

SERVIZIO RISKSize

Modalità Base - Contenuti



9 maggio 2025

Indice

Indice	i
Introduzione	1
Cambi	2
Mercato Monetario	4
Mercato Overnight	5
Curve Swap	6
Curve Tassi Reali	8
Curve Governative	9
Spread Curve Governative	11
Curve di Settore	12
Indici Azionari di Piazza	15
Indici Azionari Settoriali	18
Indici Benchmark Per Fondi Comuni D’investimento e Sicav	20
Commodities	23
Indici di Hedge Funds	24
Indici CCT/MTS	25
Altri indici	26

Introduzione

Di seguito viene fornito l'elenco dei fattori di rischio presenti nella matrice varianza – covarianza RISKSize (modalità base). Per semplicità espositiva, i fattori di rischio vengono raggruppati per Asset Type.

Cambi

Estensione: .XS

Esempio: HKD.XS

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Mean

Divisa	Descrizione
AED	Dirham Emirati Arabi Uniti
ALL	Lek Albanese
ARS	Peso argentino
AUD	Dollaro australiano
BMD	Dollaro delle Bermuda
BRL	Real Brasiliano
CAD	Dollaro canadese
CHF	Franco svizzero
CNY	Yuan Cinese
CLP	Peso Cileno
COP	Peso Colombiano
CZK	Corona Ceca
DKK	Corona danese
DZD	Dinaro Algerino
EGP	Sterlina Egiziana
ETB	Birr Etiope
GBP	Sterlina inglese
HKD	Dollaro Hong Kong
HUF	Fiorino Ungherese

Divisa	Descrizione
IDR	Rupia indonesiana
ILS	Shekel Israeliano
INR	Rupia Indiana
ISK	Corona Islandese
JPY	Yen giapponese
KRW	Won coreano
KWD	Dinaro Kuwait
KYD	Dollaro delle Isole Cayman
KZT	Tenge Kazako
LBP	Lira Libanese
LKR	Rupia Sri Lanka
LYD	Dinaro Libico
MAD	Dirham Marocco
MDL	Leu Moldavo
MUR	Rupia delle Mauritius
MXN	Peso messicano
MYR	Ringgit Malaysiano
NGN	Naira nigeriana
NOK	Corona norvegese
NZD	Dollaro neo zelandese
PHP	Peso filippino
PKR	Rupia Pakistana
PLN	Zloty Polacco
RON	New Romanian Leu
RSD	Dinar Serbo
RUB	Rublo Russo
SAR	Riyal Saudita
SCR	Rupia delle Seychelles
SEK	Corona svedese
SGD	Dollaro Singapore
SYP	Sterlina Siriana
THB	Baht thailandese
TND	Dinaro Tunisino
TRY	Lira Turca
TWD	Dollaro Taiwan
USD	Dollaro Usa
VES	Bolivar Venezuelano
VND	Dong Vietnamese
ZAR	Rand Sudafricano

Tabella 1: Fattori di rischio cambi

Mercato Monetario

Estensione: .R007 , .R030 , .R090 , .R180 , .R270 , .R360

Esempio: EUR.R180

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

Divisa	Descrizione	1w	1m	3m	6m	9m	12m
AUD	Dollaro australiano		✓	✓	✓	✓	✓
BRL	Real brasiliano		✓	✓	✓		✓
CZK	Corona ceca		✓	✓	✓		✓
DKK	Corona danese		✓	✓	✓		✓
EUR	Euro	✓	✓	✓	✓		✓
HKD	Dollaro Hong Kong		✓	✓	✓		✓
HUF	Fiorino Ungherese		✓	✓	✓		✓
MXN	Peso messicano		✓	✓	✓		✓
NOK	Corona norvegese		✓	✓	✓	✓	✓
PLN	Zloty polacco		✓	✓	✓		✓
TRY	Nuova Lira Turca		✓	✓	✓	✓	
ZAR	Rand Sudafricano		✓	✓	✓	✓	✓

Tabella 2: Fattori di rischio money market

Mercato Overnight

Estensione: .R001

Esempio: EUR.R001

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

Divisa	Descrizione	Scadenza	Fattore di rischio
EUR	Euro	Overnight	ESTR.R001
GBP	Sterlina inglese	Overnight	GBP.R001
JPY	Yen giapponese	Overnight	TONAR.R001
USD	Dolaro USA	Overnight	SOFR.R001
CHF	Franco svizzero	Overnight	CHOIS.R001

