

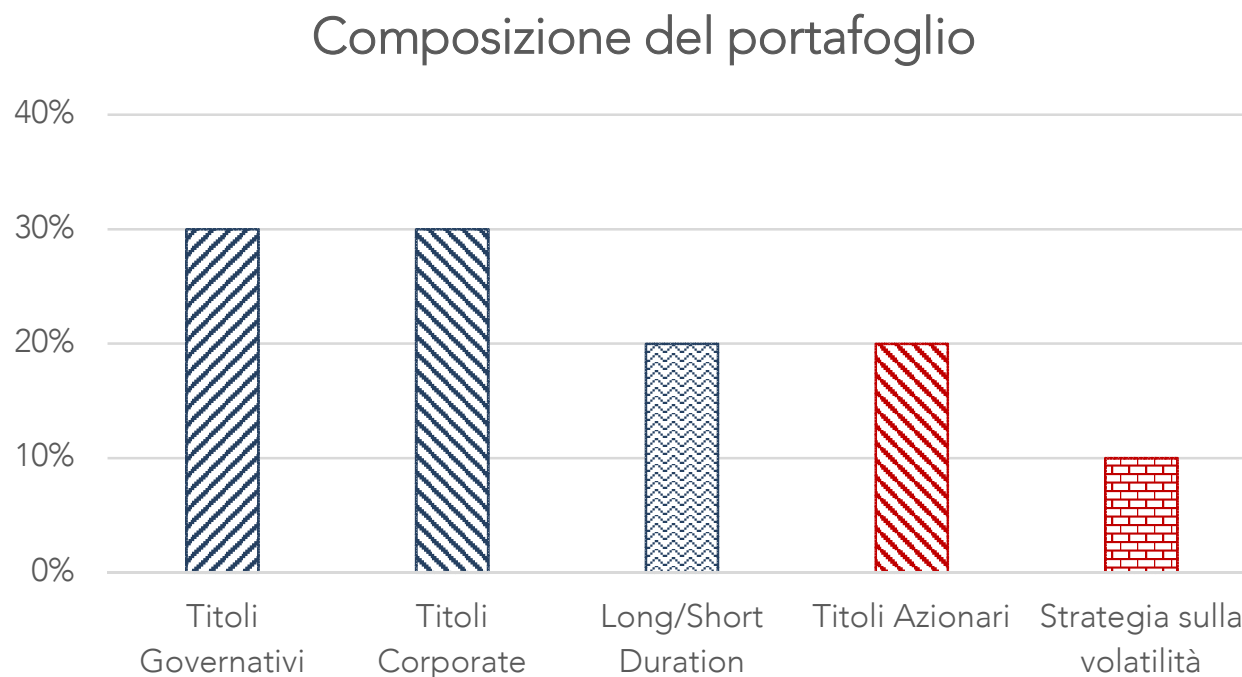
**DIAMAN** Sicav  
STRATEGIE INNOVATIVE D'INVESTIMENTO

**Dynamic Income**

## DYNAMIC INCOME

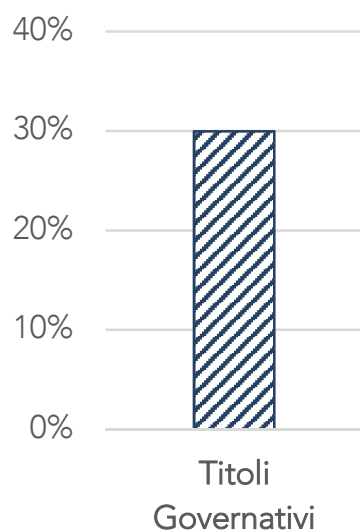
### Comparto Obbligazionario Multi-Strategy:

Un approccio multi asset e multi strategy è fondamentale per diversificare le fonti di guadagno e incrementare e supportare i rendimenti dell'obbligazionario.



DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## TITOLI GOVERNATIVI



## Modello di Selezione Quantitativa:

I titoli governativi vengono scelti in tutto il mondo privilegiando i mercati sviluppati e gli investment grade al fine di selezionare le emissioni con la migliore remunerazione a parità di rischio di default, tasso di recovery, duration, etc..

