

Quantalys

HARVEST GROUP
07/09/2023

Federico Fabbri
Fineco
Via fratelli bandiera 16
47843 Misano Adriatico (RN)

Portafoglio portafoglio test Al 01/09/2023

Design Patrimoniale,
Diagnosi personalizzata



DESIGN PATRIMONIALE

Scheda identificativa

Titolare
Tipo investimento

Federico Fabbri
Investimenti finanziari

Valore del portafoglio

1.500.000,00 EUR

05/09/2023

Allocation dei prodotti



13,0%	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR
12,0%	Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR
10,0%	iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis
10,0%	Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc
8,0%	UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A
5,5%	Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR
5,5%	SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist
5,0%	Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc
4,5%	iShares Core € Corp Bd UCITS ETF EUR Dis
26,5%	Altri

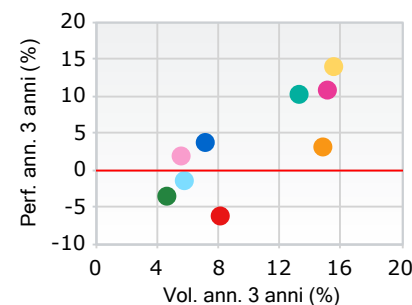
Performance cumulativa

1 mese : 0,77 %
1 anno : 2,14 %
3 anni : 17,73 %
5 anni : 27,46 %
ITD : 308,23 %

Performance anno civile

YTD : 6,81 %
2022 : -10,54 %
2021 : 15,43 %
2020 : 2,78 %

Rend./Rischio al 01/09/2023

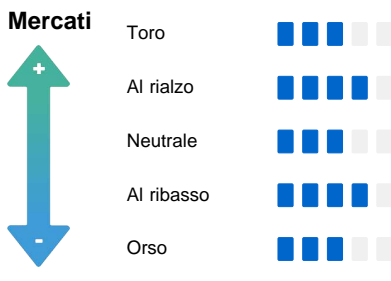


Composizione del portafoglio

Nome	ISIN	Rating	Peso %	Montante €	NAV €	Categoria	Rischi
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR	IE00BKM4GZ66	☆☆☆☆☆	13,0	195.000,00	28,38	Azionario Paesi Emergenti	
Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR	LU0496786574	☆☆☆☆☆	12,0	180.000,00	42,94	Azionario America del Nord	5/7
iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis	IE00B2NPKV68	☆☆☆☆☆	10,0	150.000,00	77,83	Obbligazionario Paesi Emergenti	
Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc	LU0908500753	☆☆☆☆☆	10,0	150.000,00	206,98	Azionario Europa	4/7
UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A	LU1645380368	☆☆☆☆☆	8,0	120.000,00	14,24	Obbligazionario inflation linked	2/7
Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR	LU1435356149	☆☆☆☆☆	5,5	82.500,00	83,14	Obbligazionario Dollaro US	
SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist	IE00B6YX5M31	☆☆☆☆☆	5,5	82.500,00	49,56	Obbligazionario Euro	2/7
Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc	IE00BYXVGZ48	☆☆☆☆☆	5,0	75.000,00	7,12	Azionario Globale	4/7
Altri			31,0	465.000,00	-		

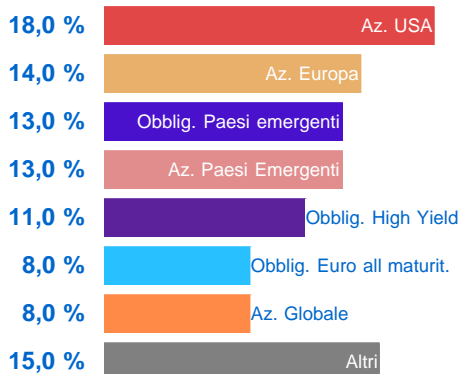
Il dettaglio completo dei fondi è visibile nella sezione: "Zoom prodotti: perf. cumulative".