Tabella 3: Fattori di rischio overnight market

Curve Swap

Estensione: .S00083 , .S0025 , .S005 , .S01 , .S02 , .S03 , .S04 , .S05 , .S07 , .S10 , .S12 , .S15 , .S20 , .S25 , .S30

Esempio: SONIA.S10

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

IdCurva	Descrizione	1m	3m	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y	25y	30y
AUD	AUD vs Interbancario 6M					✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
BRL	BRL vs Interbancario Overnight					✓	✓	✓	✓							
CHOIS	CHF vs SARON (Swiss Average Rate Overnight)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
CNY	CNY vs Interbancario 3M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
CORRA	CAD vs CORRA (Canadian Overnight Repo Rate Average)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
CZK	CZK vs Interbancario 6M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
DKK	DKK vs Interbancario 6M					✓	✓	✓	✓	✓	✓					
ESTR	EUR vs €STR	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
EUR	EUR vs Euribor 6M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
EUR1M	EUR vs Euribor 1M			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
EUR3M	EUR vs Euribor 3M			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	

IdCurva	Descrizione	1m	3m	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y	25y	30y
HKD	HKD vs Hibor 3M					✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
HUF	HUF vs Interbancario 6M					✓	✓	✓	✓	✓	✓					
INR	INR vs Interbancario Overnight				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
MXN	MXN vs Interbancario 1M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
NOK	NOK vs Nibor 6M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
NZD	NZD vs Interbancario 3M					✓	✓	✓	✓	✓						
PLN	PLN vs Interbancario 6M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		✓	✓		
RUB	RUB vs Tasso deposito				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
SEK	SEK vs Interbancario 3M					✓	✓	✓	✓	✓	✓					
SOFR	USD vs SOFR (Secured Overnight Financing Rate)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
SONIA	GBP vs SONIA (Sterling Overnight Index Average)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
SORA	SGD vs SO-RA (Singapore Overnight Rate Average)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
TONAR	JPY vs TONAR (Tokio Overnight Average Rate)	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
TRY	TRY vs TRLIBOR 3M				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
USDOIS	USD vs EFFR (Effective Fed Funds Rate)		✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
ZAR	ZAR vs Interbancario 3M					✓	✓	✓	✓	✓	✓					

Tabella 4: Fattori di rischio swap

Curve Tassi Reali

Estensione: .RE01 , .RE02 , .RE03 , .RE04 , .RE05 , .RE07 , .RE10 , .RE12 , .RE15 , .RE20 , RE25 , .RE30

Esempio: EUR.RE10

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

Paese	Descrizione	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y	25y	30y
EUR	Curva Europea	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
GBP	Curva inglese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ITL	Curva italiana	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
USD	Curva Stati Uniti	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

Tabella 5: Fattori di rischio reali

Curve Governative

Estensione: .Z0025, .Z005, .Z01, .Z02, .Z03, .Z04, .Z05, .Z07, .Z09, .Z10, .Z15, .Z20, .Z30

Esempio: USD.Z07

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

Paese	Descrizione	3m	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	9y	10y	15y	20y	30y
ATS	Curva Austriaca			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
AUD	Curva australiana				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
BEF	Curva belga			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
CAD	Curva canadese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
CHF	Curva Svizzera			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
DEM	Curva tedesca	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
DKK	Curva danese				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
ESP	Curva spagnola			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
EUR	Curva Europea	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
FIM	Curva Finlandese			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
FRF	Curva francese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

Paese	Descrizione	3m	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	9y	10y	15y	20y	30y
GBP	Curva inglese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
IEP	Curva irlandese			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
ITL	Curva italiana	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ITLCPI	Curva italiana Inflation Linked			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
JPY	Curva giapponese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
NLG	Curva olandese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
NZD	Curva neozelandese				✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
PTE	Curva portoghese		✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
SEK	Curva svedese			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
SIT	Curva Slovena			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
USD	Curva Stati Uniti	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

Tabella 6: Fattori di rischio governativi

Spread Curve Governative

Estensione: .SP01 , .SP02 , .SP03 , .SP04 , .SP05 , .SP07 , .SP09 , .SP10 , .SP15 , .SP20 , .SP3

