

08/12/2023

Backtest a 3 anni : Portafoglio Prospect

Confronto Portafoglio Prospect rispetto al Benchmark / Asset Allocation/
Categoria/ Mia Proposta

Analisi Costi & Performance/ Risk Contribution del Portafoglio Prospect



Il confronto della performance a 3 anni del portafoglio rispetto al benchmark è in linea, sottoperforma però l'asset allocation di riferimento e la categoria. La volatilità e il max drawdown sono molto più alti rispetto ai comparabili, inoltre ha un indicatore di Sharpe Negativo.

I costi sono molto elevati e decisamente oltre la media, riducendo la performance di conseguenza.

Le contribuzioni dei singoli strumenti non aumentano la performance senza diminuire il rischio in nessun caso, rendendo il portafoglio sottoperformante sotto ogni punto di vista.

La soluzione che propongo (**Proposta**) è decisamente migliorativa riducendo ampiamente i costi attualmente sostenuti, aumentando il rischio/rendimento e l'efficienza del portafoglio.

N.B.* la percentuale di azionario al 30% e obbligazionario al 70% rimane inalterata nel Portafoglio (Proposta equity 30 / 70 bond)

Performance dal 22/11/2020 al 08/12/2023



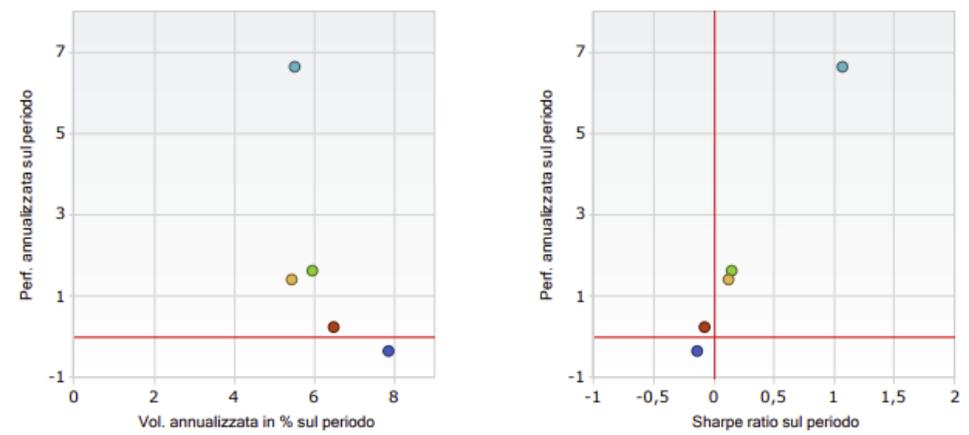
Durata: -- Scegli -- Anno: -- Scegli -- Eventi: -- Scegli --
 Data inizio: 22/11/2020 Data fine: 08/12/2023 Aggiorna
 Aggiungi categorie Aggiungi dei portafogli transazionali Aggiungi dei fondi
 Aggiungi indici Aggiungi portafogli in pesi multi-compo
 Aggiungi delle asset allocation Aggiungi dei portafogli del backtest

	Nome	Perf	Perf Ann.	Volatilità	Sharpe ratio
1	B 25% MSCI World + 75% ICE BofA Global Broad Market	0,73 %	0,24 %	6,48 %	-0,08
2	AA 70/30	5,04 %	1,63 %	5,95 %	0,15
3	AA Asset Allocation 7	4,35 %	1,41 %	5,43 %	0,12
4	PT proposta equity 30 / 70 bond	21,62 %	6,64 %	5,51 %	1,07
5	PT prospect presso altro intermediario	-1,06 %	-0,35 %	7,85 %	-0,14

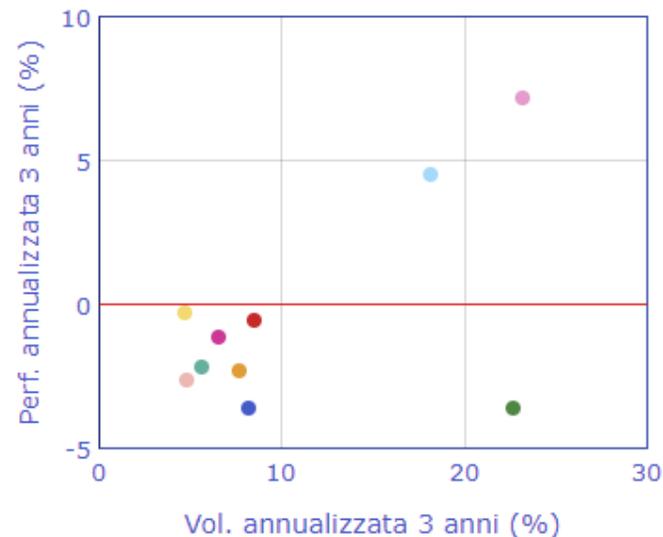
Composizione portafoglio Prospect presso altro intermediario

