

# Comparto SerenItas

## Informazioni

Data analisi: 31 marzo 2019

### Benchmark:

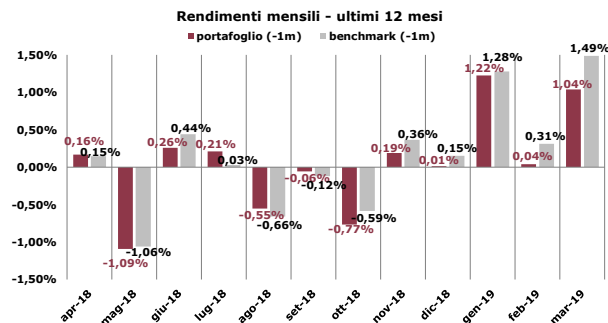
- 5% Ob. Governativo Emu 0-1 anni
- 45% Ob. Governativo Emu all mats
- 15% Ob. Governativo Globale ex Emu all mats. Unhdg
- 25% Ob. Corporate Euro all mats
- 10% Azionario Emu

## Asset allocation

| Asset type Geografico     | PTF (Min. €)  | PTF (%)       | Bmk %         | delta %      |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|
| <b>Liquidità</b>          | <b>7,70</b>   | <b>6,7%</b>   |               | <b>6,7%</b>  |
| <b>Obbligazionario</b>    | <b>92,22</b>  | <b>80,6%</b>  | <b>90,0%</b>  | <b>-9,4%</b> |
| Gov. Emu nomin.           | 52,82         | 46,1%         | 50,0%         | -3,9%        |
| Gov. Globale ex Emu       | 9,74          | 8,5%          | 15,0%         | -6,5%        |
| Gov. Emu Inflation linked | 4,68          | 4,1%          |               | 4,1%         |
| Gov. Emergenti HC         | 1,02          | 0,9%          |               | 0,9%         |
| Corporate Euro            | 23,96         | 20,9%         | 25,0%         | -4,1%        |
| <b>Azionario</b>          | <b>10,16</b>  | <b>8,9%</b>   | <b>10,0%</b>  | <b>-1,1%</b> |
| Emu                       | 10,16         | 8,9%          | 10,0%         | -1,1%        |
| Globale ex Emu            |               |               |               |              |
| <b>Fondi Chiusi</b>       | <b>4,38</b>   | <b>3,8%</b>   | <b>0,0%</b>   | <b>3,8%</b>  |
| Private Debt              | 3,69          | 3,2%          |               | 3,2%         |
| Immobiliare               | 0,69          | 0,6%          |               | 0,6%         |
| <b>Totale</b>             | <b>114,45</b> | <b>100,0%</b> | <b>100,0%</b> | <b>0,0%</b>  |

Nota: Si segnalano i dati considerando la variazione del benchmark in essere da inizio gennaio 2019.

## Rendimenti netti



|                | PTF          | BMK          |
|----------------|--------------|--------------|
| -3 mesi        | 2,31%        | 3,10%        |
| da inizio anno | <b>2,31%</b> | <b>3,10%</b> |
| -12 mesi       | 0,64%        | 1,75%        |
| -5 anni        | 8,69%        | 16,41%       |

### NOTE:

- Rendimenti del portafoglio («PTF») elaborati dai valori quota mensili ed espressi al netto di oneri di gestione e fiscali  
 - Rendimenti del benchmark («BMK») espressi al netto dei soli oneri fiscali, calcolati in funzione della composizione del parametro

I rendimenti passati non sono necessariamente indicativi di quelli futuri.

## Prime 10 posizioni in portafoglio

| Strumento     | Descrizione                           | ISIN         | Milioni €   | %            |
|---------------|---------------------------------------|--------------|-------------|--------------|
| Obbligazioni  | BTP ITALY 2015 0.7% 01/05/20 5Y       | IT0005107708 | 6,6         | 5,7%         |
| Obbligazioni  | BTP ITALY 2017 0.2% 15/10/20 3Y       | IT0005285041 | 6,1         | 5,3%         |
| Obbligazioni  | BTP ITALY 2010 4% 01/09/20 10Y        | IT0004594930 | 3,4         | 3,0%         |
| Obbligazioni  | US TREASURY 1990 8 1/2% 15/02/20 2020 | US912810EE48 | 2,8         | 2,5%         |
| Obbligazioni  | OAT FRANCE 2014 2 1/2% 25/05/30       | FR0011883966 | 2,6         | 2,3%         |
| Obbligazioni  | CAISSE AMORT.DE LA 2012 4% 15/12/25   | FR0011192392 | 2,6         | 2,2%         |
| Obbligazioni  | BTP ITALIA 0.5% 20/04/2023            | IT0005105843 | 2,5         | 2,2%         |
| Obbligazioni  | CTZ ITALY 2018 ZERO 27/11/20 24M      | IT0005350514 | 2,5         | 2,2%         |
| Obbligazioni  | BTP ITALY 1993 9% 01/11/23 30Y        | IT0000366655 | 2,5         | 2,2%         |
| Obbligazioni  | OBLIGACION ESTADO 2011 5.9% 30/07/26  | ES00000123C7 | 2,3         | 2,0%         |
| <b>Totale</b> |                                       |              | <b>34,0</b> | <b>29,7%</b> |