

Processo Costruzione
Portafoglio reale



Portafoglio Reale

Costruzione di un portafoglio "by trades" con la gestione anche della liquidità

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)
- **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: Categorie Visualizza: FC Az. America

Cerca: _____ Nome Fondo [v] Cerca

Selezione

- BA - Investimenti-Carro Torno EUR
- BA - Investimenti-Cigar EUR
- Antonveneta Abn Amro-Master Azionario America EUR
- Bg Sgr Spa-General American Value EUR
- Bin Intermodal Sgr Spa-Azionario Usa EUR
- Bigalle Gestioni Sgr-Henderson America EUR
- Bnl Global Soc.Azionario America EUR

Selezione personale

- Altri-Gestioni America EUR
- Anima-America EUR
- Arca-Arca Azioni America EUR
- Diplenne Gest.Sgr Spa-Americhe EUR

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

Model Portfolio - Selezione Dati

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

Cerca: _____ Nome Fondo [v] Cerca

Selezione

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

Selezione personale

3 In “Dettagli Portafoglio” viene definita l’anagrafica di portafoglio, ovvero nome, valuta, eventuale commento, gestione della liquidità e vengono successivamente inseriti i trades

Dettagli Portafoglio

Nome: port test real Valuta: Euro (EUR) Benchmark: --

Commenti:

Utilizza Gestione Liquidità Utilizza le Corporate Action importate dal Cliente

Salva

4 Mettere la spunta se si inseriscono operazioni di liquidità (ad es. versamento di cash, prelievo, ecc)

5 Salvataggio dell’anagrafica di portafoglio

5 Salva: per salvare le informazioni di anagrafica sopra elencate

6 Inserimento della liquidità: data di riferimento dell'operazione di liquidità, si definisce l'operazione e si inserisce l'ammontare

7 Salvataggio

Nome del Portafoglio port test real Attuale Liquidità 0.00 EUR

Data: 14/03/2006 Azione: Put Cash Ammontare: 200000

Nessuna Transazione

Data	Azione	Ammontare	Modifica	Elimina
14/03/2006	Put Cash	200,000.00		

Salvataggio delle operazioni di liquidità

8

Dettagli portafoglio: per inserire un "trade" è necessario definire la data della transazione, il tipo di operazione, l'ammontare o la quantità e poi salvarlo

Per ammontare

Crea/Modifica Transazione

Data	Investimento	Azione	Quantità	Ammontare	Prezzo (EUR)	Fee (EUR)
14/03/2006	Aletti-Gestiele America EUR	Compra	0	20500		

Nessuna Transazione

Salva

Per quantità

Crea/Modifica Transazione

Data	Investimento	Azione	Quantità	Ammontare	Prezzo (EUR)	Fee (EUR)
14/03/2006	Arca-Arca Azioni America EUR	Compra	1500	0.00		

Salva

Salvataggio delle transazioni

9

Registrazione di tutti i trades

Data	Investimento	Azione	Quantità	Ammontare	Prezzo	Tasso di cambio	Fec
29/12/2006	Edmond De Rothschild A. M. Saint-Honoré Tam Plus	Hold	195.000	--	182.0874 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	JPM-A Global Convertible Fund Acc EUR	Hold	4.290.330	--	11.4006 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C European Equity Alpha Acc EUR	Hold	2.872.810	--	38.8957 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	JPM-C Euro Enhanced Yield EUR	Hold	11.075	--	11.212.1602 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Invesco CE Funds-J Enhanced Cash Hedge EUR	Hold	1.324.284	--	108.9446 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Axa Rosenberg Alpha-B Eurobloc Equity EUR	Hold	6.266.488	--	10.7000 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Fortis Inv Management-C Bond Convertible World EUR	Hold	1.020.431	--	119.9495 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Credit Suisse-Bond Fund Convert Europe EUR	Hold	6.268.524	--	11.7685 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Fortis Inv Management-Absolute Return Bond Euro EUR	Hold	188.339	--	104.7285 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C Euro Liquidity Acc EUR	Hold	406.980	--	112.3893 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C Euro Dynamic Growth Acc EUR	Hold	15.691.110	--	3.8624 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C Euro Equity Acc EUR	Hold	2.442.870	--	26.8900 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C Italian Equity Acc EUR	Hold	2.277.040	--	40.9611 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-I Dynamic Reserve Acc EUR	Hold	1.677.790	--	21.9566 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Bnp Paribas-Parvest European Converging Bond EUR	Hold	1.838.442	--	121.9069 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Dws Investment SA-Forex Strategy EUR	Hold	758.695	--	109.3691 EUR	1.0000	--ModificaElimina
29/12/2006	Schroder-C Euro Active Value Acc EUR	Hold	5.330.340	--	41.3721 EUR	1.0000	--ModificaElimina
11/01/2007	JPM-A Global Convertible Fund Acc EUR	Compra	808.819	--	12.0300 EUR	1.0000	--ModificaElimina
11/01/2007	Bnp Paribas-Parvest European Converging Bond EUR	Compra	375.312	--	133.1900 EUR	1.0000	--ModificaElimina
11/01/2007	Fortis Inv Management-C Bond Convertible World EUR	Compra	438.226	--	126.3000 EUR	1.0000	--ModificaElimina
11/01/2007	Schroder-C Euro Liquidity Acc EUR	Vendi	331.520	--	112.8900 EUR	1.0000	--ModificaElimina
11/01/2007	JPM-C Euro Enhanced Yield EUR	Vendi	2.899	--	11.276.1700 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Edmond De Rothschild A. M. Saint-Honoré Tam Plus	Vendi	53.000	--	183.7100 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Schroder-C European Equity Alpha Acc EUR	Vendi	64.370	--	49.1000 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Invesco CE Funds-J Enhanced Cash Hedge EUR	Vendi	359.503	--	107.7100 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Axa Rosenberg Alpha-B Eurobloc Equity EUR	Vendi	194.854	--	11.4600 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Credit Suisse-Bond Fund Convert Europe EUR	Vendi	1.277.816	--	12.3600 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Schroder-C Euro Dynamic Growth Acc EUR	Vendi	369.500	--	4.5100 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Schroder-C Euro Equity Acc EUR	Vendi	44.740	--	28.8000 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Schroder-C Italian Equity Acc EUR	Vendi	34.100	--	46.2100 EUR	1.0000	--ModificaElimina
12/01/2007	Schroder-C Euro Active Value Acc EUR	Vendi	96.810	--	46.1700 EUR	1.0000	--ModificaElimina

