



Niccolò Dominici

Private Banking

15/07/2024

R I

DIAGNOSI DI PORTAFOGLIO

Scheda identificativa

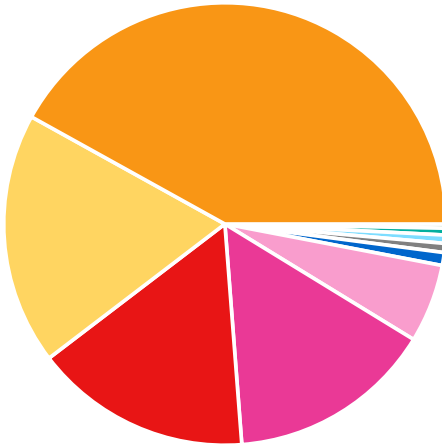
Titolare
Tipo investimentoR I
Investimenti finanziari

Valore del portafoglio

882.220,34 EUR

11/07/2024

Allocation dei prodotti



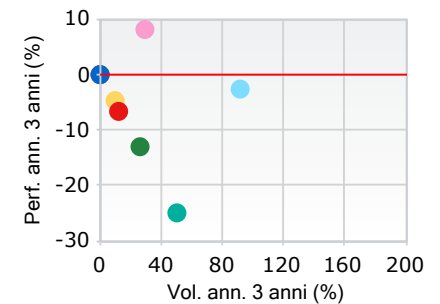
41,9%	BTP Green 4% 30/04/35 EUR
18,4%	BTP 5,75% 01/02/2033
15,8%	BTP 4% 01/02/2037
15,0%	BTP TF 4,45% 09/43 EUR
5,7%	VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD
0,9%	L&G Clean Energy ETF €
0,6%	COINBASE GLB.CL.A - 00001
0,5%	ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1
0,3%	Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C
0,7%	Altri

Performance cumulativa

1 mese :	2,22 %	YTD :	3,33 %
1 anno :	11,61 %	2023 :	14,02 %
3 anni :	-3,45 %	2022 :	-16,82 %
5 anni :	1811,94 %	2021 :	1597,25 %
ITD :	6651,64 %		

Performance anno civile

Rend./Rischio al 11/07/2024



Composizione del portafoglio

Nome	ISIN	Rating	Peso %	Montante €	NAV €	Categoria	Rischio
BTP Green 4% 30/04/35 EUR	IT0005508590		41,9	370.055,21	102,74	Obbligazionari	
BTP 5,75% 01/02/2033	IT0003256820		18,4	162.519,03	118,01	Obbligazionari	
BTP 4% 01/02/2037	IT0003934657		15,8	139.800,36	103,13	Obbligazionari	
BTP TF 4,45% 09/43 EUR	IT0005530032		15,0	132.729,78	104,68	Obbligazionari	
VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD	IE00BQQP9F84	☆☆☆☆☆	5,7	50.599,55	38,86	Azionario Settoriali	6/7
L&G Clean Energy ETF €	IE00BK5BCH80	☆☆☆☆☆	0,9	8.334,60	9,31	Azionario Settoriali	
COINBASE GLB.CL.A - 00001	US19260Q1076		0,6	5.313,46	197,72	Azionari	
ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1	US01609W1027		0,5	4.386,00	72,34	Azionari	
Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C	LU0514695690	☆☆☆☆☆	0,3	2.643,96	12,77	Azionario Paesi Emergenti	5/7
Altri			0,7	5.838,39	-		

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

Barometro

Mercati



Toro

Al rialzo

Neutrale

Al ribasso

Orso

Classifica

■ ■ ■ ■ ■

■ ■ ■ ■ ■

■ ■ ■ ■ ■

■ ■ ■ ■ ■

■ ■ ■ ■ ■

Diversificazione	20,90 %	■ ■ ■ ■ ■
Qualità dei fondi	4,3	■ ■ ■ ■ ■
Fondo ESG	1,2 %	■ ■ ■ ■ ■
Spese correnti medie	0,03 %	■ ■ ■ ■ ■

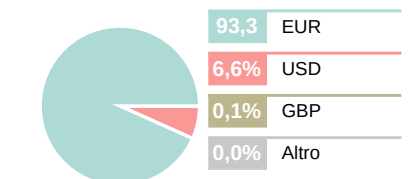
Allocation del portafoglio

91,3 %	Obblig. Europa
6,9 %	Azionario settoriale
1,5 %	Az. USA
0,3 %	Az. Paesi Emergenti
0,1 %	Az. Europa
0,0 %	Az. Globale

Indicatori di rischio

SRI	1	2	3	4	5	6	7
Volatilità a 3 anni	9,71 %	■	■	■	■	■	■
Max DD 3 anni	20,49 %	■	■	■	■	■	■
DSR 3 anni	6,36 %	■	■	■	■	■	■

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 (%)	2,09	1,69	0,73	3,19	9,98	-4,40	1.796,51	1.878,01	2.399,95
Performance annualizzata TWR (%)	-	-	-	-	9,98	-1,49	80,13	45,22	37,97
Volatilità (%)	-	-	5,54	6,65	9,03	9,68	729,46	577,12	516,31
Sharpe ratio	-	-	-0,17	0,39	0,68	-0,33	0,11	0,08	0,07
Max drawdown (%)	-0,15	-1,67	-2,86	-2,86	-7,96	-20,49	-20,49	-20,49	-20,49

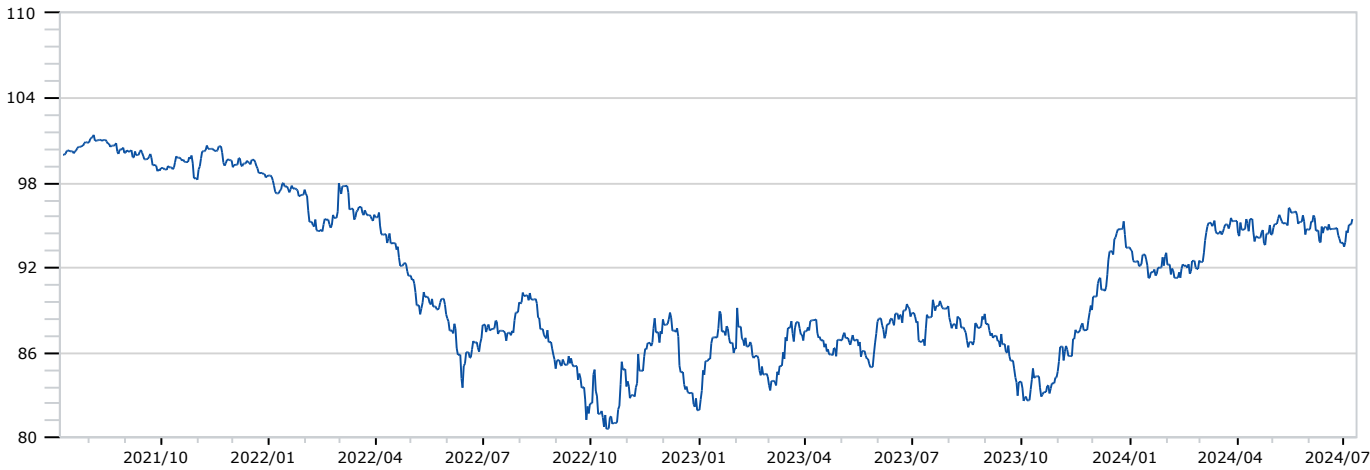
Performance anno civile

Dati	YTD	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017
Performance (%)	3,33	14,02	-16,82	1.597,25	8,95	16,71	-1,83	1,71
Volatilità (%)	6,65	10,77	10,52	1.633,93	8,14	5,75	6,70	4,71
Sharpe ratio	-	1,00	-1,60	0,98	1,17	2,99	-0,20	0,46
Max drawdown	2,86	7,96	18,18	3,12	9,95	3,20	10,80	3,81

