# Indicazioni per la relazione finale

* Scadenza: domenica 17 Novembre
* Formato: unico file con risultati, grafici e commenti; allegare codice, dati e calcoli.
* Motivare i commenti con argomenti quantitativi.
* Tutti i calcoli devono essere riproducibili: integrare il materiale già inviato se necessario.

Traccia:

1. Commento sulle perfomance:
   1. Risultato complessivo: performance assoluta, relativa, information ratio. Includere grafici dell’andamento storico.
   2. Margini di contribuzione delle classi
   3. Contributo dei movimenti dei cambi (anche approssimato)
   4. Impatto dei costi di transazione
   5. Commento ad eventuali periodi particolarmente volatili
2. Commento sulla composizione
   1. Per ogni periodo di gioco, indicare la composizione iniziale, finale, e le motivazioni della scelta di cambiamento.
   2. Il cambiamento ha raggiunto gli obiettivi prefissati? I benefici superano i costi?
3. Performance attribution e commento
4. Modellistica. Per ogni periodo di gioco indicare:
   1. i modelli impiegati per la determinazione dei pesi
   2. i criteri adottati per la determinazione dei parametri (es. motivazioni per la scelta della frequenza e della durata delle serie impiegate per la stima, origine delle views etc.)
   3. punti di forza e di debolezza del modello, con particolare riferimento ai risultati ottenuti
   4. anche sulla base del punto precedente, indicare le modifiche qualitative ai pesi ottimi che si sono rese necessarie, specificando la procedura seguita per ottenere il numero finale
   5. Le modifiche hanno aggiunto o detratto valore?