Barometro



Diversificazione	25,88 %	■■■■■
Qualità dei fondi	3,5	■■■■■
Fondo ESG	13,0 %	■
Spese correnti medie	0,24 %	

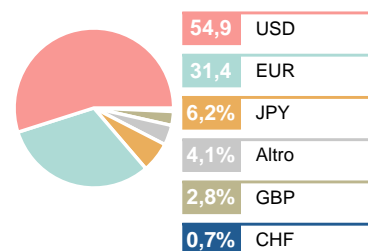
Allocation del portafoglio



Indicatori di rischio

SRRI	1	2	3	4	5	6	7
Volatilità a 3 anni					■	■	
Max DD 3 anni				■	■	■	
DSR 3 anni				■	■		

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 (%)	1,33	0,77	0,92	2,45	2,14	17,73	27,46	57,55	90,81
Performance annualizzata TWR (%)	-	-	-	-	2,14	5,59	4,97	5,85	6,67
Volatilità (%)	-	-	7,70	6,93	8,22	8,66	11,02	10,17	10,07
Sharpe ratio	-	-	0,03	0,26	-0,02	0,60	0,45	0,59	0,67
Max drawdown (%)	-0,38	-2,05	-3,65	-3,65	-6,74	-12,53	-26,20	-26,20	-26,20

Performance anno civile

Dati	YTD	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Performance (%)	6,81	-10,54	15,43	2,78	20,09	-4,43	5,99	9,40
Volatilità (%)	6,40	10,46	7,10	18,26	6,26	8,80	5,05	10,82
Sharpe ratio	-	-1,01	2,25	0,18	3,29	-0,45	1,27	0,91
Max drawdown	3,85	12,53	3,28	26,20	3,94	8,64	4,46	9,94

Zoom prodotti: perf. cumulative

Peso %	Nome	Codice ISIN	YTD	1 anno	3 anni	5 anni	Data	Rating
13,00	iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR	IE00BKM4GZ66	6,58 %	-2,00 %	10,80 %	21,92 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
12,00	Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR	LU0496786574	17,37 %	6,33 %	48,09 %	81,75 %	01/09/2023	☆☆☆☆☆
10,00	Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc	LU0908500753	10,51 %	13,26 %	37,21 %	38,42 %	04/09/2023	☆☆☆☆☆
10,00	iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis	IE00B2NPKV68	-0,96 %	-7,20 %	-18,78 %	-13,05 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
8,00	UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A	LU1645380368	2,75 %	-0,39 %	5,62 %	7,12 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
5,50	SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist	IE00B6YX5M31	0,63 %	2,15 %	-4,40 %	-0,75 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
5,50	Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR	LU1435356149	4,17 %	-2,52 %	11,56 %	18,63 %	01/09/2023	☆☆☆☆☆
5,00	Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc	IE00BYXVGZ48	6,80 %	3,16 %	35,31 %	41,65 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
4,50	iShares Core € Corp Bd UCITS ETF EUR Dis	IE00B3F81R35	2,83 %	0,55 %	-10,81 %	-5,26 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
4,00	Amundi IS Barclays Gb Agg 500M ETF DR C	LU1437024729	-1,20 %	-7,62 %	-10,29 %	-0,06 %	04/09/2023	☆☆☆☆☆
4,00	iShares MSCI € Qual Divd ESG ETF EUR Dis	IE00BYHSM20	9,86 %	11,99 %	47,11 %	38,08 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
3,50	UBS MSCI Pacific Socially Resp USD A-dis	LU0629460832	5,54 %	0,63 %	13,46 %	19,36 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
3,00	Lyxor Core MSCI Japan ETF - Acc EUR	LU1781541252	13,64 %	11,33 %	23,88 %	27,10 %	04/09/2023	☆☆☆☆☆
3,00	iShares DJones US Slt Div ETF DE USD D	DE000A0D8Q49	-7,83 %	-12,01 %	53,89 %	33,68 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
3,00	Invesco EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF EUR	IE0032077012	41,41 %	18,70 %	46,92 %	123,59 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
3,00	SPDR Bloomberg EM Local Bond ETF	IE00B4613386	-0,98 %	-4,91 %	-7,63 %	2,40 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆
3,00	iShares MSCI Wld SI Cp UCITS ETF USD Acc	IE00BF4RFH31	7,20 %	1,61 %	38,59 %	31,19 %	05/09/2023	☆☆☆☆☆