Zoom prodotti: perf. cumulative

Peso %	Nome	Codice ISIN	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	Data	Rating
41,95	BTP Green 4% 30/04/35 EUR	IT0005508590	1,87 %	10,55 %	0,00 %	0,00 %	11/07/2024	
18,42	BTP 5,75% 01/02/2033	IT0003256820	1,53 %	9,07 %	-13,42 %	-0,18 %	11/07/2024	
15,85	BTP 4% 01/02/2037	IT0003934657	2,19 %	10,53 %	-18,62 %	-4,07 %	11/07/2024	
15,04	BTP TF 4,45% 09/43 EUR	IT0005530032	2,23 %	10,71 %	0,00 %	0,00 %	11/07/2024	
5,74	VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD	IE00BQQP9F84	24,01 %	28,93 %	26,49 %	60,37 %	11/07/2024	★★★★★
0,94	L&G Clean Energy ETF €	IE00BK5BCH80	-1,91 %	-10,63 %	0,00 %	0,00 %	11/07/2024	★☆☆☆☆
0,60	COINBASE GLB.CL.A - 00001	US19260Q1076	25,62 %	143,72 %	-7,65 %	195142,77 %	11/07/2024	
0,50	ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1	US01609W1027	4,61 %	-12,15 %	-57,75 %	-50,28 %	11/07/2024	
0,30	Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C	LU0514695690	8,77 %	0,09 %	-34,19 %	-16,55 %	11/07/2024	★★★★★
0,20	L&G Hydrogen Economy UCITS ETF USD	IE00BMYDM794	1,44 %	-7,73 %	-39,28 %	0,00 %	11/07/2024	★☆☆☆☆
0,17	NIO INC.A S.ADR DL	US62914V1061	-47,47 %	-56,17 %	-88,77 %	42,26 %	11/07/2024	
0,10	PAYPAL HDGS INC.DL- 0001	US70450Y1038	-0,56 %	-14,00 %	-78,17 %	-48,31 %	11/07/2024	
0,09	BEYOND MEAT INC.	US08862E1091	-21,77 %	-55,21 %	-94,68 %	-95,92 %	11/07/2024	
0,05	ASTON MARTIN LAG.GLB.HLDG	GB00BN7CG237	-26,02 %	-50,92 %	-76,87 %	-92,20 %	11/07/2024	
0,03	QUANTUMSCAPE CORPORATION	US74767V1098	3,41 %	-27,59 %	-69,25 %	0,00 %	11/07/2024	
0,01	TILRAY INC. CL.2 DL- 0001	US88688T1007	-18,12 %	5,81 %	-87,50 %	-95,74 %	11/07/2024	
0,01	rivian Automotive Inc	US76954A1034	-27,28 %	-31,72 %	0,00 %	0,00 %	11/07/2024	

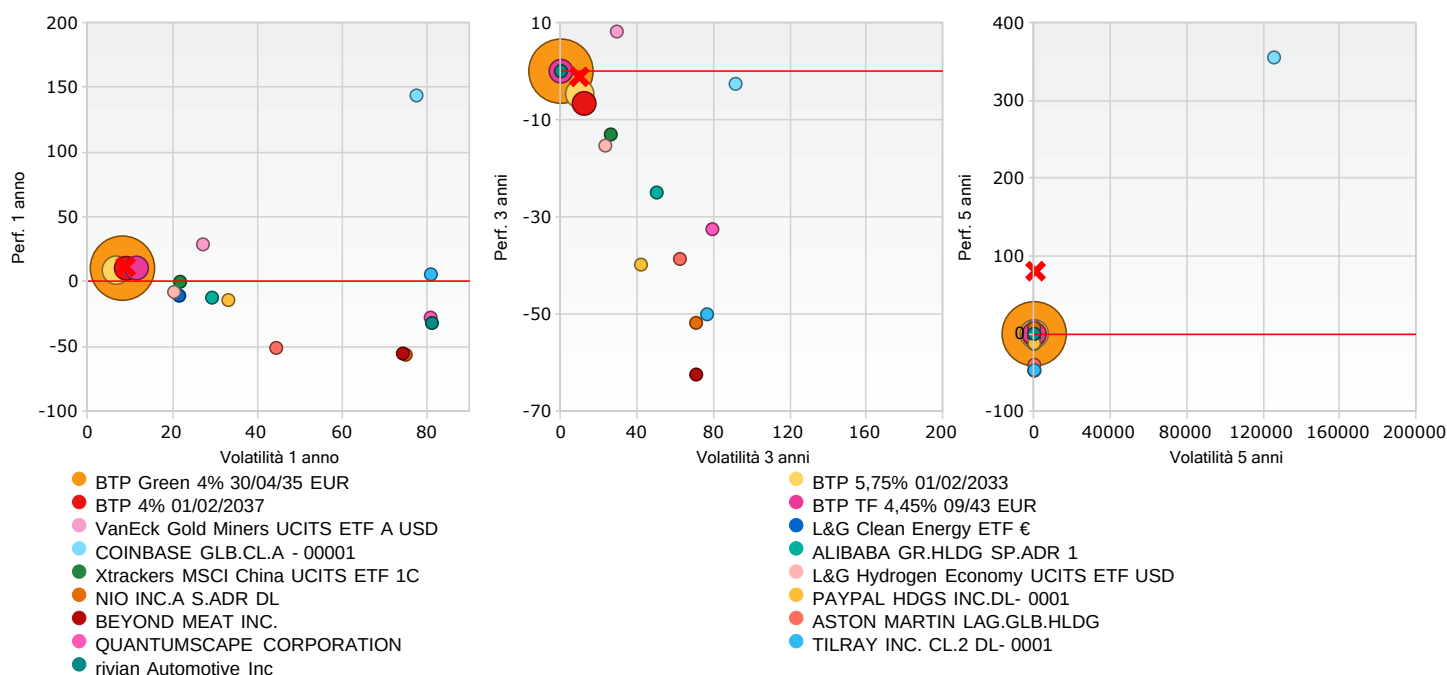
Serie storica base 100 dal 11/07/2021 al 11/07/2024



