

ALFA

Rendimento

Storico rendimenti dal Inizio Storico al 12/12/2020

Grafico Storico



Rendimenti

Portafoglio		YTD	1 Anno	3 Anno	5 Anno	Personalizzato
	Periodo	31/12/2020 - 7/7/2021	7/7/2020 - 7/7/2021	6/7/2018 - 7/7/2021	7/7/2016 - 7/7/2021	-
ALFA		16,19%	42,22%	116,82%	252,32%	-
S&P 500		20,34%	32,22%	56,49%	94,55%	-

Volatilità

Portafoglio		YTD	1 Anno	3 Anno	5 Anno	Personalizzato
	Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/7/2020 - 30/6/2021	31/7/2018 - 30/6/2021	31/7/2016 - 30/6/2021	-
ALFA		15,25%	15,79%	20,02%	16,67%	-
S&P 500		15,12%	12,07%	17,31%	14,51%	-

Volatilità Neg

Portafoglio		YTD	1 Anno	3 Anno	5 Anno	Personalizzato
	Periodo	31/12/2020 - 7/7/2021	7/7/2020 - 7/7/2021	6/7/2018 - 7/7/2021	7/7/2016 - 7/7/2021	-
ALFA		6,38%	8,97%	32,50%	32,50%	-
S&P 500		4,47%	8,30%	33,82%	33,82%	-

Sharpe

Portafoglio		YTD	1 Anno	3 Anno	5 Anno	Personalizzato
	Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/7/2020 - 30/6/2021	31/7/2018 - 30/6/2021	31/7/2016 - 30/6/2021	-
ALFA		1.99	2.34	1.40	1.60	-
S&P 500		2.50	2.34	0.97	1.00	-

Sortino

Portafoglio	YTD	1 Anno	3 Anno	5 Anno	Personalizzato
Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/7/2020 - 30/6/2021	31/7/2018 - 30/6/2021	31/7/2016 - 30/6/2021	-
ALFA	3.01	7.77	2.69	3.24	-
S&P 500	3.81	8.57	1.49	1.62	-

