

Manuale Indici

INDICE

1. Introduzione.....	pag. 3
2. Principali Categorie.....	pag. 4
3. FAQ.....	pag. 10
4. Glossario.....	pag. 11
5. Principali Indici.....	pag. 12

1. INTRODUZIONE

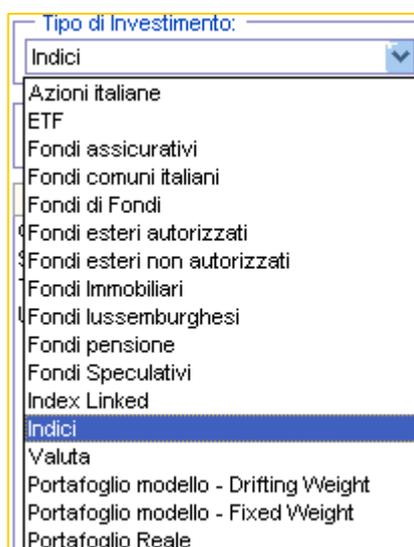
Gentile Cliente,

la presente guida ha lo scopo di aiutarla ad individuare le innumerevoli tipologie di indici presenti in MoneyMate.

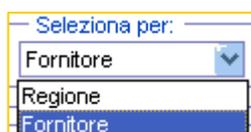
Il database MoneyMate distribuisce ai propri Clienti indici di mercato e dei maggiori provider mondiali.

Tali indici sono disponibili tra le tipologie di investimento da selezionare sui quali è possibile effettuare tutte le relative analisi.

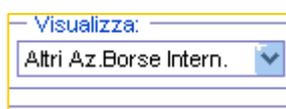
Modulo Performance: tra le tipologie di investimento disponibili nel database MoneyMate viene scelto l'asset "Indici"



Seleziona per: il filtro per la selezione degli indici può essere effettuata per "Regione" o per "Fornitore"



Visualizza: si sceglie di quale fornitore o di quale regione visualizzare tali indici



La scelta degli indici per “Fornitore”: vengono elencati tutti i provider mondiali dei quali MoneyMate distribuisce tali indici (JPMorgan, Merrill Lynch, Morgan Stanley, FTSE, Fideuram, ecc) e i maggiori indici di mercato (S&P Mib, S&P 500, CAC 40, ecc)

Altri Az.Borse Intern.
Az.Europa
Az.Italia Comit
Az.Italia Mib
Financial Times
FTSE International
Inflazione
J.P. Morgan Bond
Merrill Lynch
Monetari
Morgan Stanley
Other
Paesi Emergenti
Reddito Fisso Europa
Reddito Fisso Italia
Set.Fndi Ita.Fideuram
Set.Fndi Ita.Generali
Set.Fndi Ita.RAM Pond
Set.Fndi Ita.RAM Semp

2. PRINCIPALI CATEGORIE

Altri Az. Borse Intern.: sono presenti i seguenti 4 indici mondiali non riconducibili ad alcun specifico provider

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

Az. Europa: elenco di alcuni indici Dow Jones

Selezione
D.Jones Euro Stoxx
D.Jones Stoxx
X-EBCI 5
X-EBCI 9

Az. Italia Comit: indici Comit della Borsa Italiana

Selezione
Comit 30
Comit Globale
Comit Globale(R)
Comit Performance
Comit Performance(R)
Comit Assicurativi
Comit Bancari
Comit Finanziari
Comit Immobiliari
Comit Industriali
Comit Telecom. e Serv.
Comit Alim. e Gr.Distr.
Comit Auto Gomma

Az. Italia Mib: elenco degli indici azionari della Borsa Italiana

Selezione
All Star
All Star vwap
Indice S&P/Mib
MIB 30
MIB Mibtel
MIB Rnc
MIB Storico
MIB Storico Aliment-Agric
MIB Storico Assicurative
MIB Storico Bancharie
MIB Storico Cartarie-Edito
MIB Storico Cem-Ceram-f
MIB Storico Chim-Idroc-G

Financial Times: elenco di tutti i maggiori indici di mercato mondiali e di tutti gli altri indici non riconducibili a provider specifici (Nasdaq 100, Indici Citigroup, Indici Russell, S&P 500, ecc)

Selezione
Amsterdam AEX
Argentina - Merval
AUSTRALIA - ALL OR
Australia - S&P/ASX 3
Australia All Ord
Austria - ATX
Baltic 30 index
Belgium BEL 20
Brazil - IBOVESPA
CAF Cash - investors
CAF Fixed Rate Select
CAF Gold - investors u
CAN Montreal Portfolio