Performance e indici su 3 anni al 11/07/2024

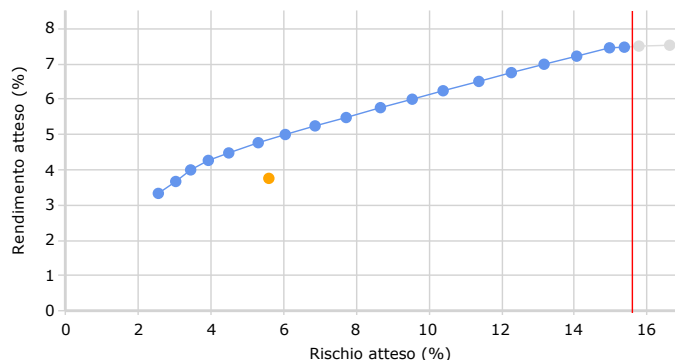
Nome	Perf. cum.	Perf. ann.	Volatilità	Max drawdown	Sortino	Sharpe ratio
● Attuale	-4,55	-1,54	9,68	20,49	-0,50	-0,33

Analisi rendimento rischio



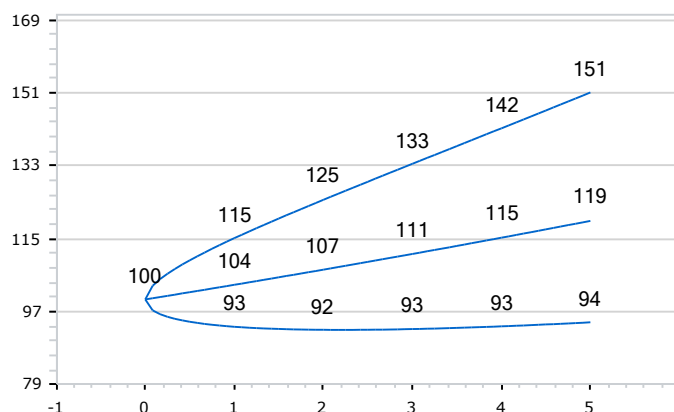
Rendimento/Rischio attesi

● Portafoglio (Rend. atteso 3,76 % Vol. attesa 5,58 %)



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

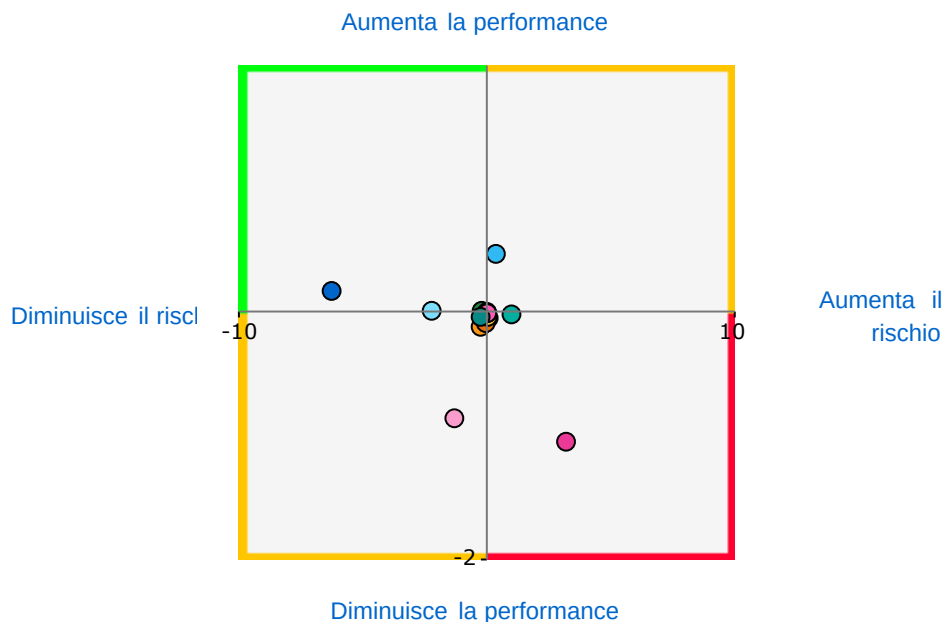


Questo grafico rappresenta l'evoluzione statistica nel 95% dei casi dell'asset allocation del portafoglio su 5 anni. La curva superiore rappresenta l'ipotesi più favorevole, la curva inferiore la meno favorevole e quella centrale l'evoluzione media.

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 (%)	3,61	11,23	19,40	32,80	42,57	53,05
Perdita massima / Rendimento minimo a scadenza (%)	-6,76	-7,34	-5,67	-1,43	2,15	6,23
Perdita massima / Rendimento minimo sul periodo (%)	-6,76	-7,53	-7,53	-7,53	-7,53	-7,53

Contribuzioni a 3 anni



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.

Performance portafoglio: -1,16 % Volatilità del portafoglio: 9,71 %

Prodotto	Vol. senza il prodotto	Perf. del prodotto	Contrib. al rischio	Contrib. alla perf.	Peso (%)
ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1	9,74	-24,94	-0,26	-0,12	0,50
ASTON MARTIN LAG.GLB.HLDG	9,71	-38,59	-0,03	-0,02	0,05
BEYOND MEAT INC.	9,70	-62,34	0,07	-0,05	0,09
BTP 4% 01/02/2037	9,40	-6,63	3,20	-1,05	15,85
BTP 5,75% 01/02/2033	9,84	-4,69	-1,32	-0,86	18,42
BTP Green 4% 30/04/35 EUR	10,32	0,41	-6,29	0,17	41,95
BTP TF 4,45% 09/43 EUR	9,93	0,05	-2,24	0,01	15,04
COINBASE GLB.CL.A - 00001	9,62	-2,62	0,99	-0,02	0,60
L&G Clean Energy ETF €	9,73	0,78	-0,22	0,01	0,94
L&G Hydrogen Economy UCITS ETF USD	9,71	-15,31	-0,03	-0,03	0,20
NIO INC.A S.ADR DL	9,72	-51,72	-0,05	-0,09	0,17
PAYPAL HDGS INC.DL- 0001	9,71	-39,76	0,03	-0,04	0,10
QUANTUMSCAPE CORPORATION	9,71	-32,48	0,01	-0,01	0,03
rivian Automotive Inc	9,71	-42,56	-	-	0,01
TILRAY INC. CL.2 DL- 0001	9,71	-49,97	0,01	-0,01	0,01
VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD	9,68	8,14	0,36	0,47	5,74
Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C	9,74	-13,01	-0,26	-0,04	0,30

