
January 2006

Sun	Mon	Tue	Wed	Thu	Fri	Sat
25	26	27	28	29	30	31
1	2	3	4	5	6	7
8	9	10	11	12	13	14
15	16	17	18	19	20	21
22	23	24	25	26	27	28
29	30	31	1	2	3	4

OK Cancell

- Definisco la data attraverso il calendario;
- Cliccare su “aggiungi data”

6 Aggiungi titolo: cliccare su "seleziona tutto" per assegnare gli asset sottostanti il portafoglio



7 Assegnazione dei pesi ai singoli asset in modo che la somma sia 100% (pesi da inserire senza il simbolo %)

Investment	Start Date	11/01/2006	05/04/2006	13/09/2006	02/01/2007	07/03/2007
Aletti-Gestielle America EUR	18/09/1995	30.00	35.00	30.00	28.00	28.00
Antonveneta Abn Amro-Master Azionario America EUR	02/01/2004	45.00	42.00	42.00	37.00	37.00
Arca-Arca Azioni America EUR	10/03/1995	25.00	23.00	23.00	23.00	23.00
BlackRock-A2 MLIF US Opportunities EUR	29/06/2001	0.00	0.00	5.00	8.00	10.00
Euro (EUR)	31/12/1998	0.00	0.00	0.00	4.00	2.00
		100	100	100	100	100

Salvataggio dei pesi

Inserimento dei pesi

8 Il portafoglio ora è disponibile nei moduli “Performance” e “Analisi del rischio” per poter effettuare tutte le analisi quantitative e grafiche

Seleziona Rapporti | Selezione Dati | Intervallo Temporale | Opzioni dei Rapporti

Performance - Seleziona Dati

Tipo di Investimento:
 Portafoglio modello - Drifting Weight

Cerca: Nome Fondo

Selezione

- Asset Global20
- az fund
- azimut
- azionario europa
- BMK COMPOSITO CENTO

Performance

	1 Mese : 13/11/2007	Ultimo anno : 13/11/2007	1 Anno : 13/11/2007
portf test	-7.70%	-5.67%	-6.10%

- 9 Cliccare sul nome del portafoglio per avere un report di portafoglio predefinito

MoneyMate® interactive

Portfolio Overview | **Portfolio Report** | Supporto

Fact Sheet - Portfolio Overview Database aggiornato al: 14/11/2007

Visualizza come PDF | Salva | Versione Stampabile Chiudi

Home del Portafoglio: portf test **Valuta:** EUR

Home Benchmark: --

Commenti:

Top 10 Holdings	%	Perf Ann		Dev Std Ann		Sharpe Ann	
		1Y	3Y	1Y	3Y	1Y	3Y
As at: 14/11/2007							
portf test	--	-6.50%	--	10.82	--	-0.88	--
Antonveneta Abn Amro-Master Azionario Am	45.24%	-5.02%	1.46%	9.64	10.10	-0.84	-0.15
Aletti-Gestielle America EUR	29.64%	-7.42%	1.00%	11.88	10.57	-0.88	-0.18
Arca-Arca Azioni America EUR	25.12%	-8.02%	2.08%	12.15	10.56	-0.91	-0.08

*Un coefficiente di remunerazione annuale senza rischio del 3.5% usato per i test Sharpe.

Dati di Performance		Al: 14/11/2007	
1 Settimana	-1.68%	4 anni	--
1 Mese	-7.70%	5 anni	--
3 Mesi	-3.75%	6 anni	--
Ultimo trimestre	-6.52%	7 anni	--
6 mesi	-7.91%	8 anni	--
Ultimo anno	-5.67%	9 anni	--
1 anno	-6.50%	10 anni	--

Dati di Performance		11/01/2006 A: 14/11/2007	
5.00%			
0.00%			
-5.00%			