

INDICI & NUMERI

EXCHANGE TRADED FUND

a cura di  Consultique
Fee-Only Financial Planners

GUIDA ALLA LETTURA

L'insieme dei dati quantitativi e qualitativi sugli Etf, Etc, Etn, confluisce in un indicatore sintetico delle qualità dello strumento: il Rating Consultique, espresso con un numero di stelle (da uno a cinque). Il Rating Consultique tiene conto dei seguenti indicatori: le commissioni totali annue (Ter), la liquidità (spread bid-ask ratio) e indicatori che misurano la bontà della replica del benchmark quali l'Excess return (extrarendimento dello strumento rispetto al benchmark) e il Tracking error (volatilità dei differenziali Excess return). I punteggi delle suddette variabili sono sintetizzati in un unico indice attraverso l'utilizzo di metodi quantitativi. Il Rating è basato su un giudizio assoluto e non relativo all'eventuale classe di appartenenza. Infatti, ad esempio, nulla vieta che nemmeno uno strumento raggiunga le 5 stelle. Quindi vengono assegnate 5 stelle (il massimo Rating) solo agli strumenti che rispetteranno tutti i target stabiliti. Note metodologiche: 1) l'attribuzione del rating è vincolata sia all'esistenza dello strumento sul mercato di quotazione di Borsa Italiana da almeno 6 mesi, sia alla possibilità di poterlo confrontare in maniera tecnicamente corretta con il benchmark di riferimento; 2) lo spread bid-ask ratio è calcolato su una base temporale di 3 mesi con cadenza ogni 30 minuti e viene riportato solo per gli strumenti quotati da almeno 6 mesi; 3) il controvalore medio scambiato è calcolato sugli ultimi 30 giorni di quotazione, per cui non vengono riportati dati per quegli strumenti quotati da meno di un mese; 4) la liquidità di un Etf/Etc/Etn rilevata riguarda esclusivamente il mercato secondario (principalmente retail); sul mercato primario i soggetti istituzionali possono avvantaggiarsi di spread ratio ancora più contenuti; 5) per alcuni strumenti la minore liquidità dei titoli componenti il paniere replicato si riflette in un bid-ask più ampio,

questo vale soprattutto per gli Etf sui paesi emergenti o sui cosiddetti panieri tematici.

Note sulla modalità di replica: 1) Replica Fisica Completa: l'Etf acquista tutti i titoli componenti l'indice da replicare. 2) Replica Fisica a Campione/Ottimizzata: l'Etf acquista una parte significativa dei titoli componenti l'indice da replicare. Per la replica fisica è possibile che il fondo preli ad una controparte esterna una parte o la totalità dei titoli detenuti in portafoglio. La remunerazione ricevuta in cambio consente all'Etf di ridurre il Ter. Il rischio controparte che emerge dall'operazione può essere mitigato mediante una collateralizzazione sui titoli prestati. 3) Replica Sintetica Funded: l'Etf stipula di un contratto swap con una o più controparti selezionate, in base al quale il fondo trasferisce ad esse il denaro derivante dalle sottoscrizioni vedendosi riconoscere in contropartita la performance total return del benchmark (meno il costo dello swap se previsto). Il rischio controparte viene contestualmente mitigato tramite l'apporto da parte della controparte swap di un collaterale. 4) Replica Sintetica Unfunded: la replica dell'indice di riferimento avviene attraverso una strategia di investimento che prevede l'utilizzo del denaro derivante dalle sottoscrizioni per l'acquisto di un paniere di titoli e l'ingresso in un contratto di swap con una controparte selezionata che riconosce all'Etf le performance total return dell'indice di riferimento (meno il costo dello swap se previsto) in contropartita del rendimento del paniere sostitutivo.

Note sulla compilazione: (N/P - non pervenuto) qualora il dato sulla modalità di replica non sia stato inviato dall'emittente; (*) i dati indicati sono espressione di un dato medio di periodo (variabile a seconda dell'emittente).

