

INFORMATIVA SETTIMANALE:

20 febbraio 2012



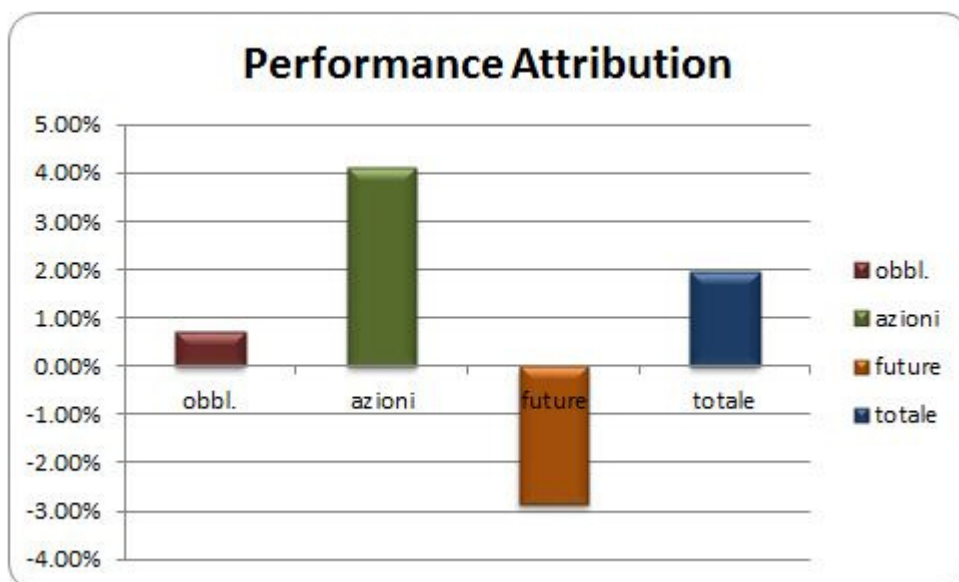
La frase della settimana:

L'uomo è in grado di fare ciò che non è in grado di immaginare. - René Char

Il grafico della settimana:

Da gennaio 2012 il comparto **Diaman Sicav Mathematics** è un fondo **-50 / 150**.
Per maggiori informazioni clicca <http://www.diamansicav.com/download.aspx?idLico=it&type=pcp> e visualizza la presentazione relativa al comparto.

Nel grafico viene riportato il rendimento al 15/02/2012 da inizio anno del comparto e la scomposizione della performance in base agli asset in portafoglio.



Forse non tutti sanno che:

L'**indice di Shannon-Wiener H'** è un indice di diversità usato in statistica nel caso di popolazioni con un numero infinito di elementi.

$$H' = - \sum_{j=1}^s p_j \log p_j$$

dove p_j è la proporzione della j -esima specie ($S_j p_j = 1$) e s è il numero delle specie.

[Approfondisci...](http://it.wikipedia.org/wiki/Indice_di_Shannon-Wiener) http://it.wikipedia.org/wiki/Indice_di_Shannon-Wiener

Quiz matematico della settimana:

Inserire la lettera mancante:

V	Q	I
S	N	F
Q	L	?

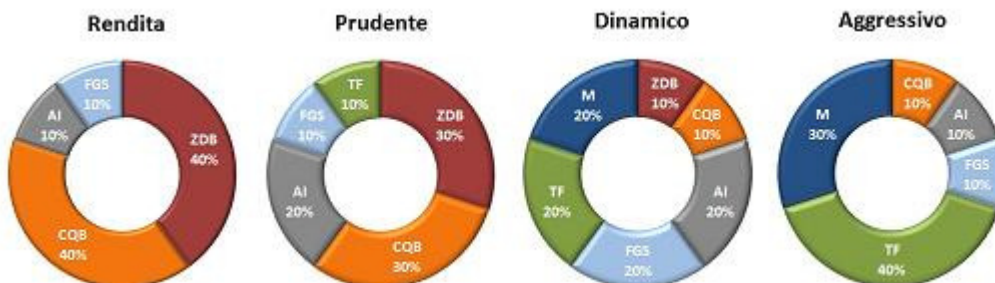
DIAMAN SICAV in pillole:

COMPARTO	YTD	STRUMENTO	ESPOSIZIONE
Zenit Dynamic Bond	2.00%	Bond Govt	60.30%
	Classe I	Bond Corp	34.10%
		Bund Future	0.00%
		Liquidità	5.60%
		Duration	1.15
Quant Bond	1.49%	Bond Corp USD	32.90%
	Classe I	Bond Corp EUR	60.10%
		T-Note Future	-13.60%
		Bund Future	-20.15%
		Duration	0.45
Artificial Intelligence FoF	0.30%	Fondi Absolute Return	95.35%
	Classe I	Liquidità	4.65%
FGS Systematic Trading	-1.89%	Azioni (Esposizione Lorda)	189.50%

	Classe I	Obbligazioni	37.20%
		Future	0.00%
		Liquidità	62.80%
Mathematics	3.23%	Azioni EURO	51.22%
	Classe I	Future EuroStoxx50	17.50%
Trend Follower	4.51%	Fondi azionari	75.86%
	Classe I	Fondi monetari	3.89%
		ETF	17.06%
		Liquidità	3.19%

Portafogli diversificati DIAMAN SICAV in pillole:

PROFILO	YTD	1 anno	2011	2010	2009
Rendita	1.17%	-2.96%	-3.91%	1.78%	2.72%
Prudente	1.36%	-4.54%	-5.62%	2.34%	4.21%
Dinamico	1.54%	-12.19%	-13.03%	3.24%	7.72%
Aggressivo	2.64%	-16.09%	-17.83%	6.52%	12.71%



Legenda (da intendersi classe R):

ZDB: Zenit Dynamic Bond; **CQB:** Classis Quant Bond; **AI:** Artificial Intelligence FoF
FGS: FGS Systematic Trading; **TF:** Trend Follower; **M:** Mathematics

(*) In mancanza di storico i rendimenti passati del Classis Quant Bond sono stati sintetizzati dal I-Shares Euro Corporate Bond, i rendimenti del FGS Systematic Trading sono stati sostituiti con quelli dell'Asymmetric Return, i rendimenti dell'Artificial Intelligence FoF sono stati presi dall'Artificial Intelligence Index, i rendimenti dell'Trend Follower sono stati integrati con quelli della gestione Save Dynamic.

www.diaman.it www.diamansicav.com www.quant.it www.daii.it