FTSE International:elenco degli indici FTSE

Seleziona
FT-S&P Europa/Gbp (
FTSE 100 (TR)
FT-SE 100 Share Inde
FTSE 250 (TR)
FTSE 250 ex Inv Tr (T
FTSE 350 (TR)
FT-SE 350 Index
FT-SE AIM Index
FTSE All Indonesia (C
FTSE All Philippines (C
FTSE All Share
FTSE All Thailand (Cld
FTSE All-Share (TR)

Inflazione: indice dei prezzi al consumo

Seleziona
Ital. Prezzi al consumo

J.P Morgan Bond: elenco di alcuni indici obbligazionari JPMorgan

Seleziona
J.P. Morg. Australia
J.P. Morg. Belgium
J.P. Morg. Canada
J.P. Morg. Denmark
J.P. Morg. France
J.P. Morg. Germany
J.P. Morg. Ireland
J.P. Morg. Italy
J.P. Morg. Japan
J.P. Morg. Netherlands
J.P. Morg. New Zealand
J.P. Morg. Spain
J.P. Morg. Sweden

Merrill Lynch: elenco indici Merrill Lynch espressi in valute diverse

Seleziona
Euro Government Bill Inde
ML Australian Governme
ML Australian Governme
ML Australian Governme
ML British Pound LIBOR C
ML British Pound LIBOR C

Monetari: elenco tassi di interesse monetari (Euribor e Libor)

Selezione
Eonia
Eonia base 100
Eonia TR
Euribor 1 mese
Euribor 1 mese TR
Euribor 1 settimana
Euribor 1 settimana TR
Euribor 2 mesi
Euribor 2 mesi TR
Euribor 3 mesi
Euribor 3 mesi TR
Euribor 4 mesi
Euribor 4 mesi TR

Morgan Stanley: elenco dei maggiori indici azionari MorganStanley suddivisi per Paese ed espressi in valute diverse (local currency, Euro, Dollaro, ecc).

Selezione
MSCI AC Americas
MSCI AC Americas (Gross
MSCI AC Americas USD
MSCI AC Americas USD (G
MSCI AC Asia
MSCI AC Asia Ex Japan
MSCI AC Asia Ex Japan (N
MSCI AC Asia Ex Japan US
MSCI AC Asia Ex Japan US
MSCI AC Asia Free Ex Jap
MSCI AC Asia Free Ex Jap
MSCI AC Asia Pac Ex Japa
MSCI AC Asia Pac Free Ex

All'interno di tale elenco è possibile trovare:

Indici AC: all country ovvero vengono inclusi tutti gli indici dei paesi sviluppati e dei mercati emergenti (sono inclusi 27 paesi)

Indici EAFE: Europa, Australia, Asia e Far East esclusi USA e Canada

Indici EASEA: sono gli indici EAFE senza considerare il Giappone

Indici EM: emerging market ovvero vengono inclusi tutti gli indici dei paesi emergenti

Indici FREE: tutti gli indici azionari internazionali sono aggiustati per "flottante" ovvero per la quantità di azioni emesse da una società quotata che un investitore può liberamente commerciare nel mercato secondario.

Indici EMU: sono inclusi gli indici dei Paesi appartenenti all'Unione Economica/Monetaria Europea

Indici BRIC: vengono inclusi i seguenti Paesi dei mercati emergenti Brasile, Russia India e Cina

Indici WORLD: sono indici di mercati azionari che includono 23 Paesi sviluppati; tali Paesi sono Australia, Austria, Belgio, Canada, Danimarca, Finlandia, Francia, Germania, Grecia, Hong Kong, Irlanda, Italia, Giappone, Olanda, Nuova Zelanda, Norvegia, Portogallo, Singapore, Spagna, Svezia, Svizzera, UK e USA.

Indici COUNTRY: sono gli indici di un determinato Paese (indicato nel nome) costruito considerando tutti i valori mobiliari di mercato con un "f flottante adeguato" classificati secondo gli standard GICS

Other: elenco indici IRS (Interest Rate Swap)

Selezione
IRS 10Y
IRS 11Y
IRS 12Y
IRS 15Y
IRS 1Y
IRS 20Y
IRS 25Y
IRS 2Y
IRS 30Y
IRS 3Y
IRS 40Y
IRS 4Y
IRS 50Y

Paesi Emergenti: indici obbligazionari Paesi emergenti del Sole 24 Ore e di Unicredit Banca Mobiliare