Matrice delle correlazioni 3 anni

		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
1	Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C	1,00	-0,05	0,18	-0,04	0,26	-0,02	0,16	-0,01	0,16	0,75	0,04	0,17	0,11	0,24	0,17	0,59	0,10
2	BTP 4% 01/02/2037	-0,05	1,00	0,23	0,93	0,20	0,98	0,05	0,86	0,24	0,00	0,18	0,08	0,26	0,19	0,09	0,01	-0,02
3	L&G Clean Energy ETF €	0,18	0,23	1,00	0,30	0,40	0,24	0,37	0,28	0,24	0,17	0,29	0,29	0,26	0,78	0,39	0,34	0,31
4	BTP Green 4% 30/04/35 EUR	-0,04	0,93	0,30	1,00	0,24	0,91	0,06	0,88	0,22	0,03	0,21	0,12	0,26	0,26	0,11	0,01	0,04
5	VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD	0,26	0,20	0,40	0,24	1,00	0,23	0,14	0,25	-0,04	0,18	0,24	0,22	0,12	0,40	0,15	0,16	0,05
6	BTP 5,75% 01/02/2033	-0,02	0,98	0,24	0,91	0,23	1,00	0,07	0,82	0,24	0,03	0,19	0,11	0,29	0,23	0,09	0,02	0,01
7	rivian Automotive Inc	0,16	0,05	0,37	0,06	0,14	0,07	1,00	0,02	0,36	0,23	0,39	0,38	0,26	0,45	0,49	0,50	0,24
8	BTP TF 4,45% 09/43 EUR	-0,01	0,86	0,28	0,88	0,25	0,82	0,02	1,00	0,16	0,01	0,25	0,11	0,23	0,23	0,08	0,01	0,02
9	BEYOND MEAT INC.	0,16	0,24	0,24	0,22	-0,04	0,24	0,36	0,16	1,00	0,26	0,40	0,26	0,38	0,35	0,42	0,38	0,28
10	ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1	0,75	0,00	0,17	0,03	0,18	0,03	0,23	0,01	0,26	1,00	0,13	0,24	0,18	0,21	0,22	0,55	0,07
11	COINBASE GLB.CL.A - 00001	0,04	0,18	0,29	0,21	0,24	0,19	0,39	0,25	0,40	0,13	1,00	0,29	0,33	0,39	0,50	0,26	0,27
12	TILRAY INC. CL.2 DL- 0001	0,17	0,08	0,29	0,12	0,22	0,11	0,38	0,11	0,26	0,24	0,29	1,00	0,18	0,37	0,38	0,35	0,19
13	PAYPAL HDGS INC.DL- 0001	0,11	0,26	0,26	0,26	0,12	0,29	0,26	0,23	0,38	0,18	0,33	0,18	1,00	0,40	0,29	0,16	0,35
14	L&G Hydrogen Economy UCITS ETF USD	0,24	0,19	0,78	0,26	0,40	0,23	0,45	0,23	0,35	0,21	0,39	0,37	0,40	1,00	0,54	0,40	0,44
15	QUANTUMSCAPE CORPORATION	0,17	0,09	0,39	0,11	0,15	0,09	0,49	0,08	0,42	0,22	0,50	0,38	0,29	0,54	1,00	0,48	0,29
16	NIO INC.A S.ADR DL	0,59	0,01	0,34	0,01	0,16	0,02	0,50	0,01	0,38	0,55	0,26	0,35	0,16	0,40	0,48	1,00	0,25
17	ASTON MARTIN LAG.GLB.HLDG	0,10	-0,02	0,31	0,04	0,05	0,01	0,24	0,02	0,28	0,07	0,27	0,19	0,35	0,44	0,29	0,25	1,00

Verde :buon potenziale di diversificazione (correlazione inferiore a 0.6)

Arancione :potenziale di diversificazione medio (correlazione tra 0.6 e 0.9)

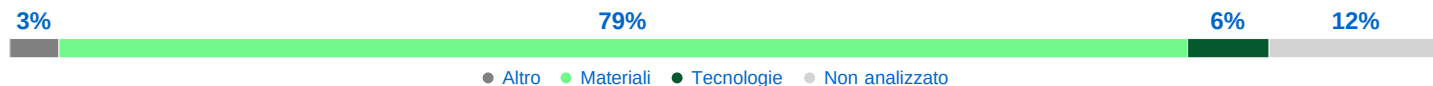
Rosso :scarso potenziale di diversificazione (correlazione superiore a 0.9)

