

Portfolio Analysis Report

Generated: 2026-01-11 11:47:52

Production Mode: Standard charts disabled
Set PORTFOLIO_LEGACY_CHARTS=true for equity/drawdown/distribution charts
Focus on console text insights for decision making

```
=====
[CHART] PORTFOLIO ANALYSIS REPORT
      (Client View v3.1)
=====
[PIN] PORTFOLIO: Equity diversificato difensivo (beta basso), beta 0.00 vs mercato globale
[CHART] PERFORMANCE: Buona risk-adjusted return (CAGR 13.3%, Sharpe 0.67)
[OK] PUNTI DI FORZA: drawdown contenuto, efficienza ottima, rendimento solido
[WARN] DA MIGLIORARE: Nessuna criticità strutturale rilevata
■ AZIONE: → Portfolio funzionale, valuta ottimizzazione posizioni risk leverage >2x
=====

[UP] PERFORMANCE SUMMARY
-----
CAGR (annualizzato):      13.34%
Volatility:               18.20%
Sharpe Ratio:             0.67   (risk-adjusted return)
Max Drawdown:            -31.96% (worst loss)
Beta vs Global Market:    0.00

[WARN] RISK PROFILE
-----
Top 3 Risk Contributors:
  1. CSPX.L   Weight: 22.1%, Risk: 19.2%
  2. EMIM.L   Weight: 12.1%, Risk: 16.4%
  3. WSML.L   Weight:  5.0%, Risk: 11.5% [WARN]

VaR Daily (95%):          -1.48%
CVaR Daily (95%):         -2.56%
[i] 5% probabilità di perdere più del VaR in un giorno

[RANDOM] STRESS SCENARIOS (Monte Carlo)
-----
[CHART] Scenario Base (osservato):
      CAGR: 13.3% | Max DD: 32.0%

[WARN] Scenario Stress (plausibile):
      CAGR:  6.8% | Max DD: -18.4%

■ TAKEAWAY: Drawdown contenuto anche in stress. Profilo difensivo.
=====
```

[TARGET] VERDICT & RECOMMENDED ACTION

=====

[OK] PORTFOLIO STATUS: STRUCTURALLY_COHERENT_INTENT_MATCH

Confidence: 60%

■ AZIONE RACCOMANDATA:

→ Valuta con consulente le aree di miglioramento sopra

=====

Fine Report - Per analisi completa usa OUTPUT_MODE='professional'

=====

[CHART] Placeholder grafico salvato: output/portfolio_analysis.png (legacy charts disabled)