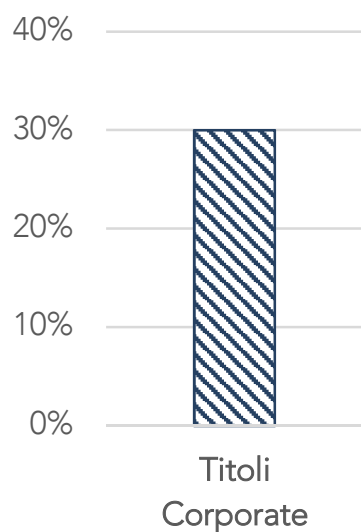
OBBLIGAZIONI BREVE TERMINE

NOV 2016

RANKING	ISIN	DESCRIZIONE	Lotto Minimo	Diaman Factor Adjusted	Duration	Frequenza cedola	YTM	HairCut BCE	iScoring (Rating ufficiale)	iRating (Rating implicito)	Indice di liquidità*
1	PTOTENOE0018	PORTUGUESE OT'S 4.45 15/06/2018	0,01	6,56	2,02	Annual	0,67%	7,00%	5+	6	10
2	PTOTELOE0010	PORTUGUESE OT'S 4.35 16/10/2017	0,01	4,28	1,44	Annual	0,27%	7,00%	5+	6	10
3	ES0302762127	FFPP 2.45 31/10/2018	1.000,00	3,65	2,46	Annual	0,22%	1,00%	6	9	5
4	XS0371163600	ROMANIA 6.5 18/06/2018	1.000,00	3,59	1,99	Annual	0,17%	7,00%	6-	8	9
5	ES00000128A0	SPANISH GOV'T 0.25 31/01/2019	1.000,00	2,53	2,77	Annual	0,09%	1,00%	6	9	10
6	IT0004922909	CCTS EU 1.804 01/11/2018	1.000,00	1,29	2,47	S/A	0,11%	0,50%	6	7	10
7	IT0004716319	CCTS EU 0.862 15/04/2018	1.000,00	1,11	1,97	S/A	0,06%	0,50%	6	7	10
8	XS0802005289	BULGARIA REP 4.25 09/07/2017	100.000,00	0,90	1,18	Annual	0,09%	7,00%	6	6+	8
9	IT0004423957	BTPS 4.5 01/03/2019	1.000,00	0,76	2,71	S/A	0,07%	1,00%	6	7	10
10	IT0003493258	BTPS 4.25 01/02/2019	1.000,00	0,67	2,64	S/A	0,06%	1,00%	6	7	10

DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## TITOLI CORPORATE



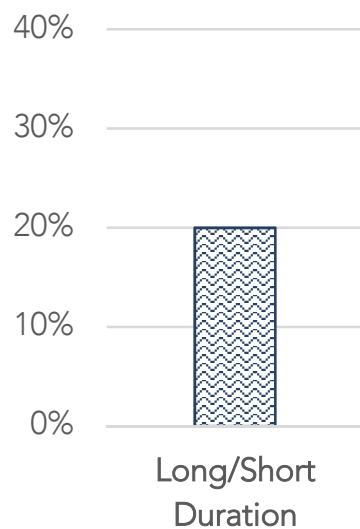
### Modello di selezione Quali-discrezionale:

La selezione viene effettuata da gestori con una ventennale esperienza nel mondo dell'investment banking a Londra, che conoscono nel dettaglio, management, storia, evoluzione e prospettive di ogni singola società.



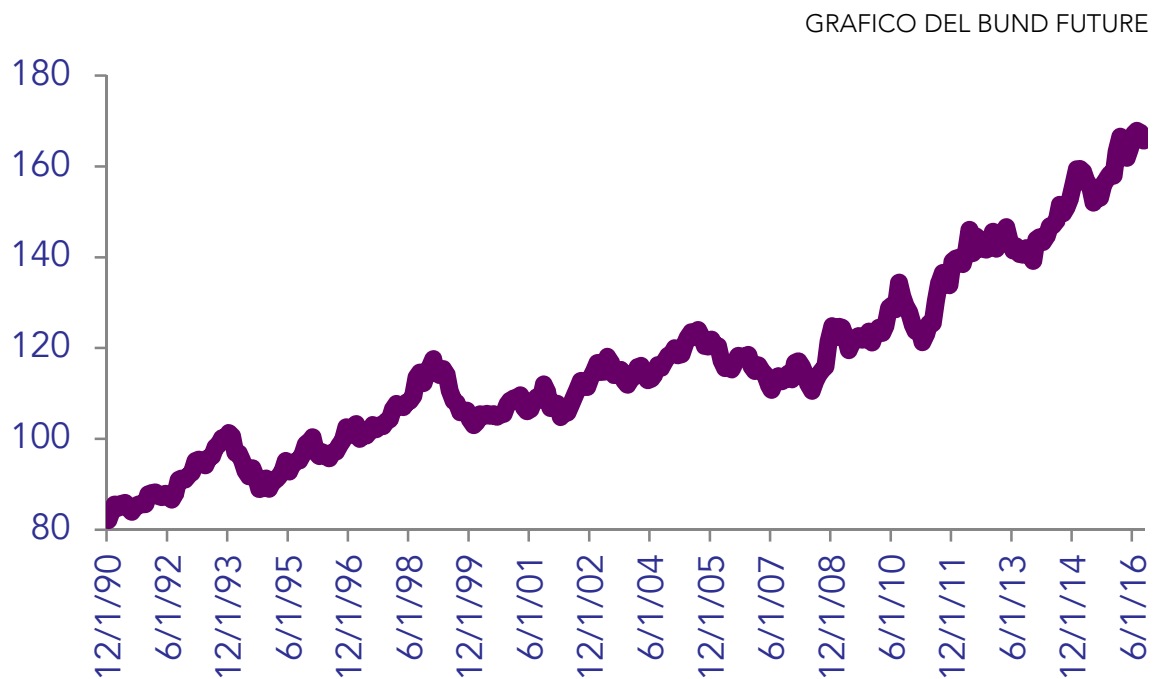
DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## LONG/SHORT DURATION