Analisi della quota azionaria

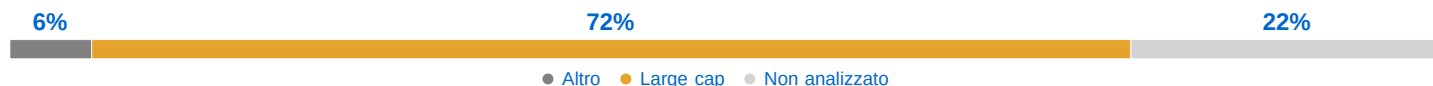
Mappatura per zona geografica



Mappatura per settori



Mappatura per capitalizzazione

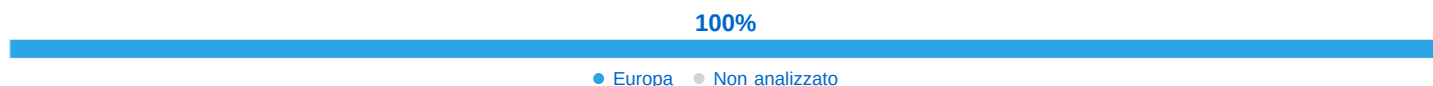


Mappatura per stile

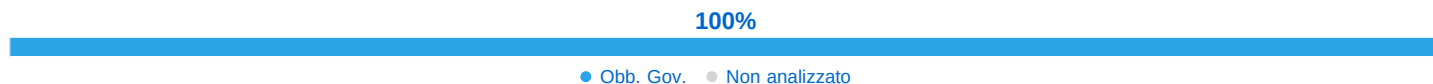


Analisi della quota obbligazionaria

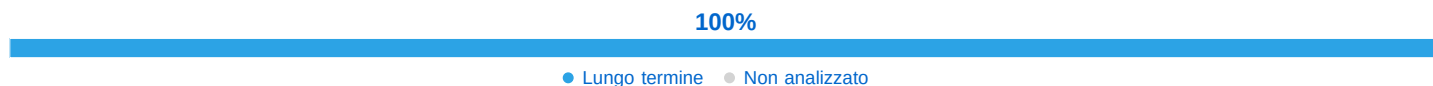
Mappatura per zona geografica



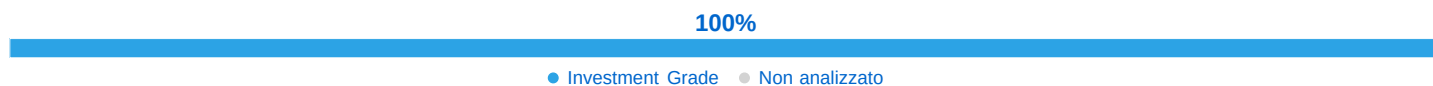
Mappatura per emittente



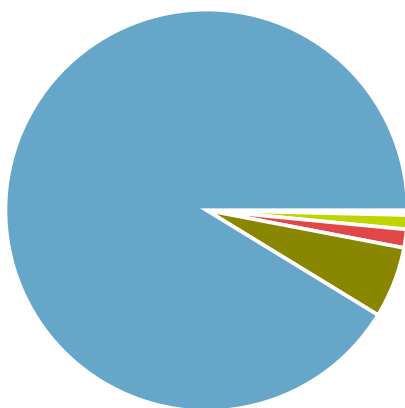
Mappatura per duration



Mappatura per rating

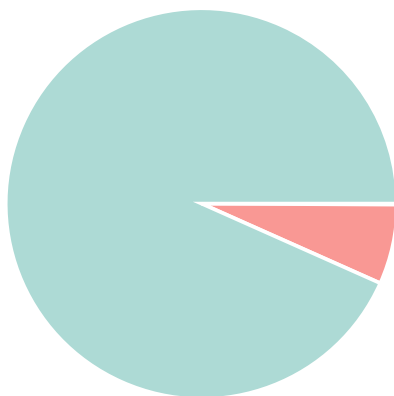


Portafoglio per asset class



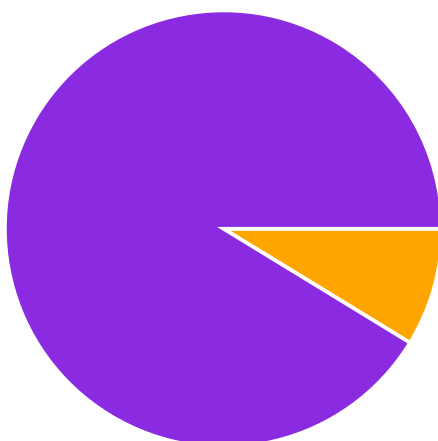
91,3%	Oblig. Europa
0,1%	Az. Europa
1,5%	Az. USA
0,3%	Az. Paesi Emergenti
0,0%	Az. Globale
1,1%	Az. Energy/commodities/oro
5,7%	Az. Oro

Esposizione valutaria



93,3%	EUR
6,6%	USD
0,1%	GBP
0,0%	Altro

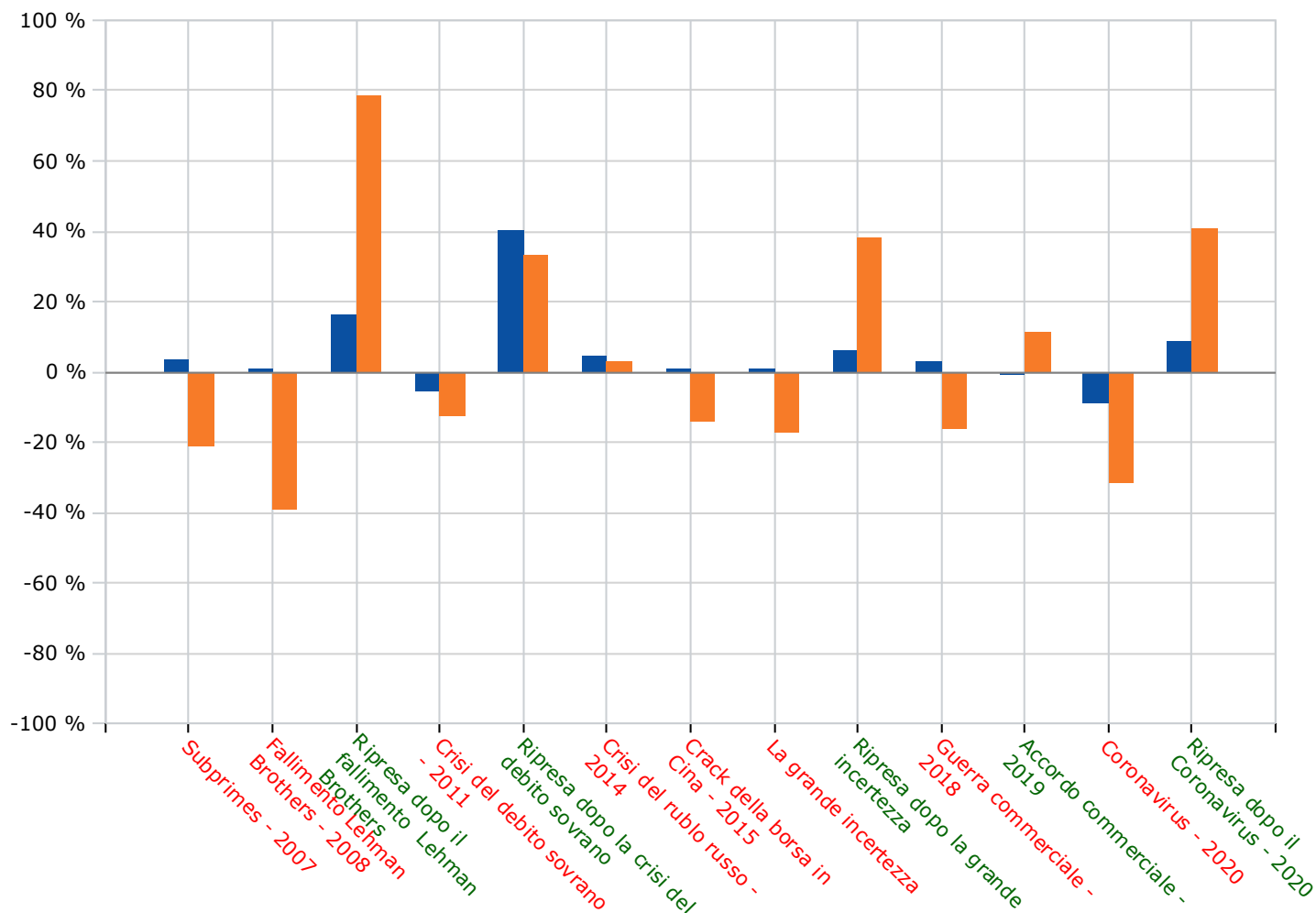
Ripartizione azioni e obbligazioni



8,7%	Azioni
91,3%	Obbligazioni

Il portafoglio confrontato alla storia

■ Portafoglio
■ MSCI World Index



Scenari	Perf. portafoglio	Perf. benchmark	Delta
Subprimes - 2007	3,44 %	-21,24 %	24,68 %
Fallimento Lehman Brothers - 2008	0,81 %	-39,27 %	40,08 %
Ripresa dopo il fallimento Lehman Brothers	16,16 %	78,65 %	-62,48 %
Crisi del debito sovrano - 2011	-5,31 %	-12,52 %	7,21 %
Ripresa dopo la crisi del debito sovrano	40,40 %	33,13 %	7,27 %
Crisi del rublo russo - 2014	4,71 %	3,01 %	1,70 %
Crack della borsa in Cina - 2015	0,09 %	-13,87 %	13,96 %
La grande incertezza	0,16 %	-17,48 %	17,64 %
Ripresa dopo la grande incertezza	6,21 %	37,95 %	-31,74 %
Guerra commerciale - 2018	3,19 %	-16,18 %	19,37 %
Accordo commerciale - 2019	-0,84 %	11,25 %	-12,09 %
Coronavirus - 2020	-8,65 %	-31,70 %	23,05 %
Ripresa dopo il Coronavirus - 2020	8,71 %	40,74 %	-32,04 %