Selezione
Sole UBM-EMI Argentina
Sole UBM-EMI Brasile
Sole UBM-EMI Bulgaria
Sole UBM-EMI Croazia
Sole UBM-EMI First Wave
Sole UBM-EMI Glob.Large
Sole UBM-EMI Global
Sole UBM-EMI High Beta
Sole UBM-EMI Latin
Sole UBM-EMI Messico
Sole UBM-EMI New Europe
Sole UBM-EMI Non Latin
Sole UBM-EMI Polonia

Reddito Fisso Europa: elenco di alcuni indici Sole 24 Ore

Selezione
24Ore-Uni Emu6 fx gen.
24Ore-Uni Emu6 CCT
24Ore-Uni Emu6 fx +CCT
24Ore-Uni Emu6 fx > 11y
24Ore-Uni Emu6 fx 1-3y
24Ore-Uni Emu6 fx 3-5y
24Ore-Uni Emu6 fx 5-7y
24Ore-Uni Emu6 fx 7-11y

Reddito Fisso Italia: elenco indici monetari MTS

Selezione
MTS T.Fisso Generale
MTS T.Fisso Breve Trm.
MTS T.Fisso Lungo Term.
MTS T.Fisso Medio Trm.
MTS Tasso monetario
MTS Tasso variabile
MTS xB.It(Lrd) Generale
MTS xB.It(Lrd) Ind.BOT
MTS xB.It(Lrd) Ind.BTP
MTS xB.It(Lrd) Ind.CCT
MTS xB.It(Lrd) Ind.CTZ
X-B.Ita (Ntt) Generale
X-B.Ita (Ntt) Ind.BOT

Set. Fndi Ita. Fideuram: elenco indici Banca Fideuram dei Fondi Comuni di Investimento

Selezione
Fid. Fdi Az.Settoriali
Fid. Fdi Azionari
Fid. Fdi Bilanciati
Fid. Fdi Generale
Fid. Fdi Liquidita'
Fid. Fdi Obbligaz.
Fid. Flessibili
Fid. Ob.Ar.Dollaro
Fid. Az.Altre Spec.
Fid. Az.Altri Settori
Fid. Az.America
Fid. Az.Area Euro
Fid. Az.Europa

Set. Fndi Ita. Generali: elenco indici Banca Generali che non sono più aggiornati in quanto non più alimentati dalla Banca stessa

Selezione
Gen. Az.Altre Special.
Gen. Az.Altri Settori
Gen. Az.America
Gen. Az.Area EURO
Gen. Az.Beni di Consumo
Gen. Az.Ener.e M.Prime
Gen. Az.Europa
Gen. Az.Finanza
Gen. Az.Industria
Gen. Az.Informatica
Gen. Az.Internaz.(TS)
Gen. Az.Italia
Gen. Az.Pacifico

Set. Fndi Ita. RAM Pond/Semp: elenco indici calcolati da RAM (ex Ras Asset Management) che non sono più aggiornati in quanto la Banca stessa ha deciso di sospenderli

Selezione	Selezione
X-RAM(s) Az.Alt.Special.	RAM(p) Az.Alt.Special.
X-RAM(s) Az.Altri Settori	RAM(p) Az.Altri Settori
X-RAM(s) Az.America	RAM(p) Az.America
X-RAM(s) Az.Area Euro	RAM(p) Az.Area Euro
X-RAM(s) Az.Beni di Cons.	RAM(p) Az.Beni di Cons.
X-RAM(s) Az.En. e M.Prime	RAM(p) Az.En. e M.Prime
X-RAM(s) Az.Europa	RAM(p) Az.Europa
X-RAM(s) Az.Finanza	RAM(p) Az.Finanza
X-RAM(s) Az.Industria	RAM(p) Az.Industria
X-RAM(s) Az.Informatica	RAM(p) Az.Informatica
X-RAM(s) Az.Inter(NTT)	RAM(p) Az.Internaz.(TS)
X-RAM(s) Az.Internaz.(TS)	RAM(p) Az.Italia
X-RAM(s) Az.Italia	RAM(p) Az.Pacifico

3. FAQ

In MoneyMate esistono gli indici Morgan Stanley?

Si esistono e sono preceduti dalla dicitura MSCI. Inoltre è importante sapere che ci sono solo le versioni in dollari in quanto MoneyMate integra anche le serie storiche dei tassi di cambio MSCI, quindi prendendo l'indice in dollari e impostando l'analisi in euro otterremo esattamente la versione in euro dell'indice.

Che differenza c'è tra un indice "local" ed uno in "Currency"?

L'indice local esprime la somma dei rendimenti di tutti i titoli del paniere nella valute di origine. Un indice in currency invece è espresso in una singola valuta cioè tutti i titoli prima di essere inclusi nel rendimento dell'indice vengono convertiti nella valuta di riferimento. Chiaramente è sconsigliato l'utilizzo di un indice in local currency.