| STRUMENTO | RATING 1-5 STELLE | COMM TOT % ANNO | SPREAD BID/ASK % | CTV MEDIO 30GG € | PERF ANNO % |
|-------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|---------------------------|-------------------|
| AZIONARIO | | | | | |
| EMERGENTE | | | | | |
| iShares MSCI Emerging Markets Dist (IE00B0M63177) [] | ★★★★ | 0,75 | 0,03 | 6222353 | 6,9659 |
| iShares MSCI Emerging Markets Dist (IE00B0M63177) [] | ★★★★ | 0,75 | 0,03 | 6222353 | 6,9659 |
| Lyxor MSCI Emerging Markets ETF C-EUR (FR0010429068) | ★★★★ | 0,55 | 0,01 | 2779538 | 6,7237 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers MSCI Emerging Markets 1C (LU0292107645) | ★★★★ | 0,65 | 0,03 | 2714634 | 6,5448 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (101,44%) Swap (-1,44%)] | | | | | |
| Amundi ETF MSCI Emerging Markets EUR A/I (FR0010959676) | ★★★★ | 0,01 | 0,01 | 2698299 | 7,1251 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,64%) Swap (-0,64%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Russia (DJ Russia GDR) C-EUR (FR0010326140) | ★★★★ | 0,65 | 0,12 | 1735302 | 21,1132 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| iShares Core MSCI EM IMI USD Acc (IE00BKM4GZ66) | ★★★★ | 0,25 | 0,05 | 1579031 | 6,9833 |
| [N/P] | | | | | |
| Lyxor ETF MSCI India C-EUR (FR0010361683) | ★★★★ | 0,85 | 0,03 | 1399178 | -1,3224 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor China Enterprise (HSCEI) ETF C-EUR (FR0010204081) | ★★★★ | 0,65 | 0,44 | 692286 | 2,6421 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers MSCI EM Asia 1C (LU0292107991) | ★★★★ | 0,65 | 0,1 | 569450 | 5,2708 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (102,17%) Swap (-2,17%)] | | | | | |
| iShares Core MSCI Pacific ex-Jpn USD Acc (IE00B52MJY50) | ★★★★ | 0,2 | 0,28 | 561344 | 10,3329 |
| [N/P] | | | | | |
| iShares MSCI AC Far East ex-Japan (IE00B0M63730) [] | ★★★★ | 0,74 | 0,13 | 525744 | 6,4468 |
| iShares MSCI AC Far East ex-Japan (IE00B0M63730) [] | ★★★★ | 0,74 | 0,13 | 525744 | 6,4468 |
| iShares MSCI Emerging Markets (Acc) (IE00B4L5YC18) [] | ★★★★ | 0,68 | 0,07 | 498880 | 7,2072 |
| iShares MSCI Emerging Markets (Acc) (IE00B4L5YC18) [] | ★★★★ | 0,68 | 0,07 | 498880 | 7,2072 |
| iShares MSCI Pacific ex-Japan USD Dist (IE00B4WXJD03) | ★★★★ | 0,6 | 0,17 | 413605 | 9,8808 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (16,47%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| EUROPA | | | | | |
| Lyxor ETF FTSE MIB Daily Db Sh XBear A/I (FR0010446666) | ★★★★ | 0,6 | 0,02 | 11629131 | 22,3892 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF FTSE MIB A/I (FR0010010827) | ★★★★ | 0,35 | 0,02 | 10601773 | -22,9721 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF FTSE MIB Daily Leveraged A/I (FR0010446658) | ★★★★ | 0,6 | 0,01 | 9743814 | -46,9546 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor Euro Stoxx 50 DR ETF D-EUR A/I (FR0007054358) | ★★★★ | 0,2 | 0,02 | 9740809 | -9,8869 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (-)] | | | | | |
| Lyxor DAX (DR) ETF (LU0252633754) | ★★★★ | 0,15 | 0,09 | 9667678 | -7,0438 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (-)] | | | | | |
| iShares EURO STOXX 50 Dist (IE0008471009) | ★★★★ | 0,35 | 0,02 | 6777326 | -9,428 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (5,33%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Lyxor Daily LevDAX ETF (LU0252634307) | ★★★★ | 0,4 | 0,06 | 5054015 | -18,4102 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Boost FTSE MIB 3x Leverage Daily ETP (IE00B8NB3063) | ★★★★ | 0,75 | 0,14 | 4907930 | -67,215 |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 107%] | | | | | |
| Lyxor ETF Euro Stoxx 50 Daily Short A/I (FR0010424135) | ★★★★ | 0,4 | 0,04 | 4286875 | 3,3119 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Banks A/I (FR0010345371) | ★★★★ | 0,3 | 0,16 | 4227724 | -14,5409 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Boost FTSE MIB 3x Short Daily ETP (IE00B873CW36) | ★★★★ | 0,8 | 0,17 | 4184603 | 18,7374 |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 107%] | | | | | |