Serie storica base 100 dal 01/09/2020 al 01/09/2023



Performance e indici su 3 anni al 01/09/2023

Nome	Perf. cum.	Perf. ann.	Volatilità	Max drawdown	Sortino	Sharpe ratio
● portafoglio test	17,73	5,59	8,66	12,53	0,88	0,60

■ INFORMAZIONI COMPLEMENTARI

(Le informazioni complementari sopra riportate sono del consulente che usa Quantalys o della struttura alla quale appartiene)

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
Obbligazionario														
SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist	IE00B6YX5M31	49,56 EUR	0,63	2,15	-4,40	-0,75	05/09/23	-0,22	6,53	-0,32	5,77	-0,03	8,47	☆☆☆☆☆
iShares Core € Corp Bd UCITS ETF EUR Dis	IE00B3F81R35	114,33 EUR	2,83	0,55	-10,81	-5,26	05/09/23	-0,27	5,10	-0,83	4,63	-0,23	4,63	☆☆☆☆☆
iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis	IE00B2NPKV68	77,83 EUR	-0,96	-7,20	-18,78	-13,05	05/09/23	-1,16	8,92	-0,81	8,21	-0,32	9,50	☆☆☆☆☆
Amundi IS Barclays Gb Agg 500M ETF DR C	LU1437024729	46,95 EUR	-1,20	-7,62	-10,29	-0,06	04/09/23	-1,71	5,85	-0,60	6,02	0,00	5,69	☆☆☆☆☆
Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR	LU1435356149	83,14 EUR	4,17	-2,52	11,56	18,63	01/09/23	-0,62	7,47	0,45	7,14	0,39	8,63	☆☆☆☆☆
UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A	LU1645380368	14,24 EUR	2,75	-0,39	5,62	7,12	05/09/23	-0,42	6,42	0,28	5,55	0,31	4,87	☆☆☆☆☆
SPDR Bloomberg EM Local Bond ETF	IE00B4613386	55,18 USD	-0,98	-4,91	-7,63	2,40	05/09/23	-1,01	6,88	-0,42	6,61	0,04	6,96	☆☆☆☆☆
Azionario														
Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc	LU0908500753	206,98 EUR	10,51	13,26	37,21	38,42	04/09/23	0,79	14,33	0,68	15,14	0,36	18,30	☆☆☆☆☆
Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc	IE00BYXVGZ48	7,64 USD	6,80	3,16	35,31	41,65	05/09/23	0,01	11,87	0,73	13,26	0,42	16,88	☆☆☆☆☆
Lyxor Core MSCI Japan ETF - Acc EUR	LU1781541252	14,59 EUR	13,64	11,33	23,88	27,10	04/09/23	0,29	15,13	0,46	14,55	0,26	16,94	☆☆☆☆☆
Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR	LU0496786574	42,94 EUR	17,37	6,33	48,09	81,75	01/09/23	0,34	14,76	0,88	15,52	0,68	18,39	☆☆☆☆☆
iShares DJones US Slct Div ETF DE USD D	DE000A0D8Q49	79,54 USD	-7,83	-12,01	53,89	33,68	05/09/23	-0,96	14,65	0,96	16,37	0,30	21,04	☆☆☆☆☆
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR	IE00BKM4GZ66	28,38 EUR	6,58	-2,00	10,80	21,92	05/09/23	-0,40	15,05	0,15	14,82	0,19	16,32	☆☆☆☆☆
Invesco EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF EUR	IE0032077012	354,49 EUR	41,41	18,70	46,92	123,59	05/09/23	0,73	20,10	0,57	20,71	0,77	21,65	☆☆☆☆☆
UBS MSCI Pacific Socially Resp USD A-dis	LU0629460832	70,41 USD	5,54	0,63	13,46	19,36	05/09/23	-0,34	13,12	0,25	13,83	0,18	16,34	☆☆☆☆☆
iShares MSCI Wld SI Cp UCITS ETF USD Acc	IE00BF4RFH31	6,50 USD	7,20	1,61	38,59	31,19	05/09/23	-0,17	14,99	0,64	16,16	0,26	20,72	☆☆☆☆☆
iShares MSCI € Qual Divd ESG ETF EUR Dis	IE00BYHSM20	5,44 EUR	9,86	11,99	47,11	38,08	05/09/23	0,70	13,73	0,90	14,29	0,34	18,88	☆☆☆☆☆