Esempio: ITL.SP07

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

Paese	Descrizione	1y	2y	3y	4y	5y	7y	9y	10y	15y	20y	30y
ATS	Curva Austriaca	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
BEF	Curva Belga	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
CHF	Curva Svizzera	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
DEM	Curva Tedesca	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ESP	Curva spagnola	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
FIM	Curva Finlandese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
FRF	Curva francese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
IEP	Curva Irlandese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
ITL	Curva italiana	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
ITLCPI	Curva italiana inflation linked	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
NLG	Curva Olandese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
PTE	Curva Portoghese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
SEK	Curva Svedese	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
SIT	Curva Slovena	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
USD	Curva Stati Uniti	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓

Tabella 7: Fattori di rischio spread governativi

Curve di Settore

Estensione: Co90 , C180 , C360 , Co2 , Co3 , Co4 , Co5 , Co7 , C10 , C12 , C15 , C20

Esempio: EUR.FINHISPCo90

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

IdCurva	Descrizione	3y	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y
EUR.FINHI	Financial EUR alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
EUR.FINLW	Financial EUR basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.FINME	Financial EUR medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
EUR.FINSUBINV	Financial EUR speculativa		✓	✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.FINSUBLW	Financial EUR subordinati basso merito creditizio		✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.FINSUBME	Financial EUR subordinati medio merito creditizio		✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
GBP.FINME	Financial GBP medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
USD.FINHI	Financial USD alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
USD.FINME	Financial USD medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.INDHI	Industrial EUR alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.INDJU	Industrial EUR speculativa	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.INDLW	Industrial EUR basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
EUR.INDME	Industrial EUR medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	

IdCurva	Descrizione	3y	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y
GBP.INDLW	Industrial GBP basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
GBP.INDME	Industrial GBP medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
USD.INDHI	Industrial USD alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
USD.INDLW	Industrial USD basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
USD.INDME	Industrial USD medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			

Tabella 8: Fattori di rischio curve di settore

Estensione: 025 , 05 , 1 , 2 , 3 , 4 , 5 , 7 , 10 , 12 , 15 , 20

Esempio: EUR.EU_FIN_AASen025

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Yield Volatility, Mean

IdCurva	Descrizione	3y	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y
EUR.EU_FIN_AASen	Financial EUR alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
EUR.EU_FIN_BBBSen	Financial EUR basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.EU_FIN_ASen	Financial EUR medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
EUR.EU_FIN_BBBSen	Financial EUR speculativa			✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.EU_FIN_BBBSub	Financial EUR subordinati basso merito creditizio			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.EU_FIN_ASub	Financial EUR subordinati medio merito creditizio			✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
GBP.EU_FIN_ASen	Financial GBP medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
USD.NA_FIN_AASen	Financial USD alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					

IdCurva	Descrizione	3y	6m	1y	2y	3y	4y	5y	7y	10y	12y	15y	20y
USD.NA_FIN_ASen	Financial USD medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.EU_IND_AASen	Industrial EUR alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
EUR.EU_IND_BBBSen	Industrial EUR speculativa	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓					
EUR.EU_IND_BBBSen	Industrial EUR basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓		
EUR.EU_IND_ASen	Industrial EUR medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
GBP.EU_IND_BBBSen	Industrial GBP basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	
GBP.EU_IND_ASen	Industrial GBP medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓
USD.NA_IND_AASen	Industrial USD alto merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			
USD.NA_IND_BBBSen	Industrial USD basso merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓				
USD.NA_IND_ASen	Industrial USD medio merito creditizio	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓	✓			

Tabella 9: Fattori di rischio curve di settore da regressione

Indici Azionari di Piazza

Estensione: .SE

Esempio: CAD.SE

Informazioni: Value, Lambda, Price Volatility, Mean

Paese	Descrizione	Indice	Mercato	Divisa
ARS	Argentina	MERVAL	Buenos Aires Stock Exchange	Peso Argentino
ATS	Austria	ATX	Vienna Stock Exchange	Euro
AUD	Australia	ASX ALL ORDINARIES	Australian Stock Exchange	Dollaro Australiano
BEF	Belgio	BEL 20	Bruxelles Stock Exchange	Euro
CAD	Canada	SPTSX 60	Toronto Stock Exchange	Dollaro Canadese
CHF	Svizzera	SMI	Zurich Stock Exchange	Franco svizzero
DEM	Germania	DAX	Frankfurt Stock Exchange	Euro
DKK	Danimarca	KFX	Denmark Stock Exchange	Corona danese
ESP	Spagna	IBEX 35	Madrid Stock Exchange	Euro
EUR	Dow Jones Eurostoxx 50	DJES 50		Euro