Lista dei prodotti in portafoglio

Nome	ISIN	NAV	Perf. YTD	Perf. 1A	Perf. 3A	Perf. 5A	Data perf.	Sharpe ratio 1A	Rischio 1A	Sharpe ratio 3A	Rischio 3A	Sharpe ratio 5A	Rischio 5A	Rating
Azionario														
 Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C	LU0514695690	13,86 USD	8,77	0,09	-34,19	-16,55	11/07/24	-0,21	21,85	-0,64	26,24	-0,18	24,41	☆☆☆☆☆
 L&G Clean Energy ETF €	IE00BK5BCH80	9,31 EUR	-1,91	-10,63	-	-	11/07/24	-0,92	21,67	-	-	-	-	☆☆☆☆☆
 VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD	IE00BQQP9F84	42,18 USD	24,01	28,93	26,49	60,37	11/07/24	0,49	26,95	0,12	29,19	0,23	33,30	☆☆☆☆☆
 L&G Hydrogen Economy UCITS ETF USD	IE00BMYDM794	4,72 USD	1,44	-7,73	-39,28	-	11/07/24	-0,77	20,45	-0,82	23,43	-	-	☆☆☆☆☆
Titoli														
BTP 4% 01/02/2037	IT0003934657	101,36 EUR	2,19	10,53	-18,62	-4,07	11/07/24	0,04	9,48	-0,72	12,17	-0,10	11,76	
BTP GREEN 4% 30/04/35 EUR	IT0005508590	101,95 EUR	1,87	10,55	-	-	11/07/24	0,11	8,53	-	-	-	-	
BTP 5,75% 01/02/2033	IT0003256820	115,47 EUR	1,53	9,07	-13,42	-0,18	11/07/24	0,09	6,98	-0,69	9,83	-0,05	9,52	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	US76954A1034	16,76 USD	-27,28	-31,72	-	-	11/07/24	-0,24	93,82	-	-	-	-	
BTP TF 4,45% 09/43 EUR	IT0005530032	103,08 EUR	2,23	10,71	-	-	11/07/24	-0,10	11,94	-	-	-	-	
BEYOND MEAT INC.	US08862E1091	6,84 USD	-21,77	-55,21	-94,68	-95,92	11/07/24	-0,68	75,49	-0,92	70,87	-0,60	79,06	
ALIBABA GR.HLDG SP.ADR 1	US01609W1027	78,52 USD	4,61	-12,15	-57,75	-50,28	11/07/24	-0,49	30,47	-0,61	50,26	-0,34	44,33	
COINBASE GLB.CL.A - 00001	US19260Q1076	214,63 USD	25,62	143,72	-7,65	195.142,77	11/07/24	2,72	77,78	-0,03	91,56	0,00	125.715,77	
TILRAY INC. CL.2 DL- 0001	US88688T1007	1,85 USD	-18,12	5,81	-87,50	-95,74	11/07/24	0,05	81,01	-0,72	76,61	-0,41	119,23	
PAYPAL HDGS INC.DL- 0001	US70450Y1038	59,99 USD	-0,56	-14,00	-78,17	-48,31	11/07/24	-0,47	33,12	-0,98	41,99	-0,30	41,12	
QUANTUMSCAPE CORPORATION	US74767V1098	7,06 USD	3,41	-27,59	-69,25	-	11/07/24	-0,51	81,47	-0,56	79,43	-	-	
NIO INC.A S.ADR DL	US62914V1061	4,68 USD	-47,47	-56,17	-88,77	42,26	11/07/24	-0,81	74,30	-0,81	70,77	0,12	91,48	
ASTON MARTIN LAG.GLB.HLDG	GB00BN7CG237	161,90 GBP	-26,02	-50,92	-76,87	-92,20	11/07/24	-1,42	44,36	-0,68	62,36	-0,50	85,59	

* La data indicata nella tabella è quella dell'ultimo NAV disponibile e del calcolo della performance cumulata dall'inizio dell'anno e su 1, 3 e 5 anni. Le performance sono mostrate in percentuale. L'indice di Sharpe, il rischio (ovvero la volatilità annualizzata dei rendimenti settimanali) e il rating Quantalys sono calcolati al : 11/07/2024.

Scheda identificativa - Xtrackers MSCI China UCITS ETF 1C - LU0514695690

Società	DWS Investments SA
Società delegata	DWS Investment GmbH
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	-
Benchmark dichiarato	MSCI China TRN Index
Categoria Quantalys	Azionario Cina
Benchmark di categoria	MSCI China NR
Gestore	-
Valutazione ISR globale	SFDR
Non ISR	Articolo 6

NAV

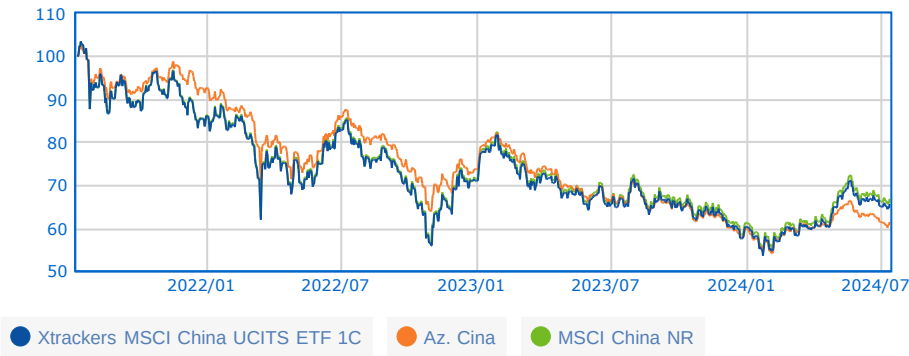
13,86 USD

= 12,77 EUR

11/07/2024



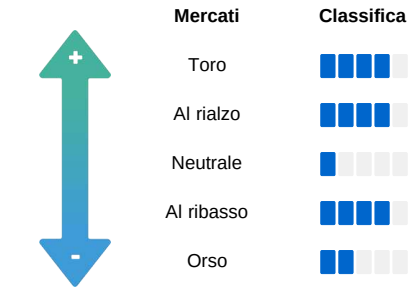
Serie storica base 100 dal 12/07/2021 al 11/07/2024



Performance

Perf. 11/07/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	1,55 %	1,23 %
Perf. 4 settimane	-1,36 %	-2,24 %
Perf. YTD	8,77 %	2,48 %
Perf. 1 anno	0,09 %	-7,61 %
Perf. 3 anni	-34,19 %	-38,38 %
Perf. 5 anni	-16,55 %	-12,77 %
Perf. 8 anni	18,05 %	20,17 %
Perf. 10 anni	36,39 %	48,58 %
Performance annue		
Perf. 2023	-15,00 %	-18,64 %
Perf. 2022	-17,41 %	-20,31 %
Perf. 2021	-15,63 %	-5,55 %
Dati 3 anni al 30/06/2024		
Perf. annua	-15,25 %	-16,23 %
Volatilità	26,24 %	19,48 %
Sharpe ratio	-0,64	-0,92