| iShares STOXX Europe 600 (DE) (DE0002635307) | ★★★★ | 0,2 | 0,03 | 3970448 | -8,4178 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (0,86%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| iShares MSCI Europe Dist (IE00B1YZSC51) | ★★★★ | 0,35 | 0,03 | 3484306 | -7,9594 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (7,09%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Euro Stoxx 50 Dly Dbl Shrt A/I (FR0010424143) | ★★★★ | 0,6 | 0,01 | 3236743 | 2,1788 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers DAX (DR) 1C (LU0274211480) | ★★★★ | 0,09 | 0,11 | 3218132 | -7,0202 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (5,54%) e collaterale (105,32%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Daily ShortDAX x2 C-EUR (FR0010869495) | ★★★★ | 0,6 | 0,01 | 2959714 | -2,8226 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF FTSE MIB Daily Short Bear A/I (FR0010446146) | ★★★★ | 0,6 | 0,03 | 2786040 | 15,2928 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Euro Stoxx Banks C-EUR (FR0011645647) | ★★★★ | 0,3 | 0,16 | 2505651 | -20,828 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| iShares FTSE MIB EUR Dist (IE00B1XNH568) | ★★★★ | 0,35 | 0,01 | 2263622 | -23,0254 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (12,45%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| ETFS 3x Daily Long FTSE MIB ETC (JE00B8DVWVK97) | ★★★★ | 0,77 | 0,05 | 2185931 | -67,6385 |
| [N/P] | | | | | |
| db x-trackers Euro Stoxx 50 (DR) 1C (LU0380865021) | ★★★★ | 0,09 | 0,09 | 1620520 | -9,7808 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (2,5%) e collaterale (105,15%)] | | | | | |
| ETFS 3x Daily Short FTSE MIB ETC (JE00B894R074) | ★★★★ | 0,77 | 0,1 | 1566218 | 16,0494 |
| [N/P] | | | | | |
| UBS ETF MSCI EMU EUR A dis (LU0147308422) | ★★★★ | 0,18 | 0,65 | 1518864 | -7,6621 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (9,85%) e collaterale (108,18%)] | | | | | |
| Boost EURO STOXX Banks 3x Short Dly ETP (IE00BLS09P63) | ★★★★ | 0,69 | 1510289 | -25,0111 | |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 107%] | | | | | |
| iShares STOXX Europe 50 (IE0008470928) | ★★★★ | 0,35 | 0,06 | 1467803 | -10,603 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (9,43%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Amundi ETF Euro Stoxx 50 DR EUR C (FR0010654913) | ★★★★ | 0,04 | 1413843 | -9,9075 | |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (99,81%) Swap (0,19%)] | | | | | |
| Boost EURO STOXX Banks 3x Lvrg Dly ETP (IE00BLS09N40) | ★★★★ | 0,15 | 1341144 | -72,0381 | |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 107%] | | | | | |
| iShares Core DAX® (DE) (DE0005933931) | ★★★★ | 0,16 | 0,08 | 1312140 | -6,6695 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (0,39%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Technol A/I (FR0010344796) | ★★★★ | 0,3 | 0,65 | 1257208 | -4,4439 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Source EURO STOXX 50 ETF (IE00B605WX25) | ★★★★ | 0,15 | 0,09 | 1228913 | -9,9094 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (95,5% Min Swap 4,5% Max*) | | | | | |
| Lyxor ETF Euro Stoxx 50 Daily Levrg A/I (FR0010468983) | ★★★★ | 0,4 | 0,03 | 1216009 | -23,9871 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Amundi ETF FTSE MIB A/I (FR0010892208) | ★★★★ | 0,04 | 1177009 | -22,9869 | |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,03%) Swap (-0,03%)] | | | | | |

| STRUMENTO | RATING 1-5 STELLE | COMM TOT % ANNO | SPREAD BID/ASK % | CTV MEDIO 30GG € | PERF ANNO % |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------|------------------------|---------------------------|-------------------|