Paese	Descrizione	Indice	Mercato	Divisa
FIM	Finlandia	HEX GENERAL	Helsinki Stock change	Euro
FRF	Francia	CAC 40	Paris Stock change	Euro
GBP	U K	FTSE 100	London Stock change	Sterlina Inglese
HKD	Hong Kong	HANG SENG	Hong Kong	Dollaro Hong Kong
IDR	Indonesia	JSE COMPOSITE	Jakarta Stock Exchange	Rupia indonesiana
IEP	Irlanda	ISEQ	Irish Stock Exchange	Euro
INR	India	BSE500	Bombay Stock Exchange 500	Rupia indiana
ITL	Italia	FTSEMIB	Milano Stock Exchange	Euro
JPY	Giappone	NIKKEI 225	Tokio Stock change	Yen giapponese
KRW	Corea del sud	KOPSI	Seul Stock change	Won coreano
MXN	Messico	IPC (BOLSA)	Mexico Stock change	Peso messicano
MYR	Malesia	KLSE COMPOSITE	Kuala Lumpur Stock change	Ringgit malesiano
NLG	Olanda	AEX	Amsterdam Stock change	Euro

Paese	Descrizione	Indice	Mercato	Divisa
NOK	Norvegia	OSLO SE ALL SHARES	Oslo Stock change	Ex- Corona norvegese
NZD	Nuova Zelanda	CAPITAL 40	New Zealand Stock change	Ex- Dollaro neozelandese
PHP	Filippine	PHILIPPINES SE ALL SHARES	Manila Stock change	Ex- Peso filippino
PLN	Polonia	WIG 20	Varsavia Stock change	Ex- Zloty polacco
SEK	Svezia	OMX	Stockholm Stock change	Ex- Corona svedese
SGD	Singapore	FSSTI- STRAITS TIMES IN- DEX	Stock change	Ex- Dollaro Singapore
THB	Tailandia	SET	Bangkok Stock change	Ex- Baht thailandese
TRY	Turchia	ISE 100	Istanbul Stock change	Ex- Lira Turca
TWD	Taiwan	TAIWAN SE	Taipei Stock change	Ex- Dollaro Taiwan
USD	Usa	S&P 100	New York Stock change	Ex- Dollaro Usa

Tabella 10: Fattori di rischio indici azionari di piazza

Indici Azionari Settoriali

Estensione: Codice Indice Settoriale

Esempio: EUR.IGENINES

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Divisa	Descrizione	Codice Indice Settoriale
EUR	GERMANY – BASIC INDUSTRIES	IBASICBD
EUR	SPAIN – BASIC INDUSTRIES	IBASICES
EUR	FRANCE – BASIC INDUSTRIES	IBASICFR
EUR	ITALY – BASIC INDUSTRIES	IBASICIT
EUR	GERMANY – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDBD
EUR	SPAIN – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDES
EUR	FRANCE – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDFR
EUR	ITALY – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDIT
EUR	GERMANY CONSUMER SERVICE	ICYSERBD
EUR	SPAIN CONSUMER SERVICE	ICYSERES
EUR	FRANCE CONSUMER SERVICE	ICYSERFR
EUR	ITALY CONSUMER SERVICE	ICYSERIT
EUR	GERMANY – GEN. INDUSTRIALS	IGENINBD
EUR	SPAIN – GEN. INDUSTRIALS	IGENINES
EUR	FRANCE – GEN. INDUSTRIALS	IGENINFR
EUR	ITALY – GEN. INDUSTRIALS	IGENINIT
EUR	GERMANY – INFORMATION TECH	IITECHBD
EUR	SPAIN – INFORMATION TECH	IITECHES
EUR	FRANCE – INFORMATION TECH	IITECHFR
EUR	ITALY – INFORMATION TECH	IITECHIT
EUR	GERMANY – NON CYC CONS GDS	INCYCGBD
EUR	SPAIN – NON CYC CONS GDS	INCYCGES
EUR	FRANCE – NON CYC CONS GDS	INCYCGFR
EUR	ITALY – NON CYC CONS GDS	INCYCGIT
EUR	SPAIN – RESOURCES	IRESORES