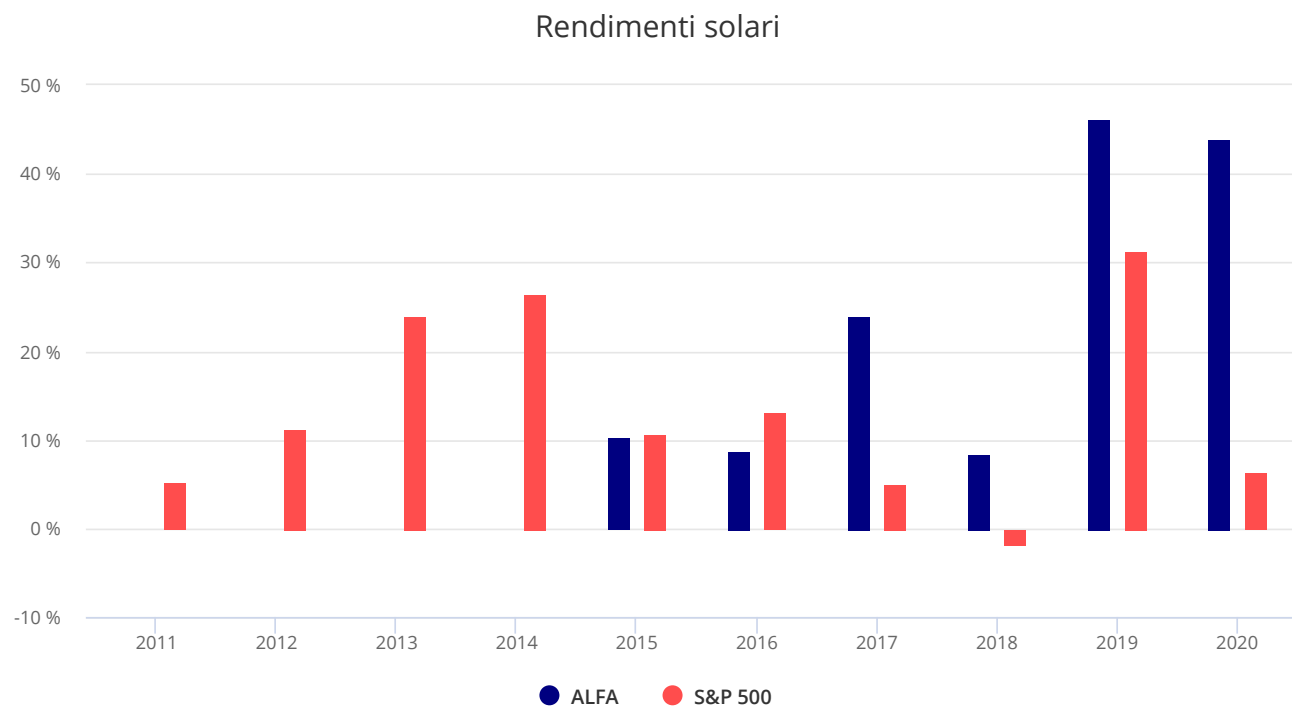
Rendimenti Solari

I risultati passati

Si riportano gli andamenti storici del modello di portafoglio proposto.

Le illustrazioni, naturalmente, sono esclusivamente a titolo informativo e non rappresentano delle previsioni per il futuro.

Simulazione su dati dal Inizio Storico al 12/12/2020



Rendimenti Annuali

Portafoglio		2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2012	2011
	Periodo	31/12/2020 - 7/7/2021	31/12/2019 - 31/12/2020	31/12/2018 - 31/12/2019	29/12/2017 - 31/12/2018	30/12/2016 - 29/12/2017	31/12/2015 - 30/12/2016	1/6/2015 - 31/12/2015		
ALFA		16,19%	43,95%	46,15%	8,44%	24,03%	8,90%	10,37%	-	-
S&P 500		20,34%	6,43%	31,36%	-1,79%	4,96%	13,13%	10,71%	11,21%	5,16%

Volatilità Annuale

Portafoglio		2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2012	2011
	Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/1/2020 - 31/12/2020	31/1/2019 - 31/12/2019	31/12/2017 - 31/12/2018	2/1/2017 - 29/12/2017	31/1/2016 - 30/11/2016	2/6/2015 - 31/12/2015		
ALFA		15,25%	25,25%	13,56%	18,18%	12,30%	9,81%	16,12%	-	-
S&P 500		15,12%	22,69%	11,73%	13,67%	10,63%	10,00%	17,88%	7,11%	26,12%

Volatilità Neg Annuale

Portafoglio		2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2012	2011
	Periodo	31/12/2020 - 7/7/2021	31/12/2019 - 31/12/2020	31/12/2018 - 31/12/2019	29/12/2017 - 31/12/2018	30/12/2016 - 29/12/2017	31/12/2015 - 30/12/2016	1/6/2015 - 31/12/2015		
ALFA		6,38%	32,50%	7,74%	22,76%	6,68%	12,27%	11,48%	-	-
S&P 500		4,47%	33,82%	7,08%	18,65%	10,74%	14,14%	18,49%	7,98%	18,17%

Sharpe Annuale

Portafoglio		2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2012	2011
	Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/1/2020 - 31/12/2020	31/1/2019 - 31/12/2019	31/12/2017 - 31/12/2018	2/1/2017 - 29/12/2017	31/1/2016 - 30/11/2016	2/6/2015 - 31/12/2015		
ALFA		1.99	1.61	2.94	0.49	1.81	0.86	1.11	-	-
S&P 500		2.50	0.41	2.45	Neg	0.54	1.14	0.66	1.92	0.37

Sortino Annuale

Portafoglio		2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2012	2011
	Periodo	1/1/2021 - 7/7/2021	31/1/2020 - 31/12/2020	31/1/2019 - 31/12/2019	31/12/2017 - 31/12/2018	2/1/2017 - 29/12/2017	31/1/2016 - 30/11/2016	2/6/2015 - 31/12/2015		
ALFA		3.01	3.26	16.34	0.73	2.47	1.67	1.54	-	-
S&P 500		3.81	0.63	4.76	Neg	0.79	2.03	1.07	5.21	0.53