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Basic Res A/I (FR0010345389) | ★★★★ | 0,3 | 0,39 | 937476 | 43,0551 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| UBS ETF MSCI Swtzl 20/35 CHF A acc (LU0977261329) | ★★★★ | 0,2 | 0,07 | 915009 | -8,0251 |
| [N/P] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 HlthC A/I (FR0010344879) | ★★★★ | 0,3 | 0,98 | 833524 | -13,8724 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF MSCI Europe D-EUR A/I (FR0010261198) | ★★★★ | 0,25 | 0,14 | 791857 | -8,0137 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| iShares Core EURO STOXX 50 EUR Acc (IE00B53L3W79) | ★★★★ | 0,1 | 0,08 | 769128 | -9,6846 |
| [N/P] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Utilities A/I (FR0010344853) | ★★★★ | 0,3 | 0,47 | 767871 | -12,9507 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers MSCI Europe (DR) 1C (LU0274209237) | ★★★★ | 0,3 | | 763339 | -7,8833 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (9,16%) e collaterale (119,34%)] | | | | | |
| db x-trackers Swiss Large Cap (DR) 1D (LU0274221281) | ★★★★ | 0,3 | | 758162 | -9,2915 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (4,29%) e collaterale (112,15%)] | | | | | |
| db x-trackers Euro Stoxx 50 Short Dly 1C (LU0292106753) | ★★★★ | 0,4 | 0,02 | 728239 | 2,9596 |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 121,69%] | | | | | |
| iShares FTSE MIB EUR Acc (IE00B53L4X51) | ★★★★ | 0,33 | 0,07 | 717191 | -23,1125 |
| [N/P] | | | | | |
| iShares EURO Dividend (IE00B0M62572) | ★★★★ | 0,4 | 0,15 | 699217 | 0,2242 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (8,2%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Amundi ETF MSCI Europe C (FR0010655696) | ★★★★ | 0,19 | 692858 | -7,9897 | |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,14%) Swap (-0,14%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Oil & Gas A/I (FR0010344960) | ★★★★ | 0,3 | 0,36 | 634926 | 6,176 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers Euro Stoxx 50 (DR) 1D (LU0274212171) | ★★★★ | 0,09 | 629807 | -9,8145 | |
| [Fisica Completa: prestito titoli (2,5%) e collaterale (105,15%)] | | | | | |
| db x-trackers FTSE MIB (DR) 1D (LU0274212538) | ★★★★ | 0,3 | 0,03 | 561434 | -23,2317 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (26,77%) e collaterale (107,99%)] | | | | | |
| db X-Trackers Stoxx Europe 600 Ucits Etf DR (LU0328475792) | ★★★★ | 0,2 | 0,11 | 500317 | -8,4543 |
| [Sintetica Funded: Non presente] | | | | | |
| Lyxor ETF FTSE 100 C-GBP (FR0010438127) | ★★★★ | 0,15 | 0,02 | 449925 | -7,9662 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Food&Bvrg A/I (FR0010344861) | ★★★★ | 0,3 | 0,67 | 438921 | -11,739 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| db x-trackers ShortDAX Daily 1C (LU0292106241) | ★★★★ | 0,4 | 0,04 | 427777 | 0,1544 |
| [Sintetica Funded: con Swap (100%) collaterale 121,67%] | | | | | |
| iShares Core FTSE 100 GBP Dist (IE0005042456) | ★★★★ | 0,07 | 0,01 | 418809 | -7,9021 |
| [Fisica Completa: prestito titoli (3,72%) e collaterale (102,5%-112%)] | | | | | |
| Lyxor ETF Stoxx Europe 600 Auto&Prts A/I (FR0010344630) | ★★★★ | 0,3 | 0,81 | 396418 | -14,4584 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| GIAPPONE | | | | | |
| iShares MSCI Japan EUR Hedged Acc (IE00B42Z5J44) [] | ★★★★ | 0,64 | 0,66 | 3146455 | -6,3804 |
| iShares MSCI Japan EUR Hedged Acc (IE00B42Z5J44) [] | ★★★★ | 0,64 | 0,66 | 3146455 | -6,3804 |
| iShares MSCI Japan Dist (IE00B02KXK56) [] | ★★★★ | 0,59 | 0,08 | 1361522 | 2,2887 |
| iShares MSCI Japan Dist (IE00B02KXK56) [] | ★★★★ | 0,59 | 0,08 | 1361522 | 2,2887 |
| iShares Core MSCI Japan IMI USD Acc (IE00B4L5YX21) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,09 | 1357125 | 3,7211 |
| iShares Core MSCI Japan IMI USD Acc (IE00B4L5YX21) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,09 | 1357125 | 3,7211 |
| Lyxor Japan TOPIX DR ETF D-EUR A/I (FR0010245514) | ★★★★ | 0,45 | 0,42 | 612182 | 3,2949 |
| [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | | | | | |