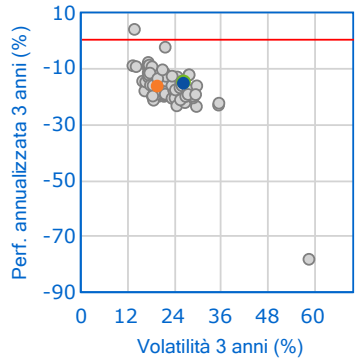
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 30/06/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	42 / 164	2
3 mesi	14 / 163	1
6 mesi	26 / 163	1
YTD	26 / 163	1
1 anno	28 / 163	1
3 anni	47 / 122	2
5 anni	51 / 83	3
8 anni	23 / 59	2
10 anni	22 / 47	2

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 26,24 %	Scasso
Perdita max. -49,60 %	Medio
DSR 19,51 %	Scasso
Beta bear 1,00	Pessimo
VAR -6,34 %	Pessimo
SRI	1 2 3 4 5 6 7

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe -0,64	Eccellente
Information -0,52	Scasso
Ratio (IR) -0,86	Eccellente
Omega 0,83	Eccellente
Calmar -0,33	Buono

Caratteristiche generali

Tipo	ETF
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 11/07/2024	817,27 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	-0,23 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Mediazione
Rimborso	Mediazione
Gestione	0,45 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,65 %
Commissioni di Gestione	0,66 %
Costi di Transazione	0,04 %

© 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 30/06/2024. 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 - L&G Clean Energy ETF € - IE00BK5BCH80

Società	LGIM Managers (Europe) Limited
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	-
Benchmark dichiarato	Solactive Clean Energy NTR
Categoria Quantalys	Azionario energia, materie prime, oro
Benchmark di categoria	MSCI World Materials NR
Gestore	-
Valutazione ISR globale	SFDR
	Articolo 9



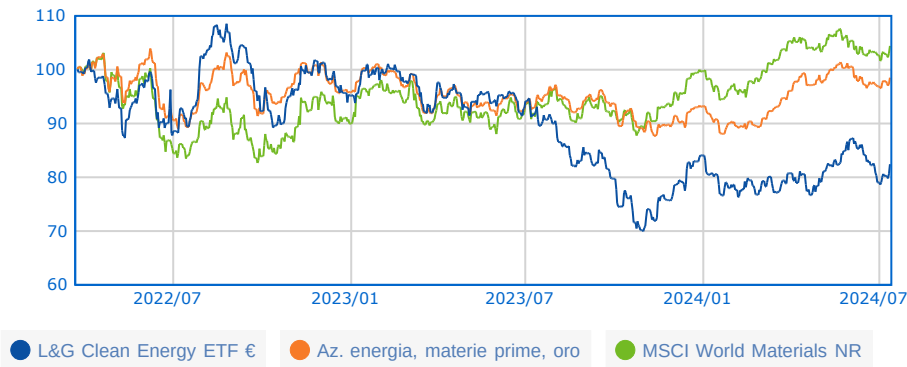
NAV

9,31 EUR

11/07/2024



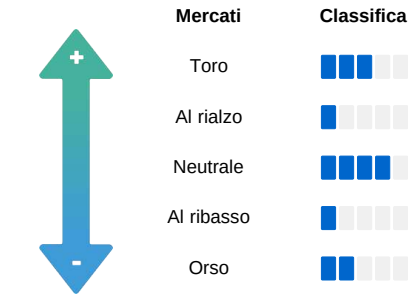
Serie storica base 100 dal 25/03/2022 al 11/07/2024



Performance

Perf. 11/07/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	2,20 %	1,17 %
Perf. 4 settimane	-3,12 %	0,98 %
Perf. YTD	-1,91 %	5,68 %
Perf. 1 anno	-10,63 %	4,92 %
Perf. 3 anni	-	22,25 %
Perf. 5 anni	-	51,93 %
Perf. 8 anni	-	67,09 %
Perf. 10 anni	-	51,58 %
Performance annue		
Perf. 2023	-11,66 %	-2,71 %
Perf. 2022	-	-
Perf. 2021	-	-
Dati 1 anno al 30/06/2024		
Perf. annua	-16,00 %	3,21 %
Volatilità	21,67 %	12,14 %
Sharpe ratio	-0,92	-0,06

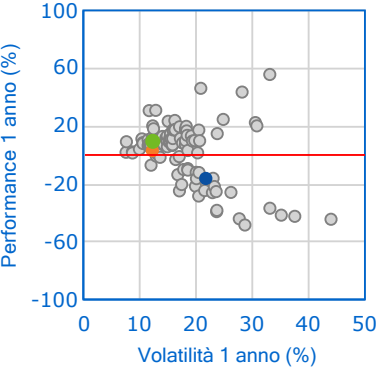
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 30/06/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	196 / 215	4
3 mesi	166 / 215	4
6 mesi	182 / 211	4
YTD	182 / 211	4
1 anno	179 / 207	4
3 anni	112 / 124	4
5 anni	-	-
8 anni	-	-
10 anni	-	-

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 1 anno	Livello
Volatilità	21,67 %
Perdita max.	-26,05 %
DSR	17,03 %
Beta bear	1,54
VAR	-4,91 %

SRI

L'occhio dell'esperto

Valori a 1 anno	Livello
Sharpe	-0,92
Information Ratio (IR)	-1,65
Sortino	-1,17
Omega	0,75
Calmar	-0,74

Caratteristiche generali

Tipo	ETF
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 05/04/2022	173,15 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	-
Spese massime	
Sottoscrizione	Mediazione
Rimborso	Mediazione
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. Il rating Quantalys, gli indicatori, il comportamento, la posizione del fondo rispetto alla sua categoria sono alla data del 30/06/2024. 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 - VanEck Gold Miners UCITS ETF A USD - IE00BQQP9F84

Società	VanEck Investments Ltd
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	-
Benchmark dichiarato	NYSE Arca Gold Miners Index
Categoria Quantalys	Azionario Oro
Benchmark di categoria	MSCI World Metals and Mining NR
Gestore	VanEck Asset Management B.V
Valutazione ISR globale	SFDR
✗ Non ISR	Articolo 6

