

Exclusive Insurance - Componente Satellite MSS DIVERSIFIED ALPHA PLUS "Z" ACC



Dati al 30-06-2017

Società di Gestione	MORGAN STANLEY IM LTD (LU)	Divisa	EUR
Categoria	Global Macro Globale	Patrimonio Netto	1.470,92 (mln.) EUR
ISIN	LU0360491038	Valore Quota	29,91
Inizio collocamento	03-06-2008	Spese correnti annue	0,95%

Profilo di Rischio e Rendimento

1 2 3 4 **5** 6 7

Obiettivi e politica d'investimento

L'approccio all'investimento multi-strategia e multi-classe offre agli investitori un'esposizione su una gamma di fonti di alfa, mantenendo un alto grado di diversificazione complessiva, nell'ambito di un metodo di gestione dinamico, con controllo del rischio disciplinato. Investendo in strumenti liquidi di classi di attività diverse, con frequenti interventi di riequilibrio del portafoglio, il comparto DAP segue una filosofia GTAA (allocazione tattica globale delle attività).

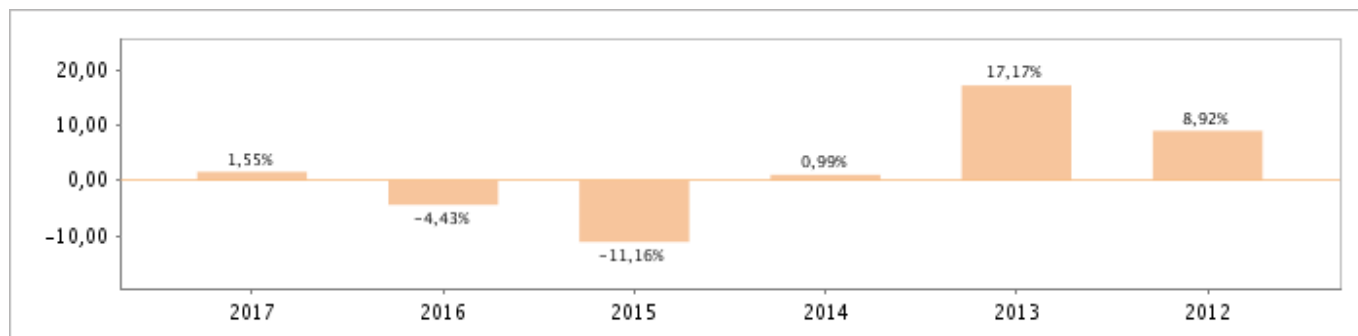
Tutti i calcoli sono in EUR

Andamento dell'OICR



YTD	1 mese	3 mesi	6 mesi	1 anno	3 anni	5 anni
1,55%	0,82%	2,69%	1,55%	3,94%	-12,59%	4,22%

Rendimento annuo dell'OICR



Exclusive Insurance - Componente Satellite MSS DIVERSIFIED ALPHA PLUS "Z" ACC



Dati al 30-06-2017

Principali strumenti finanziari in portafoglio

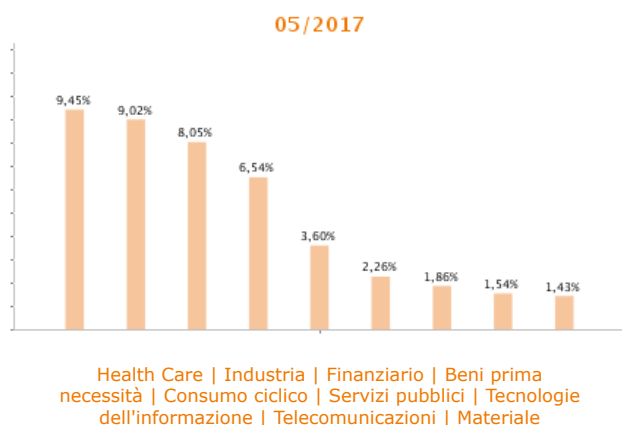
1. CASH	32,25%
2. R USD/LIBOR/3M + 12.00BP	12,27%
3. BRAZIL (FEDERATIVE REPUBLIC OF):10.000 01JAN2023	8,16%
4. R USD/LIBOR/3M	6,58%
5. R JPCMMDEF INDEX	4,84%
6. R USD/LIBOR/3M + 19.00BP	4,08%
7. UNITED STATES TREASURY:0.375 15JAN2027	3,86%
8. BELGIUM (KINGDOM OF):40 5.500 28SEP2017	3,43%
9. R USD -1.38000	3,29%
10. BELGIUM (KINGDOM OF):63 3.500 28JUN2017	3,29%

