

Guida Fund Focus Impostazioni

MoneyMate[®] 

Home

★ My Favourites

My Portfolios

My Reports

Performance

€ Prices

Risk

Show 25 entries

Search:

Name ^	1Mth	3Mth	YTD	1Yr	3Yrs (Ann)	5Yrs (Ann)	10Yrs (Ann)	Performance to	Options
BGF Euro Bond EUR Acc E2	0.87%	1.15%	1.51%	2.04%	4.95%	5.56%	4.42%	10/12/2015	
BGF Euro Corporate Bond EUR Dis E5	0.37%	0.52%	-0.22%	-0.15%	2.20%	3.28%	--	10/12/2015	
Carnignac Patrimoine EUR YDis A	-0.55%	0.56%	-0.47%	0.80%	3.46%	--	--	10/12/2015	
Dnca Invest Eurose EUR Dis AD	-1.15%	0.12%	1.60%	1.54%	3.97%	--	--	10/12/2015	
Fidelity European Dynamic Growth EUR YDis A	0.34%	5.97%	24.80%	27.98%	15.58%	12.32%	8.21%	10/12/2015	
Fidelity Italy EUR YDis A	-1.09%	-1.48%	22.32%	20.50%	18.21%	8.53%	2.77%	10/12/2015	
Franklin Mutual Beacon USD YDis A	-2.36%	4.21%	6.98%	9.66%	16.41%	12.45%	4.75%	10/12/2015	
JPMF Italy Flexible Bond EUR Dis D	-1.44%	-1.28%	-5.37%	-5.29%	-1.20%	--	--	10/12/2015	
MS Global Fixed Income Opportunities EUR Dis AH	-0.83%	-1.49%	-4.13%	-4.17%	0.71%	--	--	10/12/2015	
Pictet Multi Asset Global Opportunities EUR Dis R	-0.12%	1.78%	3.10%	3.94%	--	--	--	10/12/2015	
Pimco GIS Euro Bond Fund EUR Inc E	0.89%	1.07%	0.18%	0.74%	4.14%	5.56%	3.44%	10/12/2015	
Pimco GIS Global Bond Fund USD Inc E	-0.69%	2.81%	11.23%	14.87%	7.84%	8.49%	--	10/12/2015	

Settings

User Settings

Currency Rates Provider	ECB		
Proxy Currency	Deutsche Mark	Marco tedesco	
VaR Level	5		%
Omega Threshold	1		%
Risk Free Return	<input checked="" type="radio"/> Custom Rate		
	<input type="radio"/> Use Index		
Custom Rate	1.5		%
Presented By	Mario Rossi		
Display Tips	<input type="checkbox"/> Enabled		

[Return](#) [Save Changes](#)

In alternativa usare WM Reuters

Consigliato EONIA base 100
Un valore fisso non è adeguato per analisi nel medio-ungo periodo

Settaggio di impostazioni che agiscono a monte del database che riguardano:

- **Currency Rates Provider (ECB o WM Reuters)**

Possibilità di definire il tasso di cambio da applicare per la conversione degli indicatori; la scelta è tra il tasso di cambio WM Reuters oppure il tasso di cambio BCE.

- **Proxy Currency**

Impostata su Marco Tedesco; tasso di cambio in cui vengono convertite le serie storiche antecedentemente all'entrata in vigore dell'euro.

- **VaR Level (inserire la % della coda sinistra della distribuzione)**

N:B Calcolare il VaR con il 95% di probabilità significa lasciare il 5% di probabilità sulla coda sinistra della distribuzione, che implica che la massima perdita potenziale non sarà maggiore di quella che si legge sull'asse delle ascisse nel 95% dei casi sull'orizzonte temporale selezionato.

- **Omega Threshold (valore soglia di omega "r")**

Il valore soglia ha la funzione di dividere la funzione di ripartizione in due aree, G(gain) e L (loss). Si divide in questo modo la funzione di ripartizione dei rendimenti nella probabilità di guadagno e nella probabilità di perdita. La funzione Omega è infatti definita come il rapporto tra la probabilità di guadagno (G) sulla probabilità di perdita in relazione ad una soglia "r".

La soglia "r" è scelta in accordo con l'investitore (in modo diverso a seconda della propria avversione al rischio), offrendo una misura di performance personalizzata e, allo stesso tempo, evita l'ossessione del benchmark.

N:B Quando si legge il risultato del valore omega dal modulo Analisi Del rischio, per qualsiasi titolo in un determinato intervallo (e frequenza) temporale, esso fa riferimento alla probabilità di arrivare a questo valore soglia.

- **Risk free Return**

Possibilità di definire un tasso privo di rischio che sia non solo un dato puntuale (una percentuale) ma una serie storica (legato all'andamento di un indice/tasso), per il calcolo di alcuni indicatori quantitativi.