



# ARTIFICIAL INTELLIGENCE Fund of Funds

maggio-11

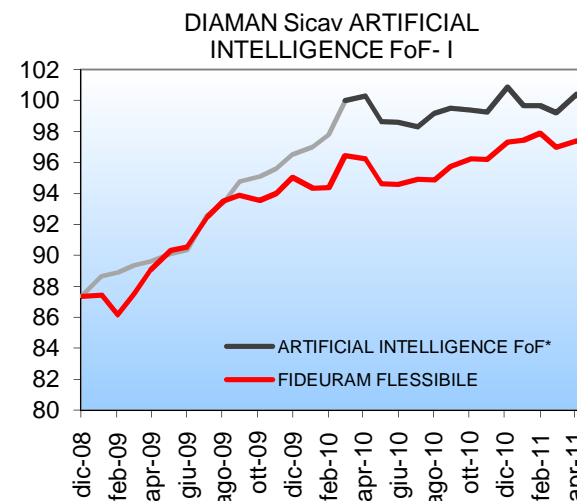
Il comparto ARTIFICIAL Intelligence FoF è un fondi di fondi con l'obiettivo di conseguire un rendimento assoluto investendo nei migliori fondi obbligazionari, a rendimento assoluto o a rendimento totale, selezionati con un modello quantitativo a rotazione.

L'universo investibile dell' ARTIFICIAL Intelligence FoF è composto da più di 250 comparti Sicav Ucits III, distribuito su 96 società di gestione di tutto il mondo e 140 strategie attive diversificate tra loro, per un totale di circa 125 Miliardi di euro in gestione.

Il fondo è una replica dell' ARTIFICIAL INTELLIGENCE INDEX ([www.daii.it](http://www.daii.it)) lanciato da DIAMAN SIM nel 2009. Il valore dell' indice viene calcolato e certificato dalla società FIDA Srl.

Ogni mese, un modello multiranking basato su 9 indicatori seleziona i migliori 20 fondi tra i 250 valutando i rendimenti, i rischi e l'efficienza di ogni singolo fondo.

Il comparto, dopo l'approvazione dell' Assemblea annuale generale degli azionisti, può prevedere una distribuzione di dividendi per la classe I (Istituzionale). Non è prevista alcuna distribuzione di dividendi agli azionisti delle classi P (private) ed R (Retail).



\* Da gennaio 2009 a marzo 2010 serie storica dell' ARTIFICIAL INTELLIGENCE INDEX calcolata e certificata da FIDA Srl come società terza. Dal 26 marzo 2010 andamento del comparto ARTIFICIAL INTELLIGENCE FoF.

## Performance nette mensili\*

Anno	Gen	Feb	Mar	Apr	Mag	Giu	Lug	Ago	Set	Ott	Nov	Dic	YTD	INDICE
2009	1.49%	0.28%	0.48%	0.31%	0.53%	0.28%	2.49%	0.91%	1.44%	0.34%	0.55%	0.92%	10.45%	8.78%
2010	0.55%	0.80%	2.24%	0.30%	-1.65%	-0.03%	-0.31%	0.90%	0.33%	-0.13%	-0.12%	1.62%	4.53%	2.35%
2011	-1.19%	0.00%	-0.47%	1.21%	-1.19%								-1.65%	-0.09%

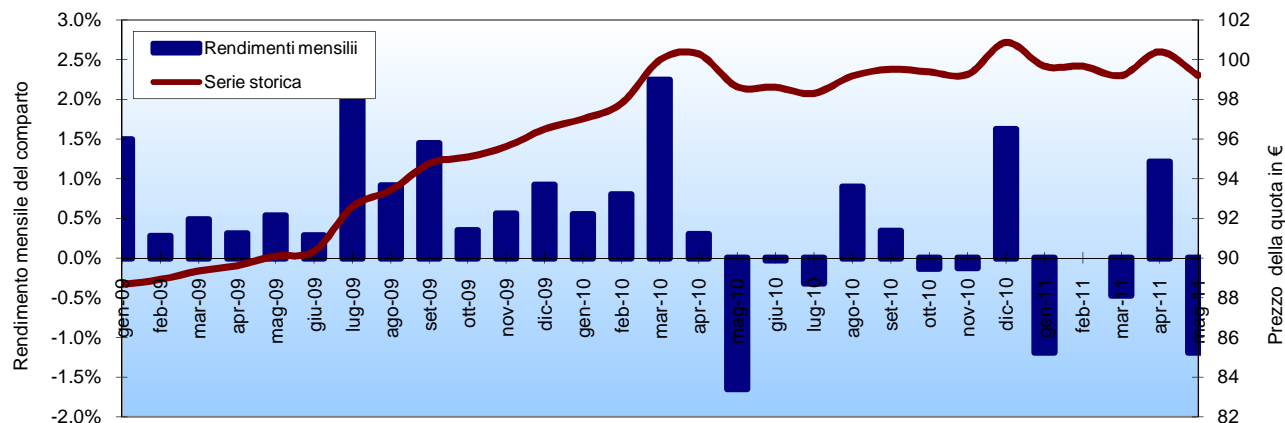
## Statistiche\*

NAV	99.21
Patrimonio:	7,027,000
Rendimento medio annuo:	5.22%
Mese migliore:	2.49%
Mese peggiore:	-1.65%
Volatilità annualizzata:	3.24%
Sharpe Ratio (Rfr 3%):	0.6839
Percentuale mesi positivi:	71.43%
Max Drawdown:	-1.98%
Max Run Up:	14.80%
Curtosi:	0.5040
Asimmetria:	-0.0319

