

RatioLab

RatioLab è il modulo autonomo di ricerca, analisi e valutazione quantitativa degli strumenti finanziari e dei portafogli con gli stessi formulabili contenuto in **FeeOnly4You**.



Il progetto

RatioLab è un grande archivio, potente e fruibile, nel quale sono contenuti tutti i dati riferibili agli strumenti finanziari dotati di codice ISIN con particolare riferimento all'universo degli OICR.

Oltre ai dati meramente quantitativi **RatioLab** contiene una descrizione estremamente particolareggiata del prodotto anche sotto l'aspetto qualitativo: l'aggiornamento della componente geo/settoriale e valutaria o del merito creditizio, della duration e della sensibilità agli spread consentono, per esempio, di valutare in modo appropriato ed efficace la reale diversificazione attuata in un portafoglio complesso.

Sotto l'aspetto funzionale **RatioLab** si propone come pannello di controllo delle attività di analisi fra cui:

ricerca e selezione dei prodotti all'interno di tutte le categorie desiderabili (per aree, settori, valute, stili, capitalizzazione, copertura ai cambi, rating, duration ecc.)



ordinamento veloce dei prodotti selezionati per tutti i parametri valutativi graditi all'utente e per qualsiasi orizzonte temporale

		1y
-11,7	-1,7	
-11,8	-1,7	
-14,7	-4,4	
-8,8	-6,6	-0,01
-12,1	-11,7	-0,28
-7,6	-8,0	

analisi e confronto immediato fra prodotti e benchmark (anche composito) con particolare dettaglio su rischio, efficienza e costi

Analisi comparativa	Valutab	ISIN code	Carbore	Size€	M.Fee	TER	P.Fee	N.oms
Vont-A2 GI.Eq(€:U)†								
Msci World Index								
Carnignac Investment								

DATI STORICI	Ultimi 3 mesi			Ultimi 5 anni					med B	Caratteristiche degli ultimi 36 mesi							
	apr	mar	feb	2008	2007	2006	2005	2004	%Sa	dr	S+	< 0	corr	beta	S+	S-	alfa
		-7,41	-0,63	-12,7													
		-5,39	-3,19	-10,8	-3,4												
		-8,34		-3,6													

composizione e valutazione di portafogli, analisi comparativa immediata fra portafogli esistenti/proponibili e benchmark sulla base di un set completo di indicatori statistici

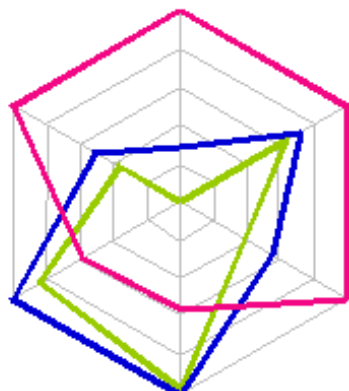
%	Benchmark	%	devst	min	max	< 0	down	Shape	correl	beta	S+	S-	alfa	Ripartizione classi di attivo
				-8,9				-0,00						
				-2,7				-0,13						
				-1,5										
100	Benchmark	10,7	5,2	-3,3	4,0	18	4,6	-0,02	100	100	100	100		

%	Portafoglio X	%	devst	min	max	< 0	down	Shape	correl	beta	S+	S-	alfa	Ripartizione classi di attivo
				-9,2										
				-8,4										
								-0,00				-0,03		
				-3,7								-6		
				-2,8								-0,16		
				-1,4				-0,00						
				-2,4				-0,01						
				-0,6										
				-13,1										
100	Portafoglio X	34,3	5,6	-4,2	4,0	12	4,6	0,86	86	92	125	51	0,43	

memorizzazione ed aggiornamento giornaliero dei portafogli valutati e proposti per scenari "what if"

reportistica di qualità professionale ad elevata capacità comunicativa.

Radar



Orizzonte indagato	36 mesi		
	Bench		
Incremento %	43,0	29,4	96,3
Mese peggiore	-4,72	-5,62	-7,17
Mesi negativi	11	11	12
Downside risk annuale	6,3	7,5	10,9
Ter mensile	0,84		3,63
Sensib. rialzi	111	100	155
Alfa mensile	0,34		1,21
Information ratio	0,33		0,32

supporto di un **ottimizzatore parametrico** i cui vincoli sono determinabili dall'utente

Vincoli di sorveglianza:

Vincoli di diversificazione:

RatioLab è accessibile via web in modo immediato da qualsiasi postazione e rappresenta uno strumento di lavoro confortevole e propedeutico alla prassi della consulenza indipendente. Sotto l'aspetto professionale **RatioLab** è il "pensatoio" in cui mettere alla prova i portafogli e le proprie idee, ricercare prodotti grazie a cui conseguire riduzioni della volatilità o mantenere una forte correlazione con le referenze ed il profilo di rischio del cliente.