* 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 : 01/09/2023.

Quantalys

HARVEST GROUP
07/09/2023

Federico Fabbri
Fineco
Via fratelli bandiera 16
47843 Misano Adriatico (RN)

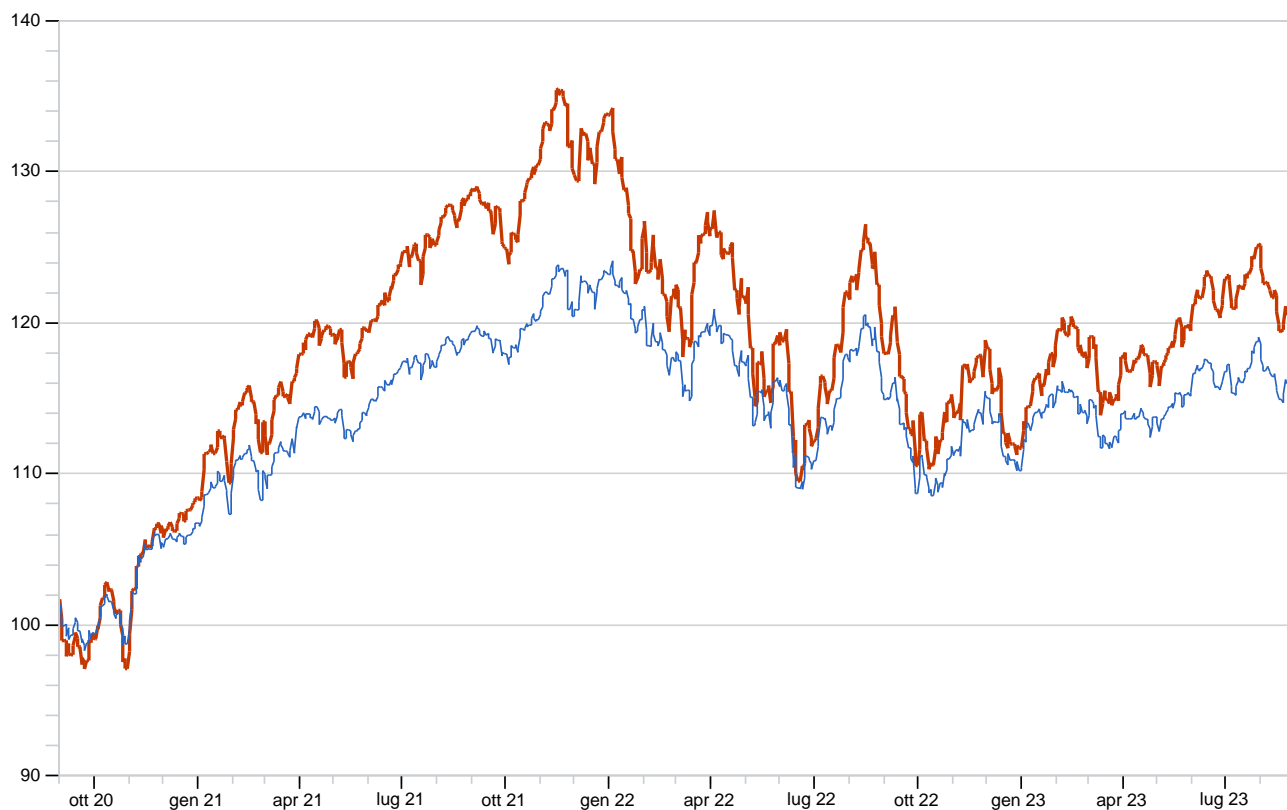
Backtest

Design Patrimoniale,
Diagnosi personalizzata



DESIGN PATRIMONIALE