\* Da gennaio 2009 a marzo 2010 serie storica dell' ARTIFICIAL INTELLIGENCE INDEX calcolata e certificata da FIDA Srl come società terza. Dal 26 marzo 2010 andamento del comparto ARTIFICIAL INTELLIGENCE FoF.

\* I risultati passati riportati non costituiscono garanzia di ottenere uguali risultati in futuro.

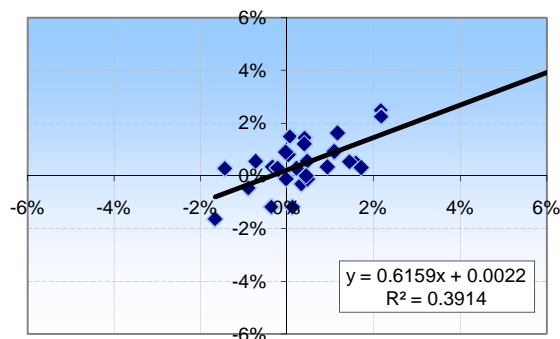
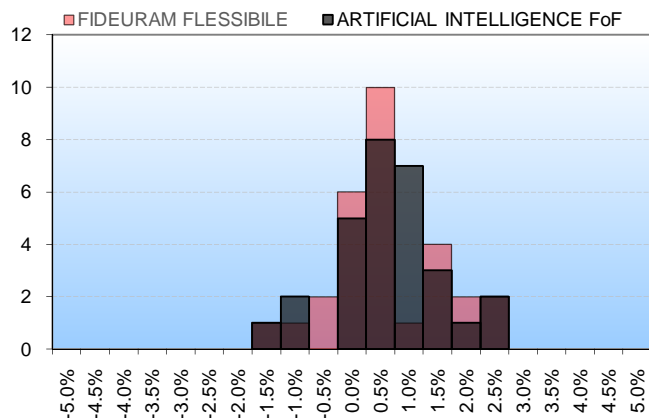
## Rendimenti mensili e serie storica\*



## TOP 10 DEL MESE IN CORSO

ISIN	NOME
LU0230916586	CSF LX-COMMO INDX PLUS €-B
IE00B4YLN521	GLG EUROPEAN ALPHA-D
LU0431651511	TORRUS-ML STRUCTURAL ALP-€HA
LU0353377418	ALLIANZ COMMODITIES STRTG-P€
LU0316493237	FRANK TP GLB TOT RT-I-AC-H1€
LU0334857942	INVESCO-GLOBAL ABS RTRN FD-A
FR0010098335	EXANE VAUBAN FUND
IE00B4MBZ034	CHEYNE CONVERT ABS RTN-S2€
LU0179866438	AXA WF-FRM OPT INCOME-AC€
FR0000991747	DEXIA LG SHRT RISK ARBIT

## Distribuzione dei rendimenti mensili e regressione lineare su FIDEURAM FLESSIBILE \*



## Migliori fondi del mese precedente

LU0475778535	ML IS-COL CIR IN HC L/S-C€A
LU0243957239	INVESCO PAN EUR HI INCOM-AA
LU0334857942	INVESCO-GLOBAL ABS RTRN FD-A
GB00B3L0ZS29	THREAD FOCUS-CRED OPP-RGA
LU0179866438	AXA WF-FRM OPT INCOME-AC€

## Peggiori fondi del mese precedente

LU0353377418	ALLIANZ COMMODITIES STRTG-P€
LU0230916586	CSF LX-COMMO INDX PLUS €-B
LU0091602218	RINASCIMENTO SICAV: ARB MOME
FR0010697201	FINALTIS MULTISTRATEGIES-A
LU0273642768	RWC FD-RWC GLBL CONVTLBS-A-€

	Codici ISIN	Ticker BLOOMBERG	Advisory. Fee	Mark. Fee	Perf. Fee
Classe I:	LU0479525734	DISCVIF LX	0%	0%	0.015%
Classe P:	LU0479525817	DISCVFP LX	0.40%	0.80%	0.015%
Classe R:	LU0479525908	DISCVIR LX	0.40%	1.20%	0.015%

\* Da gennaio 2009 a marzo 2010 serie storica dell' ARTIFICIAL INTELLIGENCE INDEX calcolata e certificata da FIDA Srl come società terza. Dal 26 marzo 2010 andamento del comparto ARTIFICIAL INTELLIGENCE FoF.

\* I risultati passati riportati non costituiscono garanzia di ottenere uguali risultati in futuro.