Divisa	Descrizione	Codice Indice Settoriale
EUR	FRANCE – RESOURCES	IRESORFR
EUR	ITALY – RESOURCES	IRESORIT
EUR	GERMANY – FINANCIALS	ITOTLFBD
EUR	SPAIN – FINANCIALS	ITOTLFES
EUR	FRANCE – FINANCIALS	ITOTLFFR
EUR	ITALY – FINANCIALS	ITOTLFIT
EUR	GERMANY – UTILITIES	IUTILSBD
EUR	SPAIN – UTILITIES	IUTILSES
EUR	FRANCE – UTILITIES	IUTILSFR
EUR	ITALY – UTILITIES	IUTILSIT
GBP	UK – BASIC INDUSTRIES	IBASICUK
GBP	UK – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDUK
GBP	UK – CONSUMER SERVICE	ICYSERUK
GBP	UK – GEN. INDUSTRIALS	IGENINUK
GBP	UK – INFORMATION TECH	IITECHUK
GBP	UK – NON CYC CONS GDS	INCYCGUK
GBP	UK – RESOURCES	IRESORUK
GBP	UK – FINANCIALS	ITOTLFUK
GBP	UK – UTILITIES	IUTILSUK
JPY	JAPAN BASIC INDUSTRIES	IBASICJP
JPY	JAPAN CYC CONS GOODS	ICYCGDJP
JPY	JAPAN CONSUMER SERVICE	ICYSERJP
JPY	JAPAN GEN. INDUSTRIALS	IGENINJP
JPY	JAPAN INFORMATION TECH	IITECHJP
JPY	JAPAN NON CYC CONS GDS	INCYCGJP
JPY	JAPAN RESOURCES	IRESORJP
JPY	JAPAN FINANCIALS	ITOTLFJP
JPY	JAPAN UTILITIES	IUTILSJP
USD	US – BASIC INDUSTRIES	IBASICUS
USD	US – CYC. CONS. GOODS	ICYCGDUS
USD	US CONSUMER SERVICE	ICYSERUS
USD	US – GEN. INDUSTRIALS	IGENINUS
USD	US INFORMATION TECH	IITECHUS
USD	US NASDAQ 100	INASDAQ
USD	US – NON CYC CONS GDS	INCYCGUS
USD	US RESOURCES	IRESORUS
USD	US FINANCIALS	ITOTLFUS
USD	US UTILITIES	IUTILSUS

Tabella 11: Fattori di rischio indici azionari settoriali

Indici Benchmark Per Fondi Comuni D'investimento e Sicav

Estensione: Codice Indice di fondi

Esempio: EUR.I3 EUR.I99

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Fattore di rischio	Peer group
EUR.I3	Azionari Europa
EUR.I4	Azionari Europa Emu
EUR.I5	Azionari Europa Italia
EUR.I7	Azionari Europa Small Cap
EUR.I8	Azionari Settoriali Europa High Tech
EUR.I9	Azionari Internazionali Small Cap
EUR.I10	Azionari Internazionali
EUR.I12	Azionari Settoriali High Tech
EUR.I13	Azionari Settoriali Materials
EUR.I14	Azionari Settoriali Financials
EUR.I15	Azionari Settoriali Information Technology
EUR.I16	Azionari Settoriali Telecommunication
EUR.I17	Azionari Settoriali Utilities
EUR.I18	Azionari Settoriali Consumer Staples
EUR.I19	Azionari Settoriali Consumer Discretionary
EUR.I20	Azionari Settoriali Energy
EUR.I21	Azionari Settoriali Industrial
EUR.I22	Azionari Nord America
EUR.I23	Azionari Nord America Small Cap
EUR.I24	Azionari Giappone Small Cap