■ PERFORMANCE DELLA TUA SELEZIONE DAL 02/09/2020 (BASE 100) AL 01/09/2023

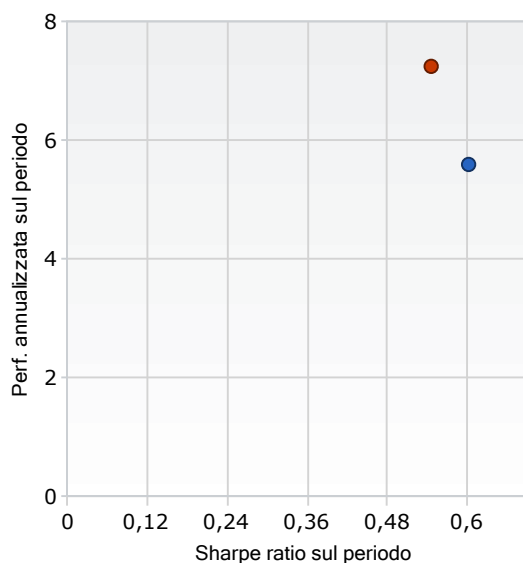
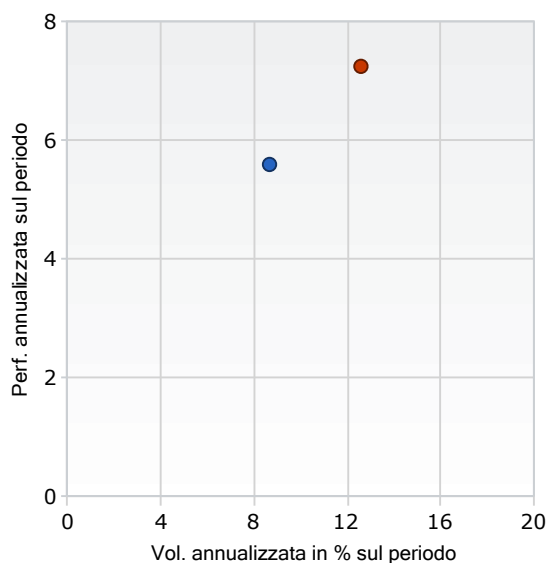


Nome	Perf. cumulativa	Perf. annualizzata	Volatilità	Sharpe ratio	Max Drawdown
Az. globale	23,34%	7,24%	12,58%	0,55	-19,18%
portafoglio test	17,73%	5,59%	8,66%	0,60	-12,53%

