

AGORA VALORE PROTETTO

COMPOSIZIONE DEL PORTAFOGLIO AL 30/09/2017

FONTE: ELABORAZIONE INTERNA SU DATI BLOOMBERG

RIEPILOGO RENDIMENTI

Dati al 30/09/2017

I rendimenti e le quote dei fondi sono al netto della fiscalità e delle commissioni fino al 30.06.2011 e al netto delle commissioni e al lordo della fiscalità dal 01.07.2011.

DA INIZIO ANNO	-1,17%
DAL LANCIO	3,10%
RENDIMENTO 2016	2,97%
RENDIMENTO 2015	-3,23%
RENDIMENTO 2014	2,11%
RENDIMENTO 2013	-1,41%
RENDIMENTO 2012	4,99%
RENDIMENTO 2011	4,93%
RENDIMENTO 2010	-1,05%
RENDIMENTO 2009	9,34%
RENDIMENTO 2008	-3,17%
RENDIMENTO 2007	4,16%
RENDIMENTO 2006	2,12%
RENDIMENTO 2005	1,32%

INDICATORE DI RISCHIO:

VAR EX ANTE (DA PROSPETTO): -2,00%
Grado di rischio: 2 su 7

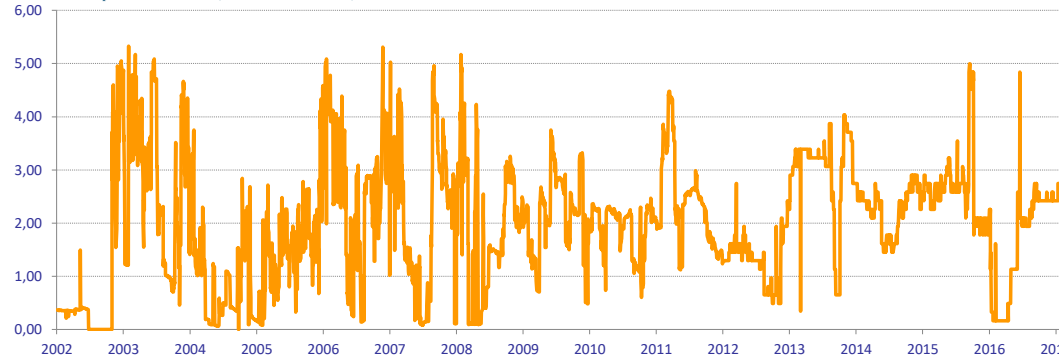
Data di avvio: 7 settembre 2001

AGORA VALORE PROTETTO | ANDAMENTO DELLA QUOTA

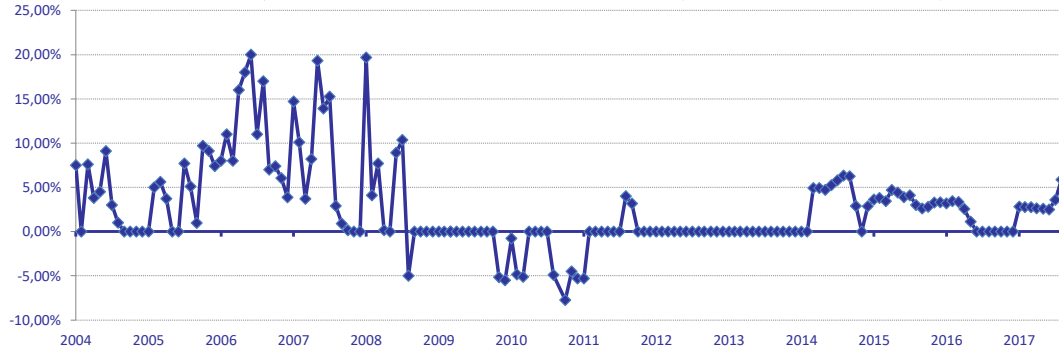


AGORA VALORE PROTETTO | ANDAMENTO DEL VAR ANNUALE

Il VaR annuale (Value At Risk) è un indicatore statico di rischiosità del portafoglio che rappresenta la perdita massima potenziale, in percentuale, su base annua, con un livello di probabilità del 95% (intervallo di confidenza)

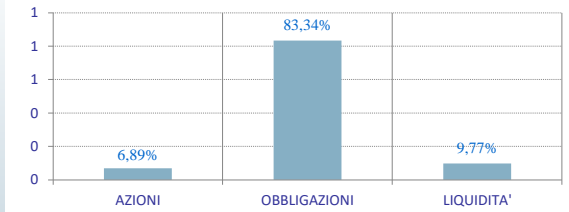


AGORA VALORE PROTETTO | EVOLUZIONE DELL'ESPOSIZIONE AZIONARIA (OSSERVAZIONI A FINE MESE)



ASSET ALLOCATION

Valori in %



COMPOSIZIONE ASSET CLASS AZIONARIA (6,89 %)

Posizioni significative



COMPOSIZIONE ASSET CLASS OBBLIGAZIONARIA (83,34 %)

Posizioni significative



ESPOSIZIONE IN VALUTA

Dati in percentuale