| GLOBALE | | | | | |
| iShares MSCI World USD Dist (IE00B0M62Q58) [] | ★★★★ | 0,5 | 0,03 | 3455313 | 3,2333 |
| iShares MSCI World USD Dist (IE00B0M62Q58) [] | ★★★★ | 0,5 | 0,03 | 3455313 | 3,2333 |
| iShares Core MSCI World USD Acc (IE00B4L5Y983) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,03 | 2886355 | 3,3796 |
| iShares Core MSCI World USD Acc (IE00B4L5Y98 | | | | | |

INDICI & NUMERI

EXCHANGE TRADED FUND

| STRUMENTO | RATING | COMM | SPREAD | CTV | PERF |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|---------|---------|----------|
| | 1-5 | TOT % | BID/ASK | MEDIO | ANNO |
| | STELLE | ANNO | % | 30GG | % |
| db x-trackers S&P 500 Inverse Daily 1C (LU0322251520) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 121,68%)] | ★★★★ | 0,5 | 0,02 | 647854 | -9,8064 |
| Source Utilities S&P US Select Sect ETF (IE00B3VPK853) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (95,5% Min Swap 4,5% Max*)] | ★★★★ | 0,3 | 0,59 | 588633 | 13,162 |
| Ossiam US Minimum Var NR ETF 1C EUR (LU0599612685) [N/P] | ★★★★ | 0,65 | 0,48 | 577572 | 8,7319 |
| iShares MSCI North America (IE00B14X4M10) [] iShares MSCI North America (IE00B14X4M10) [] | ★★★★ | 0,4 | 0,06 | 490790 | 7,5125 |
| Source Russell 2000 ETF (IE00B60SX402) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (95,5% Min Swap 4,5% Max*)] | ★★★★ | 0,45 | 0,13 | 431004 | 11,7446 |
| Amundi ETF NASDAQ-100 EUR A/I (FR0010892216) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,18%) Swap (-0,18%)] | ★★★★ | 0,1 | | 391077 | 4,4833 |
| OBBLIGAZIONARIO | | | | | |
| AGGREGATO | | | | | |
| iShares ? Aggregate Bond EUR Dist (IE00B3DKXQ41) [] iShares ? Aggregate Bond EUR Dist (IE00B3DKXQ41) [] | ★★★★ | 0,25 | 0,08 | 625642 | 1,6316 |
| DEBITO ALTO RENDIMENTO | | | | | |
| iShares ? High Yield Corp Bond EUR Dist (IE00B66F4759) [] iShares ? High Yield Corp Bond EUR Dist (IE00B66F4759) [] | ★★★★ | 0,5 | 0,17 | 3020813 | 3,355 |
| iShares \$ High Yld Corp Bd USD Dist JDR (IE00B4PY7Y77) [N/P] | ★★★★ | 0,5 | 0,2 | 1733895 | 9,69 |
| PIMCO ST HY Corp Bd Sour ETF Inc EURH (IE00BF8HV600) [Fisica Completa] | ★★★★ | | 0,3 | 1019684 | 8,9679 |
| Lyxor ETF iBoxx ? Liq HY 30 Ex-Fin A/I (FR0010975771) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,45 | 0,41 | 1016909 | 4,4982 |
| SPDR® Barclays Euro High Yield Bond ETF (IE00B6YXSM31) [Fisica a Campione] | ★★★★ | 0,4 | 0,19 | 613711 | 4,6395 |
| Amundi ETF Euro HY Liquid Bd Iboxx C (FR0011494822) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,15%) Swap (-0,15%)] | ★★★★ | | 0,19 | 521459 | 4,5566 |
| iShares \$ Sht Dur HiYld Corp Bd USD Dist (IE00BCRY6003) [N/P] | ★★★★ | 0,45 | 0,2 | 450486 | 7,9592 |
| DEBITO GOVERNATIVO | | | | | |
| iShares Euro Government Bond 3-5yr (IE00B1FZ5681) [Fisica Completa: prestito titoli (45,31%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,1 | 7132690 | 0,3383 |
| Lyxor ETF Daily Double Short Bund A/I (FR0010869578) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,02 | 6741354 | -10,0449 |
| Lyxor ETF Daily Double Short BTP A/I (FR0011023621) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,4 | 0,02 | 5725174 | 0,9379 |
| Lyxor ETF EuroMTS 1-3Y InvstGrd DR A/I (FR0010222224) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,17 | 0,07 | 4129175 | -0,1661 |
| Lyxor ETF EuroMTS 3-5Y InvstGrd DR A/I (FR0010037234) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,17 | 0,09 | 3897216 | 0,3949 |
| iShares \$ Treasury Bond 1-3yr (IE00B14X4S71) [Fisica Completa: prestito titoli (46,97%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,12 | 2977272 | 0,5701 |
| iShares Euro Government Bond 1-3yr (IE00B14X4Q57) [Fisica Completa: prestito titoli (32,65%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,23 | 1768350 | -0,2133 |
| Lyxor ETF Daily Leveraged BTP A/I (FR0011023639) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,4 | 0,21 | 1331504 | -4,1966 |