Analisi del portafoglio portafoglio test dal 02/09/2020 al 01/09/2023

Nome	Peso	Perf. cumulativa	Perf. annualizzata	Volatilità	Sharpe ratio	Max Drawdown	CVar
Amundi IS Barclays Gb Agg 500M ETF DR C	4,0%	-9,49%	-3,27%	6,01%	-0,61	-14,55%	-1,25%
Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc	5,0%	33,97%	10,24%	13,26%	0,74	-13,40%	-3,36%
Invesco EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF EUR	3,0%	39,44%	11,72%	20,73%	0,55	-31,37%	-4,94%
iShares Core € Corp Bd UCITS ETF EUR Dis	4,5%	-10,28%	-3,55%	4,62%	-0,85	-17,56%	-0,98%
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR	13,0%	9,63%	3,11%	14,82%	0,18	-23,41%	-3,27%
iShares DJones US Slct Div ETF DE USD D	3,0%	58,16%	16,51%	16,38%	0,98	-18,71%	-3,60%
iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis	10,0%	-17,56%	-6,24%	8,11%	-0,82	-21,51%	-1,76%
iShares MSCI € Qual Divd ESG ETF EUR Dis	4,0%	47,22%	13,76%	14,27%	0,94	-14,49%	-2,72%
iShares MSCI Wld Sl Cp UCITS ETF USD Acc	3,0%	37,55%	11,21%	16,21%	0,67	-29,72%	-3,34%
Lyxor Core MSCI Japan ETF - Acc EUR	3,0%	24,16%	7,48%	14,70%	0,48	-20,20%	-3,84%
Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc	10,0%	36,05%	10,81%	15,11%	0,69	-20,62%	-3,44%
Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR	5,5%	11,56%	3,71%	7,14%	0,47	-9,24%	-2,17%
Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR	12,0%	48,09%	13,98%	15,53%	0,88	-17,20%	-3,79%
SPDR Bloomberg EM Local Bond ETF	3,0%	-7,08%	-2,42%	6,60%	-0,42	-12,84%	-2,24%
SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist	5,5%	-4,32%	-1,46%	5,77%	-0,32	-16,36%	-1,72%
UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A	8,0%	5,77%	1,89%	5,56%	0,27	-9,39%	-1,44%
UBS MSCI Pacific Socially Resp USD A-dis	3,5%	13,22%	4,23%	13,98%	0,27	-20,67%	-2,82%

Confronto Rendimento / Rischio



■ ATTENZIONE

Le informazioni contenute in questo rapporto appartengono a Quantalys che non ne garantisce né l'affidabilità né l'eshaustività. Queste informazioni sono fornite esclusivamente a titolo indicativo dalla società Quantalys. Esse non costituiscono un'offerta di acquisto da parte di Quantalys, di vendita, di sottoscrizione o di servizi finanziari, né una sollecitazione di un'offerta di acquisto di qualsiasi prodotto. Si leggano il prospetto e le condizioni generali del fondo prima di ogni decisione di investimento. Le performance passate non sono indicative di quelle future. Tutte le performance e i dati collegati sono calcolati in euro e non sono garantiti, in particolare nel caso di fondi denominati in una valuta diversa dall'euro. Per il calcolo dell'indice di Sharpe, Quantalys usa l'EONIA per rappresentare il tasso privo di rischio.

I rendimenti e i rischi attesi non sono garantiti e poggiano su ipotesi di performance e volatilità future delle asset class, ipotesi che non necessariamente si verificheranno. La perdita massima relativamente subita nel corso di un investimento potrà essere superiore alla perdita massima calcolata in questo documento, senza che il suo ammontare possa essere previsto.

I portafogli o le allocation alle quali questo portafoglio è comparato seguono la stessa convenzione. Questo backtest simula l'evoluzione di un portafoglio in fondi su un periodo passato calcolando la sua performance, il suo rischio e il suo Sharpe teorici. Di default, quando un fondo non ha una serie storica per l'intero periodo, la parte mancante viene sostituita con la performance dell'indice di categoria. Le eventuali commissioni di ingresso, di uscita, di arbitraggio o tutti gli altri tipi di spesa non vengono presi in conto. I risultati di questo backtest sono ipotetici, non sono garantiti e non forniscono alcuna garanzia rispetto ai risultati di questo portafoglio di fondi.

■ INFORMAZIONI COMPLEMENTARI

(Le informazioni complementari sopra riportate sono del consulente che usa Quantalys o della struttura alla quale appartiene)

