

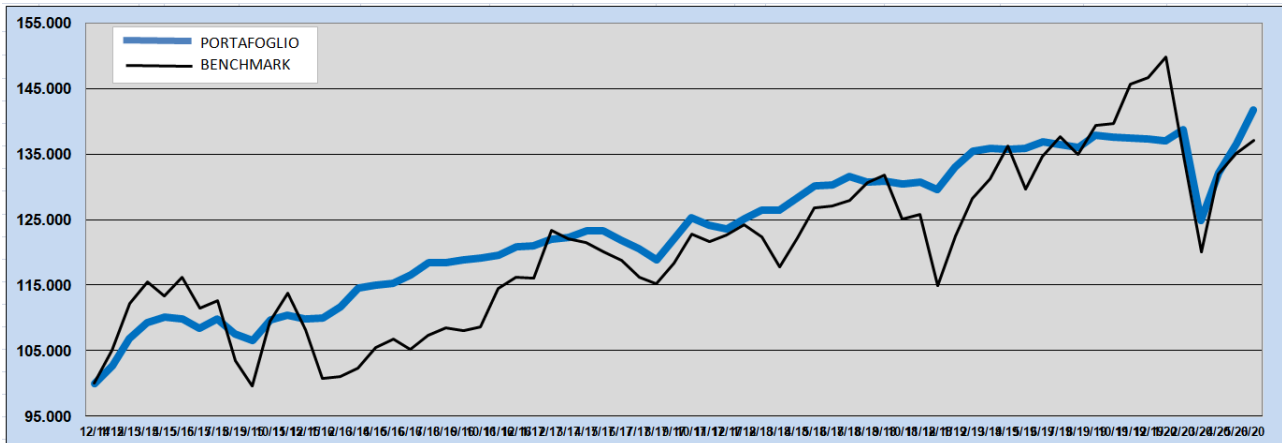
## REPORT al 30 giugno 2020

Il mese di giugno si è chiuso con una performance del +3,70% (+3,25% da inizio anno), mentre il benchmark si è fermato al +1,45% (-6,58% da inizio anno), permettendo al portafoglio **GLOBAL INDEX** di raggiungere il proprio massimo controvalore storico dalla sua partenza nel 2015. Tutto questo è stato possibile attraverso un accurato utilizzo della liquidità e dei mirati acquisti avvenuti nei momenti più opportuni (anche mediando posizioni in essere), nonostante la débacle di tutte le principali Borse mondiali in questo periodo di prolungata emergenza coronavirus. Anche la volatilità è rimasta sotto controllo e si assesta all'1,94%, nonostante il Drawdown verificatosi in marzo e ampiamente recuperato nei mesi successivi. Per i mesi estivi preferiamo rimanere prudenti e piuttosto liquidi vista la situazione di lateralità/indecisione in cui versano i mercati e la stagionalità statistica non proprio favorevole ad un rialzo delle quotazioni.

### STRATEGY REPORT

GLOBAL	30/06/2020		€	ETF Lyxor Msci WORLD	
Portafoglio			141.703,62		137.051,71
Rendimento dal 1/1/2015			41,70%		37,05%
Profitto (con operazioni aperte)			41.703,62		
Totale operazioni			66		
Operazioni positive			60		
Operazioni negative			6		
Operazioni positive			91%		
Totale guadagni (operazioni chiuse)			42.383,08		
Totali perdite (operazioni chiuse)			-3.939,32		
Profit Factor			10,8		
Rawal			1,08		
Guadagno medio			631,87		
Max DD mensile	10,00%		13.879,80	19,82%	29.695,12
Tempo recupero			3 mesi		n.d.
Volatilità			1,94%		4,14%
Sharpe			21,50		8,89
Rendimento/Rischio			21,50		8,95
Rendimento/Max DD			3,00		1,25

## EQUITY LINE



## PERFORMANCE MENSILI (in %)

	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	Anno
2015	2,72	4,05	2,29	0,72	-0,31	-1,21	1,24	-2,05	-0,95	2,97	0,64	-0,53	9,82
2016	0,10	1,67	2,46	0,43	0,27	1,14	1,52	0,06	0,29	0,30	0,34	1,03	10,01
2017	0,17	0,79	0,29	0,81	0,02	-1,22	-1,04	-1,42	2,81	2,47	-0,83	-0,47	2,31
2018	1,2	1,1	-0,07	1,52	1,44	0,09	0,97	-0,62	0,11	-0,28	0,24	-0,88	4,9
2019	2,63	1,78	0,3	-0,03	0,08	0,66	-0,31	-0,31	1,44	-0,23	-0,07	-0,19	5,85
2020	-0,20	1,35	-10,00	5,81	3,37	3,70							3,25

## ANALISI DELLE PERFORMANCE

I rendimenti positivi sono stati realizzati 44 volte su 66 mensilità (**65%**)

Il Benchmark ETF LYXOR Msci WORLD è stato battuto 29 volte su 66 mensilità (**44%**).

L'equityline è rimasta superiore al Benchmark 49 volte su 66 mensilità (**74%**).

## ASSET ALLOCATION