| iShares Italy Govt Bond EUR Dist (IE00B7LW6Y90) [] iShares Italy Govt Bond EUR Dist (IE00B7LW6Y90) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,66 | 1287503 | -1,5946 |
| UBS ETF Barcl Cap US 1-3 Trea Bd USD A (LU0721552544) [Fisica Completa] | ★★★★ | 0,2 | 0,06 | 1230655 | 0,5384 |
| Lyxor ETF Daily Dbl Shrt 10Y US Trsr C-\$ (FR0011607084) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,07 | 1160184 | -0,75 |
| Boost Bund 10Y 3X Short Daily ETP (IE00BKS8QN04) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | 0,3 | 0,13 | 923776 | -14,8279 |
| Lyxor ETF Daily Leveraged Bund A/I (FR0011023654) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,12 | 897913 | 8,5083 |
| Lyxor ETF EuroMTS AM InvstGrd DR A/I (FR0010028860) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,17 | 0,17 | 858713 | 1,2583 |
| Amundi ETF GvtBd LR EuroMTS IG C (FR0010892190) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,07%) Swap (-0,07%)] | ★★★★ | | 0,15 | 792299 | 1,1228 |
| iShares Core UK Gilts GBP Dist (IE00B1FZ5B30) [] iShares Core UK Gilts GBP Dist (IE00B1FZ5B30) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,03 | 760265 | -11,4965 |
| Boost BTP 10Y 5x Short Daily ETP (IE00BYNKN522) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | 0,99 | 0,31 | 665315 | -0,6822 |
| iShares \$ Treasury Bond 7-10yr (IE00B1FZ5798) [Fisica Completa: prestito titoli (47,48%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,2 | 652205 | 0,5605 |
| iShares ? Govt Bond 5-7yr EUR Dist (IE00B4WXJG34) [Fisica Completa: prestito titoli (28,36%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,1 | 651306 | 0,5708 |
| Lyxor iBoxx \$ Trsurs 1-3Y (DR) ETF D USD (LU1407887162) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,07 | 0,19 | 649817 | 0,6004 |
| iShares Euro Government Bond 7-10yr (IE00B1FZ5806) [Fisica Completa: prestito titoli (39,75%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,15 | 590778 | 1,3346 |
| iShares ? Govt Bond 3-7yr EUR Acc (IE00B3VTML14) [N/P] | ★★★★ | 0,2 | 0,17 | 553822 | 0,3724 |
| iShares Core ? Govt Bond EUR Dist (IE00B4WXJJ64) [] iShares Core ? Govt Bond EUR Dist (IE00B4WXJJ64) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,09 | 473478 | 1,2478 |
| Amundi ETF GvtBd EuroMTS Broad Inv Grd 10-15 (FR0010754143) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,06%) Swap (-0,06%)] | ★★★★ | | 0,18 | 463720 | 1,5362 |
| Amundi ETF GvtBd LR EuroMTS Inv Grd 1-3 (FR0011807015) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,11%) Swap (-0,11%)] | ★★★★ | | 0,05 | 446622 | -0,2508 |
| Boost BTP 10Y 3X Short Daily ETP (IE00BKS8QM96) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | 0,6 | 0,22 | 436379 | 0,5375 |
| Amundi ETF ShtGvtEuroMTS Brd Inv Grd 10-15Dly (FR0010823385) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,37%) Swap (-0,37%)] | ★★★★ | | 0,1 | 411898 | -2,8266 |
| Lyxor ETF MTS BTP 1-3Y Italy GovBd DR C? (FR0011313741) [Fisica Completa] | ★★★★ | 0,17 | 0,07 | 394016 | -0,5101 |
| Amundi ETF GvtBd EuroMTS Broad Inv Grd 1-3 (FR0010754135) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,19%) Swap (-0,19%)] | ★★★★ | | 0,07 | 381746 | -0,1648 |
| db x-trackers II Global Sovereign 1C (LU0378818131) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (98,86%) Swap (1,14%)] | ★★★★ | 0,25 | 0,44 | 370059 | 1,7181 |
| DEBITO SOCIETARIO | | | | | |
| iShares Euro Corporate Bond Large Cap (IE0032523478) [] iShares Euro Corporate Bond Large Cap (IE0032523478) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,1 | 5039096 | 2,5861 |
| UBS ETF Barcl US Liq Corp 1-5 HEUR A acc (LU1048315243) [N/P] | ★★★★ | 0,23 | 0,09 | 4913528 | 0,6287 |
| iShares Core ? Corp Bond EUR Dist (IE00B3F81R35) [] iShares Core ? Corp Bond EUR Dist (IE00B3F81R35) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,08 | 3408114 | 3,0326 |
| iShares ? Corp Bond 1-5yr EUR Dist (IE00B4L60045) [] iShares ? Corp Bond 1-5yr EUR Dist (IE00B4L60045) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,1 | 2581307 | 1,6236 |
