

# Allianz Insieme â Linea Azionaria: Analisi

Periodo: 2002-01-02 â 2025-08-13

Osservazioni: 3982

## Metriche principali

## Rendimenti trailing (pi^, recente)

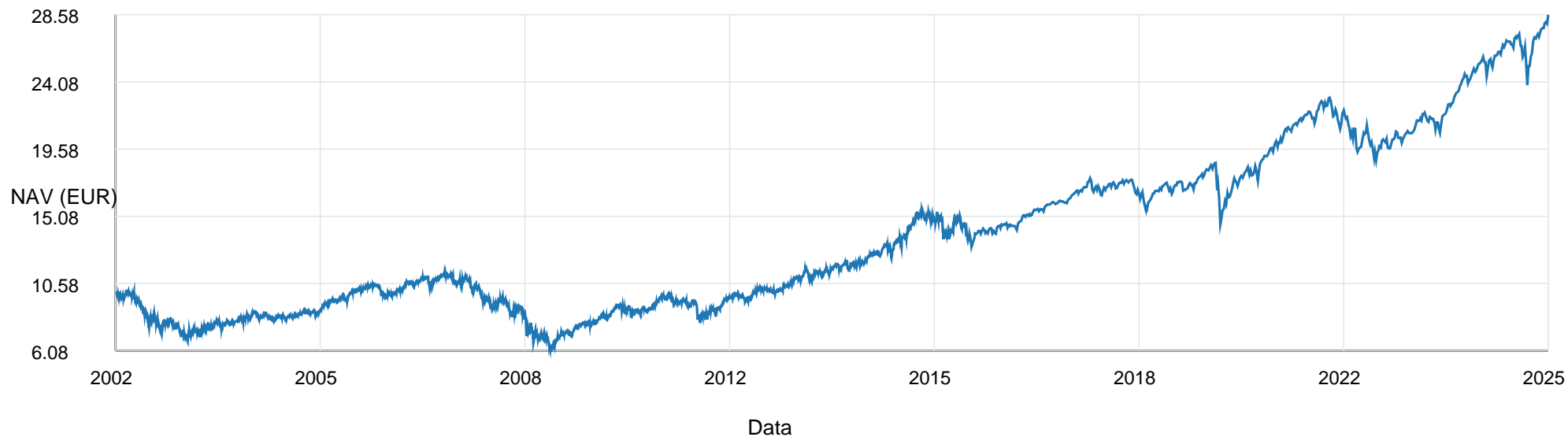
Rendimento cumulato	185.81%	1 anni	16.82%	16.82%
CAGR	4.55%	3 anni	38.31%	11.42%
Rendimento ann. (approx aritmetico)	5.24%	5 anni	58.69%	9.68%
Rendimento ann. (comp. continuo)	4.55%	10 anni	93.05%	6.80%
Volatilit^ ann.	12.59%	20 anni	203.25%	5.70%
Sharpe (rf=0)	0.42	Rendimenti trailing al 31/12/2024		
Sortino (rf=0)	0.43			
Max drawdown	-46.15%			
Calmar	0.10			
VaR(95%) giornaliero	-1.10%			
		1 anni	17.67%	17.67%
		3 anni	15.71%	4.99%
		5 anni	46.22%	7.90%
		10 anni	93.89%	6.85%
		20 anni	214.89%	5.90%

## Probabilit^ di successo (rendimento > 0)

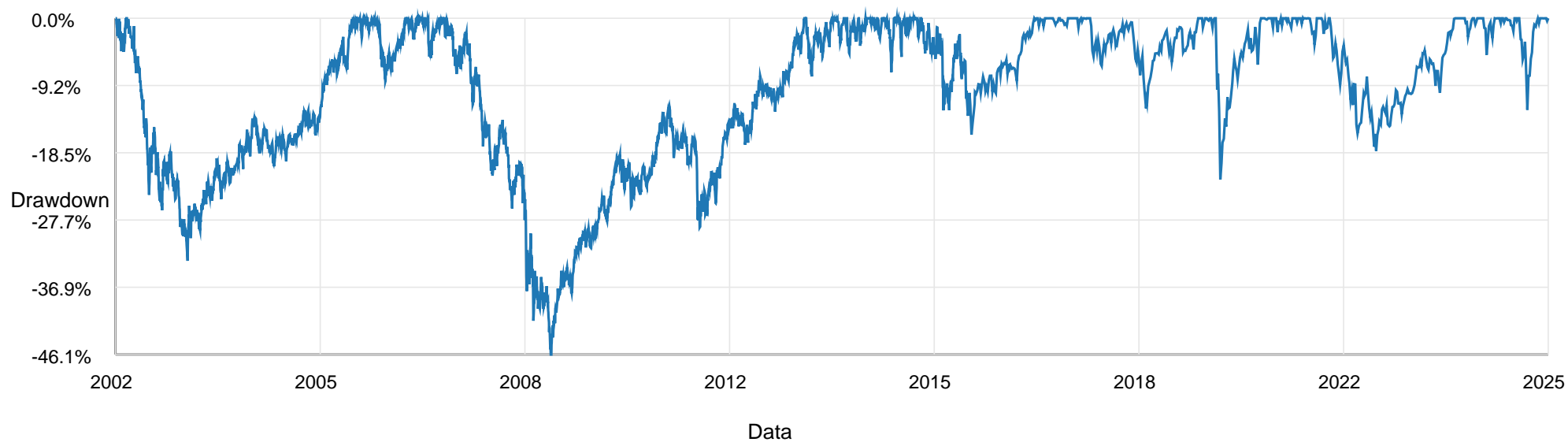
1 anni	3740	2775	74.2%
3 anni	3248	2418	74.4%
5 anni	2757	1757	63.7%
10 anni	1515	1454	96.0%
15 anni	454	454	100.0%
20 anni	189	189	100.0%

Nota: dati a frequenza mista (giornaliera/settimanale); metriche time-weighted.