NAV

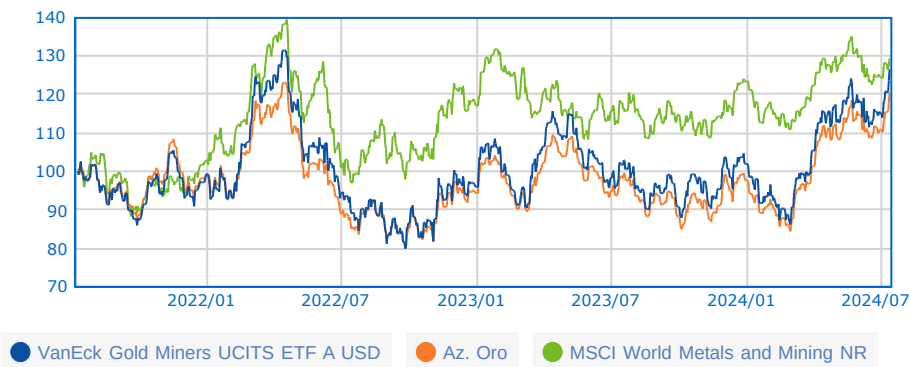
42,18 USD

= 38,86 EUR

11/07/2024



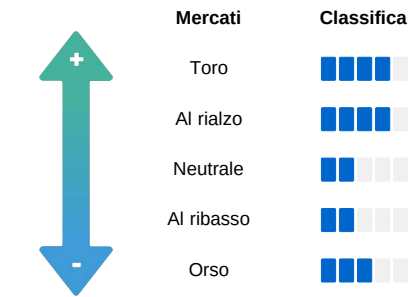
Serie storica base 100 dal 12/07/2021 al 11/07/2024



Performance

Perf. 11/07/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	2,32 %	2,16 %
Perf. 4 settimane	13,46 %	10,78 %
Perf. YTD	24,01 %	23,29 %
Perf. 1 anno	28,93 %	26,22 %
Perf. 3 anni	26,49 %	20,50 %
Perf. 5 anni	60,37 %	69,93 %
Perf. 8 anni	35,13 %	35,91 %
Perf. 10 anni	-	102,83 %
Performance annue		
Perf. 2023	6,26 %	3,51 %
Perf. 2022	-3,28 %	-4,97 %
Perf. 2021	-2,18 %	-3,81 %
Dati 3 anni al 30/06/2024		
Perf. annua	5,26 %	3,80 %
Volatilità	29,19 %	26,23 %
Sharpe ratio	0,12	0,08

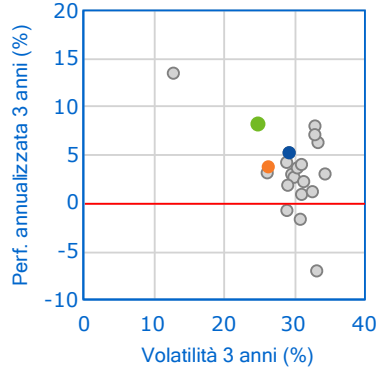
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 30/06/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	18 / 59	2
3 mesi	23 / 59	2
6 mesi	23 / 59	2
YTD	23 / 59	2
1 anno	21 / 59	2
3 anni	11 / 51	1
5 anni	14 / 39	2
8 anni	8 / 36	1
10 anni	-	-

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità	29,19 %
Perdita max.	-39,15 %
DSR	18,87 %
Beta bear	0,62
VAR	-5,91 %

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

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni	Livello
Sharpe	0,12
Information Ratio (IR)	-0,14
Sortino	0,19
Omega	1,09
Calmar	0,09

Caratteristiche generali

Tipo	ETF
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 11/07/2024	973,36 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	11,49 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Mediazione
Rimborso	Mediazione
Gestione	0,53 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,53 %
Commissioni di Gestione	0,5 %
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 30/06/2024. 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 - L&G Hydrogen Economy UCITS ETF USD - IE00BMYDM794

Società	LGIM Managers (Europe) Limited
Tipo investitore	Retail
Cat. Assogestioni	-
Benchmark dichiarato	Solactive Hydrogen Economy Index NTR
Categoria Quantalys	Azionario energia, materie prime, oro
Benchmark di categoria	MSCI World Materials NR
Gestore	-
Valutazione ISR globale	SFDR
 E S G	Articolo 9

NAV

4,72 USD

= 4.35 EUR

11/07/2024



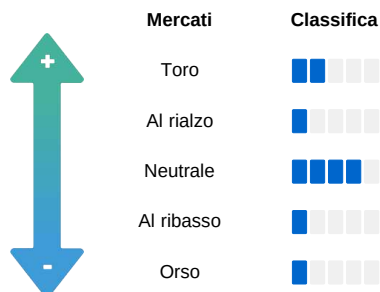
Serie storica base 100 dal 12/07/2021 al 11/07/2024



Performance

Perf. 11/07/2024	Fondo	Categoria
Perf. 1 giorno	3,29 %	1,17 %
Perf. 4 settimane	-1,35 %	0,98 %
Perf. YTD	1,44 %	5,68 %
Perf. 1 anno	-7,73 %	4,92 %
Perf. 3 anni	-39,28 %	22,25 %
Perf. 5 anni	-	51,93 %
Perf. 8 anni	-	67,09 %
Perf. 10 anni	-	51,58 %
Performance annue		
Perf. 2023	-7,27 %	-2,71 %
Perf. 2022	-33,09 %	10,99 %
Perf. 2021	-	-
Dati 3 anni al 30/06/2024		
Perf. annua	-17,62 %	6,24 %
Volatilità	23,43 %	15,19 %
Sharpe ratio	-0.82	0.30

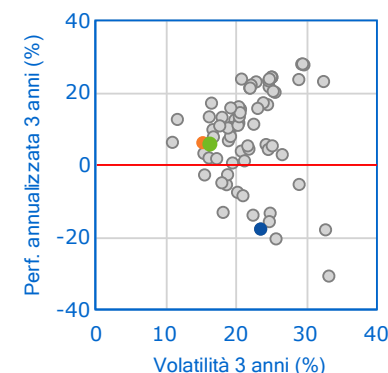
Barometro Quantalys



Classifica della performance al 30/06/2024

	Posizione	Quartile
1 mese	198 / 215	4
3 mesi	189 / 215	4
6 mesi	172 / 211	4
YTD	172 / 211	4
1 anno	172 / 207	4
3 anni	121 / 124	4
5 anni	-	-
8 anni	-	-
10 anni	-	-

Fondo vs Categoria



Indicatori di rischio

Valori a 3 anni	Livello
Volatilità 23,43 %	Scarso
Perdita max. -51,79 %	Pessimo
DSR 17,96 %	Scarso
Beta bear 1,13	Pessimo
VAR -5,34 %	Scarso

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

L'occhio dell'esperto

Valori a 3 anni		Livello
Sharpe	-0,82	Pessimo
Information Ratio (IR)	-1,50	Pessimo
Sortino	-1,07	Pessimo
Omega	0,76	Pessimo
Calmar	-0,37	Pessimo

Caratteristiche generali

Tipo	ETF
Accumul./Distribuz.	Accumulazione
Classe Hedged	No
Fondo di fondi	No
AUM al 11/07/2024	391,04 M
Variazione dell'AUM 3 mesi	0,43 %
Spese massime	
Sottoscrizione	Mediazione
Rimborso	Mediazione
Gestione	0,49 %
Performance fee	Nessuno
Spese correnti	0,49 %
Commissioni di Gestione	0,49 %
Costi di Transazione	0,04 %

© 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 30/06/2024. 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.