Composizione del portafoglio

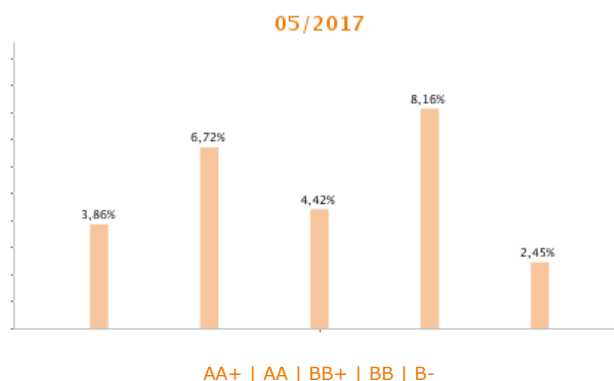


Esposizione Settoriale

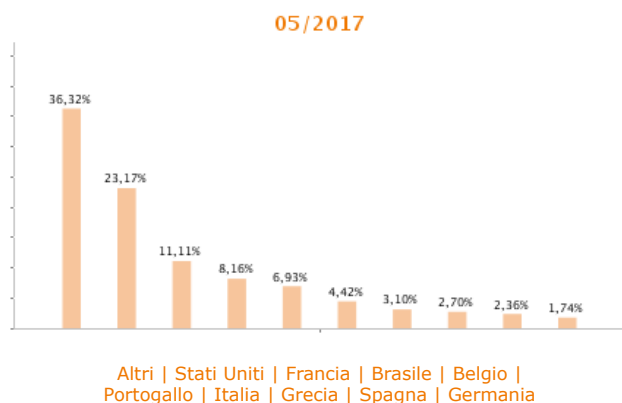
Relativa alla componente azionaria del Portafoglio



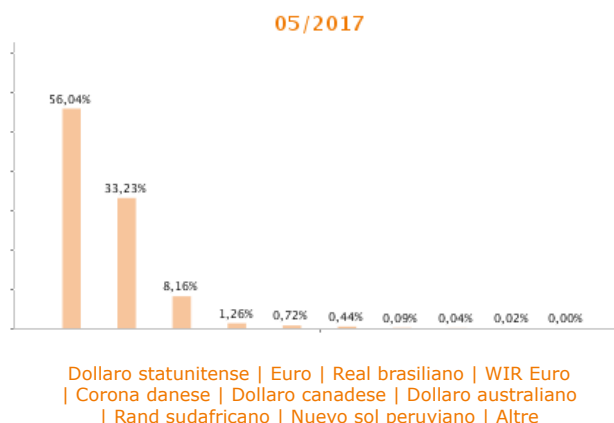
Rating



Esposizione geografica



Esposizione valutaria



I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri. I dati di rendimento dell'OICR non includono i costi di sottoscrizione a carico dell'investitore. La performance dell'OICR riflette gli oneri gravanti sullo stesso ed è al lordo degli oneri fiscali vigenti. Le informazioni contenute hanno valore puramente indicativo e non sono sostitutive di quelle risultanti dall'estratto conto annuale trasmesso dalla Compagnia o dalle conferme di ogni singola operazione sempre inviate dalla Compagnia.

Documento ad uso esclusivo del Gruppo Intesa Sanpaolo.

Fonte: Allfunds Bank S.A. Informazioni – Esattezza e contenuti di terzi: Allfunds Bank S.A. (di seguito, "Allfunds") adotta la massima diligenza possibile al fine di selezionare le fonti di provenienza dei contenuti. Allfunds non offre alcuna garanzia, espressa o implicita, né esprime alcuna dichiarazione in merito all'esattezza, adeguatezza o possibilità di accedere a detti contenuti, alla disponibilità degli stessi o al loro utilizzo. Si precisa che Allfunds non ha verificato direttamente le informazioni ottenute dalle varie fonti e non garantisce quindi che esse siano esatte, precise o esaustive. Sebbene Allfunds faccia il possibile per fornire informazioni esatte e puntuali, non ne può garantire l'esattezza, la tempestività, la completezza, l'utilità né altri aspetti legati a dette informazioni. Allfunds non sarà pertanto

responsabile, di nessuno dei suddetti contenuti. Le informazioni sono fornite unicamente a scopo informativo. Allfunds non risponderà di alcuna perdita né di alcun danno che possa derivare agli utenti che abbiano fatto affidamento su tali informazioni.