Valore quota (NAV)



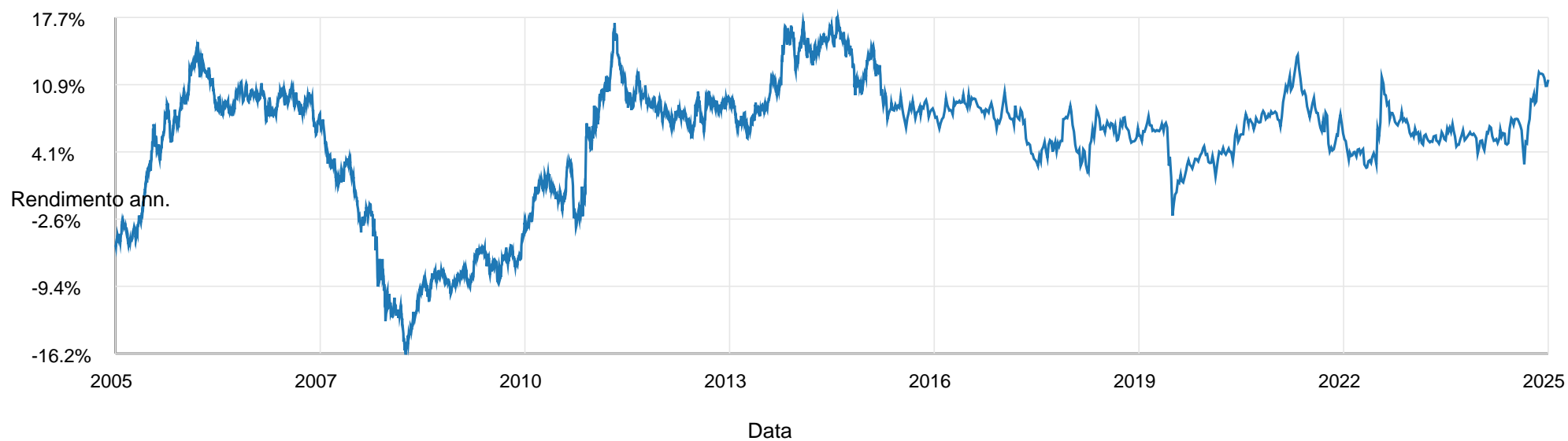
Drawdown



Rendimento rolling 12 mesi (ann.)



Rendimento rolling 36 mesi (ann.)



Rendimento rolling 60 mesi (ann.)



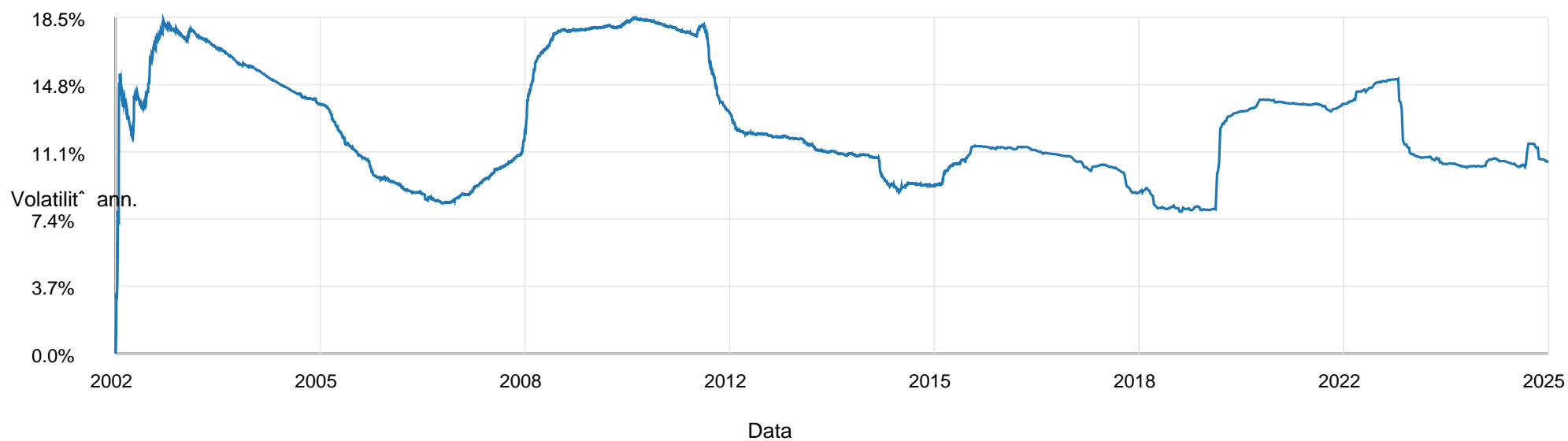
Rendimento rolling 120 mesi (ann.)



Rendimento rolling 180 mesi (ann.)



Volatilit  rolling 36 mesi (ann.)



Volatilitat<sup>^</sup> rolling 120 mesi (ann.)