LISTA DEI FONDI DEL PORTAFOGLIO PORTAFOGLIO TEST

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*
OBBLIGAZIONI														
iShares Core € Corp Bd UCITS ETF EUR Dis	IE00B3F81R35	114,33 EUR	2,83	0,55	-10,81	-5,26	05/09/23	-0,27	5,10	-0,83	4,63	-0,23	4,63	★★★★★
iShares JPMorgan \$ EM UCITS ETF EUR Dis	IE00B2NPKV68	77,83 EUR	-0,96	-7,20	-18,78	-13,05	05/09/23	-1,16	8,92	-0,81	8,21	-0,32	9,50	★★★★★
Lyxor ESG USD High Yield ETF - Dis EUR	LU1435356149	83,14 EUR	4,17	-2,52	11,56	18,63	01/09/23	-0,62	7,47	0,45	7,14	0,39	8,63	★★★★★
SPDR Bloomberg Euro Hi Yi Bond ETF Dist	IE00B6YX5M31	49,56 EUR	0,63	2,15	-4,40	-0,75	05/09/23	-0,22	6,53	-0,32	5,77	-0,03	8,47	★★★★★
Amundi IS Barclays Gb Agg 500M ETF DR C	LU1437024729	46,95 EUR	-1,20	-7,62	-10,29	-0,06	04/09/23	-1,71	5,85	-0,60	6,02	0,00	5,69	★★★★★
SPDR Bloomberg EM Local Bond ETF	IE00B4613386	55,18 USD	-0,98	-4,91	-7,63	2,40	05/09/23	-1,01	6,88	-0,42	6,61	0,04	6,96	★★★★★
UBS BBG Barclays € Infl Link 1-10 EUR A	LU1645380368	14,24 EUR	2,75	-0,39	5,62	7,12	05/09/23	-0,42	6,42	0,28	5,55	0,31	4,87	★★★★★
AZIONI														
iShares MSCI € Qual Divd ESG ETF EUR Dis	IE00BYHSM20	5,44 EUR	9,86	11,99	47,11	38,08	05/09/23	0,70	13,73	0,90	14,29	0,34	18,88	★★★★★
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF EUR	IE00BKM4GZ66	28,38 EUR	6,58	-2,00	10,80	21,92	05/09/23	-0,40	15,05	0,15	14,82	0,19	16,32	★★★★★
Invesco EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF EUR	IE0032077012	354,49 EUR	41,41	18,70	46,92	123,59	05/09/23	0,73	20,10	0,57	20,71	0,77	21,65	★★★★★
Lyxor Core MSCI Japan ETF - Acc EUR	LU1781541252	14,59 EUR	13,64	11,33	23,88	27,10	04/09/23	0,29	15,13	0,46	14,55	0,26	16,94	★★★★★
Lyxor S&P 500 ETF - Dis EUR	LU0496786574	42,94 EUR	17,37	6,33	48,09	81,75	01/09/23	0,34	14,76	0,88	15,52	0,68	18,39	★★★★★
iShares DJones US Slct Div ETF DE USD D	DE000A0D8Q49	79,54 USD	-7,83	-12,01	53,89	33,68	05/09/23	-0,96	14,65	0,96	16,37	0,30	21,04	★★★★★
Lyxor Core STOXX Europe 600 ETF - Acc	LU0908500753	206,98 EUR	10,51	13,26	37,21	38,42	04/09/23	0,79	14,33	0,68	15,14	0,36	18,30	★★★★★
iShares MSCI Wld Sl Cp UCITS ETF USD Acc	IE00BF4RFH31	6,50 USD	7,20	1,61	38,59	31,19	05/09/23	-0,17	14,99	0,64	16,16	0,26	20,72	★★★★★
Fidelity Global Qualit Inc ETF Inc	IE00BYXVGZ48	7,64 USD	6,80	3,16	35,31	41,65	05/09/23	0,01	11,87	0,73	13,26	0,42	16,88	★★★★★
UBS MSCI Pacific Socially Resp USD A-dis	LU0629460832	70,41 USD	5,54	0,63	13,46	19,36	05/09/23	-0,34	13,12	0,25	13,83	0,18	16,34	★★★★★

*La data riportata nella tabella è quella dell'ultimo NAV disponibile e del calcolo delle performance cumulative dall'inizio dell'anno e su 1, 3 e 5 anni. Le performance vengono indicate in percentuale. L'indice di Sharpe, il rischio (che corrisponde alla volatilità annualizzata dei rendimenti settimanali) e il rating Quantalys vengono calcolati al 31/08/2023.