

PORTAFOGLI MODELLO – QUADRO RIEPILOGATIVO

	MODELLO (ANNO DI PARTENZA)	STRATEGIA	CARATTERISTICHE	STRUMENTI BASE	FREQUENZA DI REVISIONE	GRADO DI CONTROLLO	PROFILATURA TEORICA**
PM ATTIVI (richiedono azione e controllo costante, rigoroso controllo dei livelli operativi)	DRAGON (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale mista (E+B)	ETF	variabile	elevato	
	GLOBAL GROWTH (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale mista (E+B)	ETF	variabile	elevato	
	MULTIASSET (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	variabile	elevato	
	GLOBAL BOND (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale (B)	ETF	variabile	elevato	
	BOND AGGRESSIVE (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale (B)	ETF	variabile	elevato	
	BLACK SWAN (2007)	ACTIVE REBALANCING	Controdirezionale (ES+B+G)	ETF	variabile	elevato	
	SDT (2007)	SEASONAL	Direzionale (E)	ETF	2/anno	basso	
PM BENCHMARK (strategie bilanciate passive con basso livello di maintenance)	BMK DRAGON (2007)	BILANCIAMENTO PASSIVO	Direzionale mista (E+B)	ETF	2+ anni	molto basso	
	BMK GLOBAL GROWTH (2007)	BILANCIAMENTO PASSIVO	Direzionale mista (E+B)	ETF	2+ anni	molto basso	
	BMK MULTIASSET (2007)	BILANCIAMENTO PASSIVO	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	2+ anni	molto basso	
	BMK GLOBAL BOND (2007)	BILANCIAMENTO PASSIVO	Direzionale (B)	ETF	2+ anni	molto basso	
	BMK BOND AGGRESSIVE (2007)	BILANCIAMENTO PASSIVO	Direzionale (B)	ETF	2+ anni	molto basso	
MULTISTRATEGY (rebalancing periodico)	PERMANENT PORTFOLIO MIX (2011)	LONG TERM ALLOCATION	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	annuale	molto basso	
	BILANCIATO PRUDENTE (2011)	LONG TERM ALLOCATION	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	annuale	molto basso	
	BILANCIATO AGGRESSIVO (2011)	LONG TERM ALLOCATION	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	annuale	molto basso	
	ETF DEFENSIVE (2007)	LONG TERM ALLOCATION	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	annuale	molto basso	
	FONDI AGGRESSIVE (2009)	LONG TERM SELECTION	Direzionale mista (E+B)	Fondi, ETF	annuale	molto basso	
MONTHLY/ QUARTERLY REBALANCING (richiedono una azione/controllo ogni mese/trimestre)	SMART PAC (2007)	ACTIVE REBALANCING	Direzionale mista (E+B)	ETF	mensile	medio	
	GLOBAL COMBO (2007)	TREND FOLLOWING SELECTION	Direzionale mista (E+B+G)	ETF	mensile	medio	
	PORTAFOGLIO SCANNER (2007)	ACTIVE REBALANCING	Mean reverting + risk adverse	ETF	variabile	medio	
	PORTAFOGLIO MEGATREND (2017)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	ETF	mensile	medio	
	MKT ALERT MASTER PURO (2007)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	ETF	mensile	medio	
	MKT ALERT MASTER BILANCIATO (2007)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	ETF	mensile	medio	
	MKT ALERT ITALIA BIG CAP (2012)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	Titoli	mensile	medio	
	MKT ALERT ITALIA MID CAP (2012)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	Titoli	mensile	medio	
MARKET ALERT USA (2012)	ALPHA ACTIVE SELECTION	Algoritmo genetico di selezione	Titoli	mensile	medio		

