

RISULTATO DI GESTIONE al 30/12/2011

Fondo Pensione Medici

Rendimento al lordo di tasse e commissioni TWR

Totale Patrimonio 0,758 dati in milioni di euro

Portafoglio avviato il 6 Aprile 2006

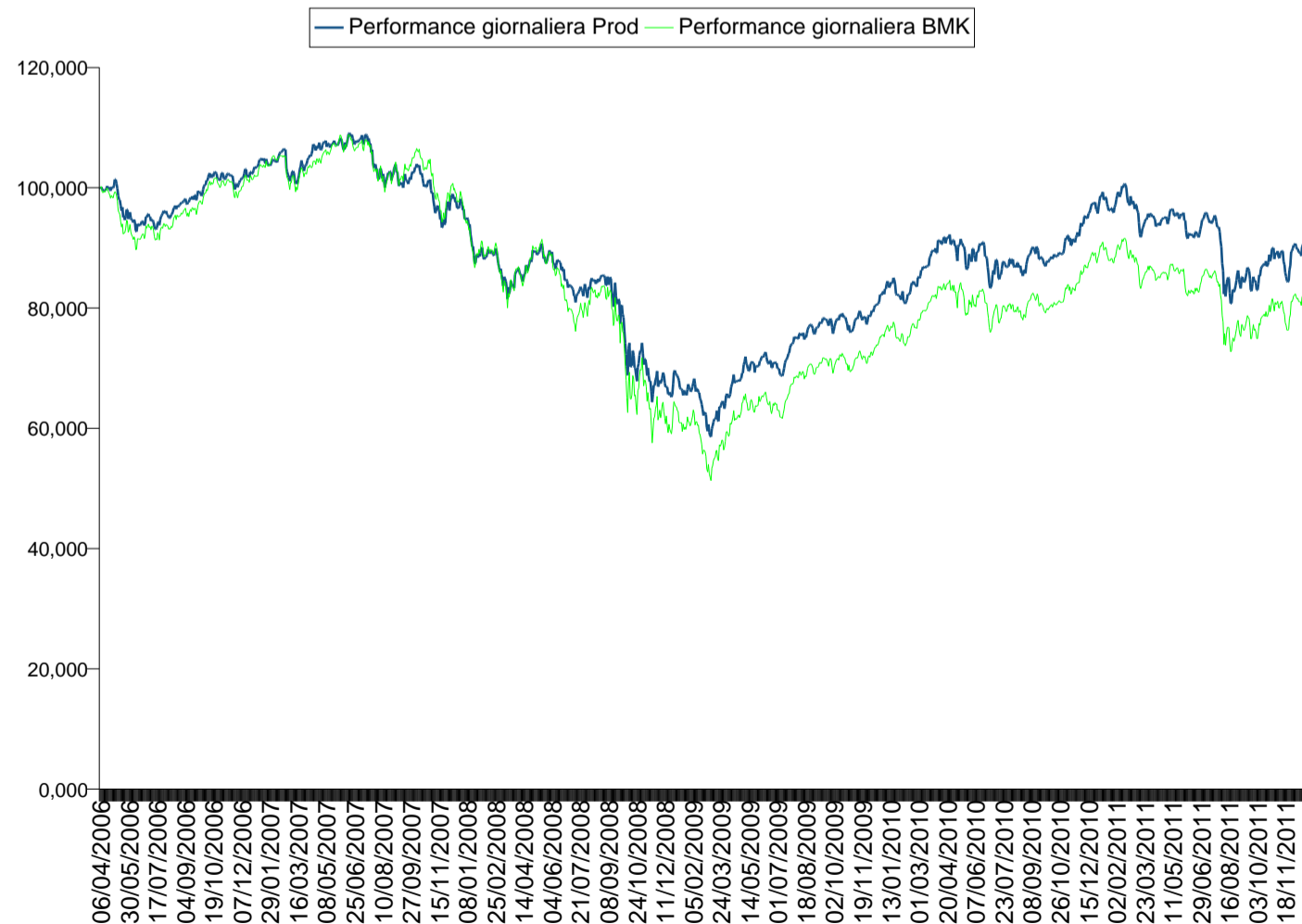
Benchmark:

| | |
|-------------------------------|---------|
| BANCA D'ITALIA LORDO BOT EURO | 5,00 % |
| MSCI WORLD FREE | 95,00 % |

| | Portafoglio(%) | Benchmark(%) | Delta |
|---------------------------------|----------------|--------------|--------|
| Risultato di Gestione | | | |
| Ultimo Mese | 1,882 | 3,391 | -1,509 |
| Ultimo Trimestre | 8,118 | 10,178 | -2,060 |
| Da inizio anno | -5,492 | -4,172 | -1,320 |
| Da inizio gestione | -8,962 | -16,168 | 7,206 |
| Da inizio gestione Annualizzato | -8,962 | -16,168 | 7,206 |

| | Portafoglio(%) | Benchmark(%) |
|--|----------------|--------------|
| Risk-Adjusted Performance (da avvio gestione) | | |
| Volatility | 14,518 | 18,128 |
| Tracking Error volatility | 8,158 | |
| Alfa di Jensen | -0,163 | |
| Beta | 0,719 | |
| Downside Deviation | 6,741 | |
| Downside Volatility | 11,128 | 13,970 |
| Information Ratio | 0,173 | |
| Sharpe Ratio | -0,112 | -0,168 |

Andamento della gestione e del suo obiettivo da inizio gestione



Andamento della gestione e del suo obiettivo da inizio anno