Fattore di rischio	Peer group
EUR.I25	Azionari Pacifico Giappone
EUR.I26	Azionari Pacifico
EUR.I27	Azionari Pacifico Small Cap
EUR.I28	Azionari Paesi Emergenti America latina
EUR.I29	Azionari Paesi Emergenti Asia&Oceania
EUR.I30	Azionari Paesi Emergenti
EUR.I31	Azionari Paesi Emergenti Est Europeo
EUR.I32	Azionari Settoriali Biotech
EUR.I33	Azionari Real Estate
EUR.I34	Azionari Settoriali Healthcare
EUR.I50	Monetario Internazionale
EUR.I51	Monetario EMU
EUR.I52	Monetario USD
EUR.I53	Monetario UK
EUR.I54	Monetario CHF
EUR.I55	Monetario JPY
EUR.I60	Misto con quota azioni sino a 20%
EUR.I61	Misto con quota azioni da 21% a 40%
EUR.I62	Misto con quota azioni da 41% a 60%
EUR.I63	Misto con quota azioni da 61% a 80%
EUR.I64	Misto con quota azioni oltre 80%
EUR.I70	Obbligazionari EMU Medium Term
EUR.I71	Obbligazionari Corporate IG Internazionali
EUR.I72	Obbligazionari Internazionali Inflation Linked
EUR.I80	Obbligazionari CHF
EUR.I81	Obbligazionari GBP
EUR.I82	Obbligazionari EMU
EUR.I83	Obbligazionari EMU short term
EUR.I84	Obbligazionari Europa High Yield
EUR.I85	Obbligazionari Europa Convertibili
EUR.I86	Obbligazionari Paesi Emergenti Est Europeo
EUR.I87	Obbligazionari Europa
EUR.I88	Obbligazionari Internazionali
EUR.I89	Obbligazionari Internazionali High Yield

Fattore di rischio	Peer group
EUR.I90	Obbligazionari Internazionali Convertibili
EUR.I91	Obbligazionari Paesi Emergenti
EUR.I92	Obbligazionari Asia Convertibili
EUR.I93	Obbligazionari USD High Yield
EUR.I94	Obbligazionari USD
EUR.I95	Obbligazionari USD Convertibili
EUR.I96	Obbligazionari Yen
EUR.I97	Obbligazionari Corporate IG EMU
EUR.I98	Obbligazionari Governativi USD 1-3 Anni
EUR.I99	Obbligazionari Corporate IG USD

Tabella 12: Fattori di rischio indici benchmark fondi comuni di investimento

Commodities

Estensione: Codice Commodity

Esempio: EUR.CGAS

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Fattore di rischio	Descrizione	Unità di misura ¹
EUR.CALU	Alluminio	Euro per Libbra
EUR.CCOC	Cacao	Euro per Tonnellata
EUR.CCOF	Caffè	Euro per Libbra
EUR.CCOP	Rame	Euro per Tonnellata
EUR.CGAS	Gas Naturale	Euro per Million of British Thermal Units
EUR.CGLD	Oro	Euro per Oncia Troy
EUR.CLED	Piombo	Euro per Tonnellata
EUR.CNKL	Nickel	Euro per Tonnellata
EUR.CPAL	Palladio	Euro per Oncia Troy
EUR.CPLA	Platino	Euro per Oncia Troy
EUR.CSLV	Argento	Euro per Oncia Troy
EUR.CSUG	Zucchero	Euro per Libbra
EUR.CTIN	Stagno	Euro per Tonnellata
EUR.CUNL	Unleaded Gas	Euro per Gallone
EUR.CWTI	Light Sweet Crude	Euro per Barile
EUR.CZNC	Zinco	Euro per Tonnellata

Tabella 13: Fattori di rischio commodities

¹ 1 Oncia Troy = 31.1035 grammi, 1 Libbra = 454 grammi, 1 gallone = 3.785 litri, 1 Barile = da 120 a 159 litri, 1 BTU = 252 calorie

Indici di Hedge Funds

Estensione: Codice Indice di Hedge Fund

Esempio: EUR.IHDGo6

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Fattore di rischio	Descrizione	Frequenza	Conversione Indice in EUR
EUR.IHDGo2	Convertible Arbitrage Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo4	Emerging Markets Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo5	Equity Market Neutral Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo6	Event Driven Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo7	Global Macro Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo8	Long Short Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDGo9	Fixed Income Arbitrage Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDG10	Managed Funds Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDG14	Multi Strategy Hedge	Monthly	Si
EUR.IHDG15	Multi Strategy Hedge	Monthly	No

Indici CCT/MTS

Estensione: Codice Indice

Esempio: EUR.ICCT

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Fattore di rischio	Descrizione
EUR.IBOT	Indice BOT MTS
EUR.ICCT	Indice CCT MTS
EUR.IMTSBI	Indice CCT ex Banca d'Italia
EUR.IMTSMT	Indice MTS Italia Medio Termine

Tabella 14: Fattori di rischio indici CCT/MTS

Altri indici

Estensione: Codice Indice

Esempio: EUR.ITBANKS

Informazioni: Lambda, Price Volatility, Mean

Fattore di rischio	Descrizione
EUR.ITBANKS	Indice azioni di banche Italia

Tabella 15: Fattori di rischio altri indici