| Amundi ETF Floating Rate USD Corp USD (FR0012647451) [N/P] | ★★★★ | | 0,09 | 2104709 | 2,0811 |
| iShares \$ Corp Bond USD Dist (IE0032895942) [] iShares \$ Corp Bond USD Dist (IE0032895942) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,15 | 1954338 | 4,3003 |
| Amundi ETF Floating Rate USD Corp HEUR (FR0013141462) [N/P] | ★★★★ | | | 1895386 | |
| iShares ? Ultrashort Bond EUR Dist (IE00BCRY6557) [N/P] | ★★★★ | 0,09 | 0,05 | 1363853 | 0,2113 |
| iShares ? Covered Bond EUR Dist (IE00B388Q275) [] iShares ? Covered Bond EUR Dist (IE00B388Q275) [] | ★★★★ | 0,2 | 0,16 | 1028792 | 0,8276 |
| UBS ETF Barcl US Liq Corp H EUR A acc (LU1048317025) [N/P] | ★★★★ | 0,23 | 0,08 | 1019635 | 2,5726 |
| Lyxor Euro Corporate Bond ETF C-EUR (FR0010737544) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,31 | 918167 | 2,3248 |
| iShares Global Corp Bond USD Dist (IE00B7J7TB45) [N/P] | ★★★★ | 0,2 | 0,22 | 663275 | 2,7139 |
| Lyxor EuroMTS 5-7Y Invst Grd (DR) ETF C? (LU1287023003) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,17 | 0,12 | 608197 | 0,5553 |
| SPDR® Barclays 0-3 Year Euro Corp Bd ETF (IE00B7GZW19) [Fisica a Campione] | ★★★★ | 0,2 | 0,06 | 552053 | 0,671 |
| Amundi ETF Euro Corporates C (FR0010754119) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,35%) Swap (-0,35%)] | ★★★★ | | 0,25 | 508084 | 2,3665 |

| STRUMENTO | RATING | COMM | SPREAD | CTV | PERF |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|---------|---------|----------|
| | 1-5 | TOT % | BID/ASK | MEDIO | ANNO |
| | STELLE | ANNO | % | 30GG | % |
| Amundi ETF Floating Rate Euro Corp 1-3 (FR0012005734) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,17%) Swap (-0,17%)] | ★★★★ | | 0,07 | 496413 | 0,3263 |
| iShares ? Corp Bond Intr Rt H EUR Dist (IE00B6X2VY59) [N/P] | ★★★★ | 0,25 | 0,07 | 455574 | 0,6281 |
| db x-trackers II EUR Crp Bd exFnlS DR 1C (LU0484968655) [basket sostitutivo (95,98%) Swap (4,02%)] db x-trackers II EUR Crp Bd exFnlS DR 1C (LU0484968655) [basket sostitutivo (95,98%) Swap (4,02%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,63 | 442478 | 1,8478 |
| Lyxor EuroMTS 7-10Y InvstGrd (DR) ETF C? (LU1287023185) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,17 | 0,15 | 424144 | 1,1497 |
| EMERGENTE | | | | | |
| iShares JP Morgan \$ EM Bond USD Dist (IE00B2NPKV68) [] iShares JP Morgan \$ EM Bond USD Dist (IE00B2NPKV68) [] | ★★★★ | 0,45 | 0,18 | 3161267 | 6,02 |
| iShares EM Local Govt Bond USD Dist (IE00B5M4WH52) [] iShares EM Local Govt Bond USD Dist (IE00B5M4WH52) [] | ★★★★ | 0,5 | 0,14 | 3028299 | 3,9654 |
| iShares JP Morgan \$ EM Bond EUR H Dist (IE00B9M6RS56) [N/P] | ★★★★ | 0,5 | 0,27 | 1597662 | 4,2426 |
| Amundi ETF Global Emerg Bd Markit iBoxx (FR0010959668) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100,46%) Swap (-0,46%)] | ★★★★ | | 0,38 | 1158238 | 3,7975 |
| Lyxor ETF iBoxx \$ Liquid EM Sovgn A/I (FR0010967323) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,3 | 0,44 | 1117604 | 3,7834 |
| SPDR® Barclays Emerging Mkts Lcl Bd ETF (IE00B4613386) [Fisica a Campione] | ★★★★ | 0,55 | 0,33 | 826666 | 2,7287 |
| db x-trackers II EM Liqd Eurobond 1C (LU0321462953) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (104,87%) Swap (-4,87%)] | ★★★★ | 0,55 | 1,97 | 719335 | 2,7109 |
| INFLAZIONE | | | | | |
| iShares \$ TIPS (IE00B1FZSC47) [Fisica Completa: prestito titoli (43,72%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,25 | 0,46 | 1360391 | 3,3429 |
| iShares ? Inflation Lnkld Govt Bd EUR Acc (IE00B0M6X2X6) [Fisica Completa: prestito titoli (41,32%) e collaterale (102,5%-112%)] | ★★★★ | 0,25 | 0,36 | 1350564 | -0,8651 |
| Lyxor ETF EuroMTS Inflnk InvstGrd DR A/I (FR0010174292) [Fisica Completa: prestito titoli ()] | ★★★★ | 0,2 | 0,23 | 661219 | -0,9014 |
| db x-trackers II iBoxx Euro Infl-Lnkld 1C (LU0290358224) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (99,22%) Swap (0,78%)] | ★★★★ | 0,2 | 0,63 | 487544 | -0,7996 |