Quali indici è meglio utilizzare?

L'utilizzo è funzione della tipologia di analisi, in generale possiamo dire che gli indici Total Return sono quelli più corretti in quanto incorporano i rendimenti delle corporate action e sono quindi coerenti con quello che avviene in genere nei fondi e nei portafogli. Per quanto riguarda il mondo obbligazionario è necessario considerare la tipologia di bond (Corporate o Government) e soprattutto le differenti scadenze e scegliere indici omogenei.

E' possibile simulare l'andamento di un titolo obbligazionario?

Considerata la numerosità e la vastità del database obbligazionario di MoneyMate, gli utenti possono tranquillamente inserire nei portafogli gli indici bond come proxy dei titoli obbligazionari.

Qual'è il modo più semplice per individuare un indice di mercato di un Paese?

La regola MoneyMate a riguardo è di far precedere agli indici di mercato il nome del paese di origine (in inglese), quindi se l'indice ricercato è quello della borsa giapponese allora basta cercare Japan

4. GLOSSARIO

Closed: indice non più esistente

X-: posta davanti al nome dell'indice significa che l'indice è chiuso

Net TR: netto delle tasse del Paese di origine del titolo e total return

Gross TR: al lordo delle tasse del Paese di origine del titolo e total return

TR: total return ossia comprensivo dei dividendi staccati

Duplicated: duplicazione di indice da non usare

R: return

Weighted: pesato

LCL : indica gli indici in Local Currency cioè quegli indici non espressi in una valuta specifica ma è la "somma" dei rendimenti dei differenti titoli nelle valute di origine.

5. PRINCIPALI INDICI

I Principali **indici azionari** presenti in MoneyMate sono di seguito riportati.
Per individuarli basta fare una ricerca per nome utilizzando le seguenti denominazioni:

Mondiali

MSCI The World Index
FTSE World Index
DJ World

USA

USA S&P Composite 500
NASDAQ
FTSE Americas
Nasdaq 100

Europa/Euro

DJ EURO STOXX 50(EUR)(TR)
MSCI Euro
MSCI Europe
DJ EURO STOXX(EUR)

Principali Paesi Europa

Austria - ATX
Belgium BEL 20
Denmark - OMXC 20
Finland Hex All-Share
France Cac 40
FTSE UK
Germany Dax
Greece - ATHEX Composite
Indice S&P/Mib
Ireland - ISEQ Overall
LUXEMBOURG - LUX.S.E.GENERAL
Norway - OSE OBX
Poland - WIG 20
PORTUGAL - BVL GENERAL
Russia RTS
Spain Madrid SE IBEX35

Sweden - OMXS 30
Switzerland Swiss Mkt

Mercati Asia

China - Shanghai SE Composite
Hong Kong - Hang Seng China Enterprises
India BSE
Japan - TOPIX 100
Japan Nikkei 225
Japan Tokyo Stock Ex
MSCI China
Pakistan - KSE 100
Singapore SGX All Share
Taiwan - TAIEX

I principali **indici Obbligazionari e Monetari** sono:

Monetari

Eonia base 100
Euribor 1 mese TR
Euribor 3 mesi TR
Euribor 6 mesi TR
Libor 1 mese TR
Libor 3 mesi TR
Libor 6 mesi TR
Liquidity Zero Return Index
JPMorgan EMU Cash - 1 mth (EUR)
JPMorgan EMU Cash - 12 mth (EUR)
JPMorgan EMU Cash - 3 mth (EUR)
JPMorgan Global (GBI) Cash - 1 mth (USD)
JPMorgan Global (GBI) Cash - 12 mth (USD)
JPMorgan Global (GBI) Cash - 3 mth (USD)
JPMorgan USA Cash - 1 mth (USD)
JPMorgan USA Cash - 12 mth (USD)
JPMorgan USA Cash - 3 mth (USD)
JPMorgan USA Cash - 6 mth (USD)

Titoli Governativi Italiani

MTS T.Fisso Breve Trm.
MTS T.Fisso Generale
MTS T.Fisso Lungo Term.
MTS T.Fisso Medio Trm.
MTS Tasso monetario
MTS Tasso variabile
MTS xB.It(Lrd) Generale
MTS xB.It(Lrd) Ind.BOT
MTS xB.It(Lrd) Ind.BTP
MTS xB.It(Lrd) Ind.CCT

Titoli Governativi Mondo

I titoli governativi emessi dai differenti Paesi sono coperti dagli indici JPMorgan corrispondenti.

Titoli Corporate

I titoli corporate sono coperti da Merrill Lynch per i principali Investment grade e scadenze.