Il portafoglio ora è stato creato ed è disponibile per essere analizzato:

10

Nel modulo "Portafoglio Reale" per ottenere un riepilogo dei portafogli inseriti

Selezione Rapporti | **Seleziona Portafoglio** | Disconnetti | Supporto

Model Portfolio - Seleziona Portafoglio | Database aggiornato al: 15/11/2007

[Nuovo Portafoglio](#)

Riepilogo del Portafoglio

Nome del Portafoglio	1 Mese	3 Mesi	VTD	1 anno	Dalla data di avvio	Volatilità Annualizzata	Valore dell'Investimento	Utile/Perdita	
sempor	-0.76%	28.05%	--	--	-23.73%	--	6,252.19	-1,945.64	Modifica
8000000000	-1.62%	-1.24%	--	--	-0.94%	--	1,654.29	-15.62	Modifica
bosell	0.00%	278.08%	2,925.66%	--	2,925.66%	--	896.50	896.50	Modifica
bosell1	-7.76%	-3.69%	-0.59%	--	-0.59%	--	82,607.05	-3,028.80	Modifica
Dividend2	0.64%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	117.87	7.87	Modifica
aw	-3.83%	-4.10%	--	--	-4.28%	--	9,572.11	-427.89	Modifica
ichfde1rdw	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	Modifica
ONE	0.50%	0.60%	0.40%	0.60%	0.75%	1.19	201.18	1.18	Modifica
papierino	0.39%	-0.04%	-0.39%	-0.65%	0.59%	1.95	13,990.27	1,103.70	Modifica
polizza	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	1,800,000.00	0.00	Modifica
port criscuolo priv banker	-1.49%	5.01%	7.47%	10.49%	148.18%	10.09	248.18	148.18	Modifica
port priv banker CARMIGNAC 1	-0.35%	3.72%	2.01%	4.42%	107.27%	8.11	207.27	107.27	Modifica
port priv banker CARMIGNAC 2 REIL	0.22%	2.00%	2.53%	3.29%	38.18%	2.44	138.18	38.18	Modifica
port quant 10	-0.24%	0.33%	1.24%	1.42%	8.54%	1.35	1,685.71	70.18	Modifica
port test real	-1.23%	-0.29%	-0.73%	-0.91%	-0.95%	2.22	198,099.69	-1,900.31	Modifica
port active 30	-1.63%	1.07%	2.58%	4.10%	9.83%	4.43	955.63	67.38	Modifica

Cliccare sul nome del portafoglio per ottenere un report dello stesso

Cliccare su modifica per modificare i trades

11

Il portafoglio è anche disponibile nei moduli “Performance” e “Analisi del rischio”, dove è possibile effettuare tutte le analisi quantitative e grafiche

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

Analisi del Rischio - Seleziona Dati

Tipo di Investimento:
 Portafoglio Reale

Cerca: None Fondo

Seleziona

- advisor
- axxxxxxxxx
- boselli
- boselli1
- Dividend2
- ew

Analisi del Rischio - 15/11/2006 A: 15/11/2007 - Settimanale - Allineato alla data inizio
 Benchmark - MSCI The World Index

	Perf	Dev Std	VaR	Sharpe	Tracking Error
port test real	-1.13%	0.268	-0.54%	-0.327	1.328

12

Infine, da questi moduli, cliccando sul nome del portafoglio è possibile ottenere un report predefinito dello stesso

MoneyMate interact

Portafoglio Overview | **Portafoglio Report** | Supporto

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

Visualizza come PDF | Salva | Versione Stampabile

Nome del Portafoglio: port test real **Valuta:** EUR

Nome Benchmark: --

Commenti

Top 10 Holdings	%	Perf Ann		Dev Std Ann		Sharpe Ann	
		1Y	3Y	1Y	3Y	1Y	3Y
As at: 14/11/2007							
port test real	--	-0.91%	--	2.22	--	-1.95	--
Aletti-Gestible America EUR	9.59%	-5.69%	1.63%	11.38	10.17	-0.75	-0.13
Bg Sgr Spa-Generali American Value EUR	9.33%	-3.47%	3.56%	11.16	10.36	-0.57	0.06

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

Dati di Performance		Al: 14/11/2007	
1 Settimana	0.04%	4 anni	--
1 Mese	-1.23%	5 anni	--
3 Mesi	-0.25%	6 anni	--
Ultimo trimestre	-1.01%	7 anni	--
6 mesi	-1.21%	8 anni	--
Ultimo anno	-0.73%	9 anni	--
1 anno	-0.91%	10 anni	--
2 anni	--	15 anni	--
3 anni	--	Dalla data di	-0.57%

Dati di Performance		14/03/2006 A: 15/11/2007	