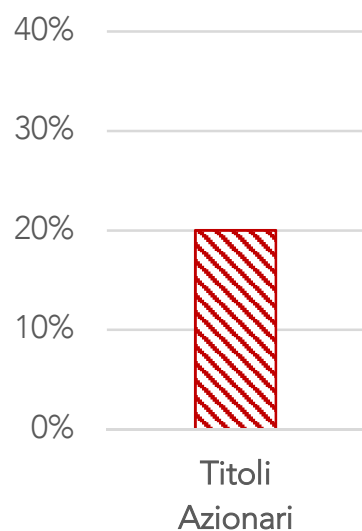
### Strategia settimanale Quantitativa:

Avere la possibilità di tenere posizioni corte su strumenti come il Btp Future, il T-Note e il Bund permette la giusta confidenza per affrontare futuri rialzi dei tassi d'interesse ufficiali.



DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## TITOLI AZIONARI



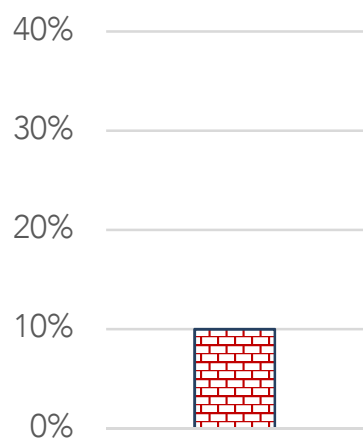
### Modello Quali-discrezionale :

Ogni singola società su cui il fondo investe è conosciuta in maniera approfondita. La valutazione tiene conto della possibile crescita attesa degli utili futuri in base alle capacità del management, modello di business.



DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## STRATEGIA SULLA VOLATILITA'



Strategia sulla volatilità

### Sfruttare il VIX per guadagnare sia al rialzo che al ribasso:

Le macchine passano il 90% del loro tempo ferme.

Assicurare la macchina quando sta ferma in garage è un bel vantaggio

Assicurarsi invece quando la macchina si muove invece è importante.

Sui mercati finanziari è possibile passare da Assicuratore ad

Assicurato quando si desidera...ad esempio vendendo o comprando future sul VIX



DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID

## DYNAMIC INCOME

### Comparto obbligazionario flessibile:

30% Titoli Governativi

30% Titoli Corporate e Hi Yield

20% Titoli Azionari Area Euro

20% Long Short Duration

10% Strategia sulla Volatilità

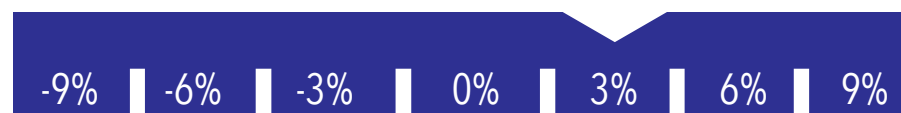
### Profilo di Rischio



### Correlazione Dinamica



### Rendimento Atteso



DISCLAIMER: Rendimenti passati non sono garanzia di uguali rendimenti futuri  
Prima di ogni decisione di investimento, leggere attentamente il prospetto informativo e il KIID





**DIAMAN Sicav - 12, rue Eugène Ruppert**

L-2453 Luxembourg - [www.diamansicav.com](http://www.diamansicav.com)

[info@diamansicav.com](mailto:info@diamansicav.com)



**Degroof Petercam Asset Services S.A.**

12, rue Eugène Ruppert - L-2453 Luxembourg

t. 0352 4535452185



**DIAMAN SCF srl - Via R. Lombardi 14/4**

Marcon (VE) Italy - t. +39 041 5969507

[www.diaman.it](http://www.diaman.it) - [info@diaman.it](mailto:info@diaman.it)



Questo documento è riservato ed è di proprietà di DIAMAN Sicav - è vietata la duplicazione anche parziale senza preventiva autorizzazione della DIAMAN Sicav; Riservato ad investitori istituzionali, questo documento non rappresenta sollecitazione al pubblico risparmio. La DIAMAN Sicav non risponde per l'eventuale utilizzo errato o fraudolento. I dati riportati sono calcolati dalla DIAMAN Sicav secondo i criteri e le metodologie dalla stessa adottate, e nonostante la massima cura e diligenza nella redazione degli stessi, possono comprendere errori di battitura o di elaborazione di cui la DIAMAN Sicav non si assume responsabilità qualora non fossero rispondenti al vero.