PROSPECT PRESSO ALTRO INTERMEDIARIO				8,02	-0,17	17,58
%	Fondo	Perf. cumulativa	Perf. annualizzata	Rischio	Sharpe	Max drawdown
<input type="checkbox"/>	11,86 Algebris Financial Credit Fund R EUR	-3,25 %	-1,09 %	8,54	-0,21	-21,34
<input type="checkbox"/>	7,86 Core Target Allocation 25 (II) E EUR Acc	-8,11 %	-2,78 %	5,63	-0,62	-15,65
<input type="checkbox"/>	6,44 FAM Evolution Icaav Advisory 4 L EUR Dis	-9,24 %	-3,18 %	4,69	-0,83	-14,56
<input type="checkbox"/>	11,59 FAM Evolution ICAV Advisory 6 L Acc	-5,29 %	-1,80 %	6,50	-0,39	-16,52
<input type="checkbox"/>	6,90 Pictet Biotech R EUR	-20,35 %	-7,30 %	22,27	-0,36	-37,96
<input type="checkbox"/>	9,52 Pictet Gbl Env Opp R EUR Acc	10,35 %	3,34 %	18,22	0,14	-26,80
<input type="checkbox"/>	10,44 Pictet Robotics R EUR	20,90 %	6,53 %	23,24	0,25	-36,07
<input type="checkbox"/>	10,12 PIMCO GIS Capital Secs E EUR Inc	-11,46 %	-3,98 %	8,16	-0,57	-25,19
<input type="checkbox"/>	12,18 PIMCO GIS Divers Inc Dur Hgd E EUR h Acc	-0,49 %	-0,16 %	4,77	-0,18	-13,89
<input type="checkbox"/>	13,07 Templeton Global Total Return N Acc USD	-10,86 %	-3,76 %	7,71	-0,58	-15,58

Confronto Rendimento / Rischio e Rendimento / Sharpe ratio



Rendimento/Rischio dei fondi



Performance cumulativa

1 mese : 5,02 %
 1 anno : 4,87 %
 3 anni : -1,69 %
 5 anni : -
 ITD : -1,06 %

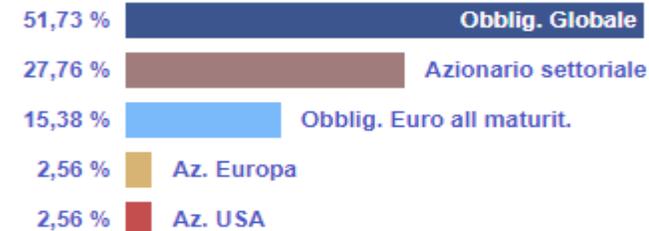
Performance anno civile

YTD : 7,13 %
 2022 : -14,44 %
 2021 : 6,50 %

Plus valenza

Latente: -7.711 € Totale: -4.567 €

Allocation del portafoglio ?



Zoom prodotti: oneri

Peso %	Nome	Spese correnti (%)	Spese correnti €	Performance fee
13,04	Templeton Global Total Return N Acc USD	2,09 %	1.148,07	Nessuno
11,90	PIMCO GIS Divers Inc Dur Hgd E EUR h Acc	1,59 %	796,96	Nessuno
11,76	Algebris Financial Credit Fund R EUR	1,28 %	634,26	Si
11,50	FAM Evolution ICAV Advisory 6 L Acc	2,35 %	1.138,12	Nessuno
10,58	Pictet Robotics R EUR	2,69 %	1.198,64	Nessuno
10,00	PIMCO GIS Capital Secs E EUR Inc	1,7 %	716,14	Nessuno
9,54	Pictet Gbl Env Opp R EUR Acc	2,71 %	1.089,51	Nessuno
7,81	Core Target Allocation 25 (II) E EUR Acc	2,42 %	795,86	Nessuno
7,51	Pictet Biotech R EUR	2,7 %	854,19	Nessuno
6,37	FAM Evolution IcaV Advisory 4 L EUR Dis	1,98 %	531,43	Nessuno
Total		2,11 %	8.903,18	

1 anno 3 anni 5 anni

Performance portafoglio : 0,21 % Volatilità portafoglio : 8,17 %

Prodotto	Volatilità senza il prodotto	Performance del prodotto	Contributo al rischio	Contributo alla perf.	Peso (%)
Algebris Financial Credit Fund R EUR	8,51	-0,56	-4,18	-0,07	11,76
Core Target Allocation 25 (II) E EUR Acc	8,48	-2,24	-3,86	-0,17	7,81
FAM Evolution Icaav Advisory 4 L EUR Dis	8,47	-2,64	-3,69	-0,17	6,37
FAM Evolution ICAV Advisory 6 L Acc	8,49	-1,19	-3,97	-0,14	11,50
Pictet Biotech R EUR	7,86	-3,62	3,79	-0,27	7,51
Pictet Gbl Env Opp R EUR Acc	7,34	4,48	10,17	0,43	9,54
Pictet Robotics R EUR	6,83	7,13	16,36	0,75	10,58
PIMCO GIS Capital Secs E EUR Inc	8,46	-3,62	-3,62	-0,36	10,00
PIMCO GIS Divers Inc Dur Hgd E EUR h Acc	8,85	-0,35	-8,37	-0,04	11,90
Templeton Global Total Return N Acc USD	8,88	-2,32	-8,70	-0,30	13,04