| db x-trackers II iBoxx Gbl Infl-Lnkld 1C (LU0290357929) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (99,42%) Swap (0,58%)] | ★★★★ | 0,25 | 0,71 | 381098 | 5,1775 |
| ALTERNATIVO | | | | | |
| VOLATILITÀ | | | | | |
| Lyxor S&P 500 VIX Futs EnhRoll ETF C EUR (LU0832435464) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,6 | 0,31 | 1016050 | -34,8738 |
| Boost S&P500 VIX S/T Futs 2.25x LvgDIETN (IE00BYTYHQ58) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | 0,99 | | 426785 | |
| MONETARIO | | | | | |
| DEBITO GOVERNATIVO | | | | | |
| db x-trackers II Fed Fds Effect Rate 1C (LU0321465469) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (96,7%) Swap (3,3%)] | ★★★★ | 0,15 | 0,44 | 2301776 | 0,1735 |
| Lyxor ETF Euro Cash A/I (FR0010510800) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,1 | 0,01 | 1674756 | -0,3892 |
| Lyxor Smart Cash ETF C EUR (LU1190417599) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,05 | 0,01 | 814188 | -0,1612 |
| db x-trackers II Sterling Cash 1D (LU0321464652) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (99,06%) Swap (0,94%)] | ★★★★ | 0,15 | 0,95 | 456867 | -16,7597 |
| db x-trackers II MTS x-Bnk of Italy BOTTC (LU0613540268) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (98,75%) Swap (1,25%)] | ★★★★ | 0,15 | 0,01 | 409451 | -0,2827 |
| Lyxor Smart Cash ETF C USD (LU1248511575) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,16 | 0,01 | 376934 | |
| VALUTA | | | | | |
| ETFS 3x Long USD Short EUR (IE00B3QQ4551) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (107%) Swap (100%)] | ★★★★ | 0,98 | 0,22 | 1815745 | -0,953 |
| ETFS 5x Long USD Short EUR ETC (IE00BMM1XC77) [N/P] | ★★★★ | 0,98 | 0,34 | 1161199 | -4,1308 |
| ETFS 3x Short USD Long EUR (IE00B3T3K772) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (107%) Swap (100%)] | ★★★★ | 0,98 | 0,14 | 1098495 | -9,2274 |
| ETFS 5x Short USD Long EUR ETC (IE00BMM1XD84) [N/P] | ★★★★ | 0,98 | 0,09 | 708385 | -17,1508 |
| MATERIE PRIME | | | | | |
| AGRICOLTURA | | | | | |
| ETFS Wheat ETC (GB00B15KY765) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,03 | 455489 | -25,1986 |
| ETFS EUR Daily Hedged Wheat ETC (IE00B78NNK09) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 108%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,35 | 395061 | -26,4055 |
| ETFS Agriculture ETC (GB00B15KYH63) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,43 | 383946 | 3,1218 |
| DIVERSIFICATO | | | | | |
| iShares Diversified Commodity Swap (DE) (DE000A0H0728) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (-3,23%) (collaterale NA)] | ★★★★ | 0,46 | 0,82 | 844273 | 4,8442 |
| Lyxor Commodit Thm R/C CRB TR ETF C-EUR (FR0010270033) [Sintetica Unfunded: basket sostitutivo (100%) Swap (0%)] | ★★★★ | 0,35 | 0,49 | 711146 | 1,0471 |
| ENERGIA | | | | | |
| ETFS 2x Daily Long WTI Crude Oil ETC (IE00BDD9Q840) [N/P] | ★★★★ | 1,03 | 0 | 4409964 | -46,0451 |
| ETFS Crude Oil ETC (GB00B15KXV33) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,06 | 3787364 | -18,2741 |
| Boost Brent Oil 3X Short Daily ETP (IE00BYTYHS72) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | | 1,13 | 686033 | -54,5773 |
| ETFS Natural Gas ETC (GB00B15KY104) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0 | 629725 | -1,0753 |
| ETFS 2x Daily Long Natural Gas ETC (IE00BDD9Q956) [N/P] | ★★★★ | 1,03 | 0 | 595782 | -19,1544 |
| Boost Brent Oil 3X Short Daily ETP (IE00BYTYHR65) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 107%)] | ★★★★ | | 15,53 | 574558 | -67,5921 |
| METALLI INDUSTRIALI | | | | | |
| ETFS 3x Daily Short Copper ETC (IE00BYQY4341) [N/P] | ★★★★ | 1,03 | | 1084518 | -61,6123 |
| ETFS Nickel ETC (GB00B15KY211) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,36 | 453084 | 21,7765 |
| ETFS Industrial Metals ETC (GB00B15KYG56) [Sintetica Funded: con Swap (100%) (collaterale 101%)] | ★★★★ | 0,54 | 0,48 | 43 | |