E = Equity ES = Equity Short B = Bond G = Gold

** PRUDENTE BILANCIATO DINAMICO AGGRESSIVO

	MODELLO (ANNO DI PARTENZA)	PERFORMANCE STATS					RISK STATS					EFFICIENCY RATIO
		YTD (2021)	LAST MONTH	LAST 12 M	LAST 36 M	YEARLY PERF.	ST.DEV(YEARLY)	MAX DRAWDOWN	MONTHS TO RECOVERY	MAX DD 12M	EQUITY EXP. % (MIN-MAX)	
PM ATTIVI (richiedono azione e controllo costante, rigoroso controllo dei livelli operativi)	DRAGON (2007)	7.04%	0.99%	21.51%	31.64%	11.00%	7.39	-9.48%	16	-5.30%	0-90	1.49
	GLOBAL GROWTH (2007)	7.59%	4.18%	22.61%	16.50%	9.56%	8.06	-10.74%	14	-7.63%	0-90	1.19
	MULTIASSET (2007)	1.53%	1.65%	7.08%	14.36%	9.36%	5.97	-7.73%	22	-4.09%	0-37.5	1.57
	GLOBAL BOND (2007)	-1.40%	0.88%	2.43%	7.14%	6.50%	4.46	-5.06%	14	-3.53%	0-0	1.46
	BOND AGGRESSIVE (2007)	0.82%	2.57%	3.73%	11.24%	9.08%	5.57	-6.77%	14	-5.33%	0-0	1.63
	BLACK SWAN (2007)	-2.30%	0.12%	-9.87%	22.84%	8.54%	10.93	-10.65%	27	-9.87%	0-90 (neg.)	0.78
	SDT (2007)	6.48%	5.09%	30.26%	20.31%	7.87%	9.44	-19.32%	18	-14.87%	0-90	0.83
PM BENCHMARK (strategie bilanciate passive con basso livello di maintenance)	BMK DRAGON (2007)	2.01%	0.49%	17.90%	16.74%	4.25%	7.26	-23.31%	28	-20.59%	45-45	0.59
	BMK GLOBAL GROWTH (2007)	1.39%	1.58%	14.10%	13.89%	6.24%	5.53	-9.45%	20	-8.96%	30-30	1.13
	BMK MULTIASSET (2007)	-0.84%	1.08%	7.99%	12.71%	6.82%	5.04	-5.06%	17	-3.39%	15-15	1.35
	BMK GLOBAL BOND (2007)	-1.18%	0.65%	4.89%	6.05%	4.26%	4.27	-6.39%	29	-5.89%	0-0	1.00
	BMK BOND AGGRESSIVE (2007)	-0.80%	1.10%	5.99%	10.39%	4.55%	5.30	-12.01%	28	-11.92%	0-0	0.86
MULTISTRATEGY (rebalancing periodico)	PERMANENT PORTFOLIO MIX (2011)	3.20%	3.85%	14.11%	27.90%	5.66%	6.20	-7.92%	23	-4.82%	25-25	0.91
	BILANCIATO PRUDENTE (2011)	0.77%	1.80%	16.60%	20.53%	5.72%	5.19	-8.06%	14	-3.41%	30-30	1.10
	BILANCIATO AGGRESSIVO (2011)	3.40%	2.90%	30.31%	29.41%	7.40%	8.38	-13.29%	13	-6.75%	60-60	0.88
	ETF DEFENSIVE (2007)	0.19%	1.55%	9.46%	17.01%	6.12%	4.46	-4.60%	14	-2.64%	21.5-21.5	1.37
	FONDI AGGRESSIVE (2009)	2.49%	1.33%	20.78%	17.46%	12.01%	8.90	-12.71%	9	-7.52%	0-100	1.35
MONTHLY/ QUARTERLY REBALANCING (richiedono una azione/controllo ogni mese/trimestre)	SMART PAC (2007)	6.16%	3.83%	25.84%	6.13%	5.94%	9.19	-18.48%	34	-15.37%	0-100	0.65
	GLOBAL COMBO (2007)	4.16%	3.01%	14.75%	7.77%	6.97%	6.86	-14.46%	19	-8.85%	0-50	1.02
	PORTAFOGLIO SCANNER (2007)	-2.26%	0.96%	12.74%	14.31%	6.39%	6.18	-8.72%	27	-4.72%	0-80	1.03
	PORTAFOGLIO MEGATREND (2017)	9.92%	4.12%	97.28%	105.56%	23.85%	18.70	-15.84%	7	-6.98%	100-100	1.28
	MKT ALERT MASTER PURO (2007)	8.66%	3.20%	34.04%	29.90%	8.94%	9.12	-16.91%	33	-15.63%	0-100	0.98
	MKT ALERT MASTER BILANCIATO (2007)	4.64%	2.68%	22.83%	28.72%	8.58%	7.74	-14.06%	40	-12.73%	0-60	1.11
	MKT ALERT ITALIA BIG CAP (2012)	12.28%	10.14%	65.49%	44.83%	12.89%	20.15	-25.70%	23	-21.66%	100-100	0.64
	MKT ALERT ITALIA MID CAP (2012)	2.57%	2.29%	24.22%	-24.25%	10.28%	21.66	-47.26%	41	-36.99%	100-100	0.47
MARKET ALERT USA (2012)	10.72%	0.64%	90.57%	88.54%	19.86%	17.04	-17.90%	13	-6.30%	100-100	1.17	

NOTA - Le performances si intendono al lordo di tassazione e commissioni di intermediazione. Le performances passate sono indicative (vedi DISCLAIMER) e non sono in alcun modo garanzia di ritorni futuri.

NB – I dati di performance dei modelli sono riferiti alla chiusura dell'ultimo mese solare.