

TS BUND Real

Aprile 2014 Gennaio 2015

Analysis & Research

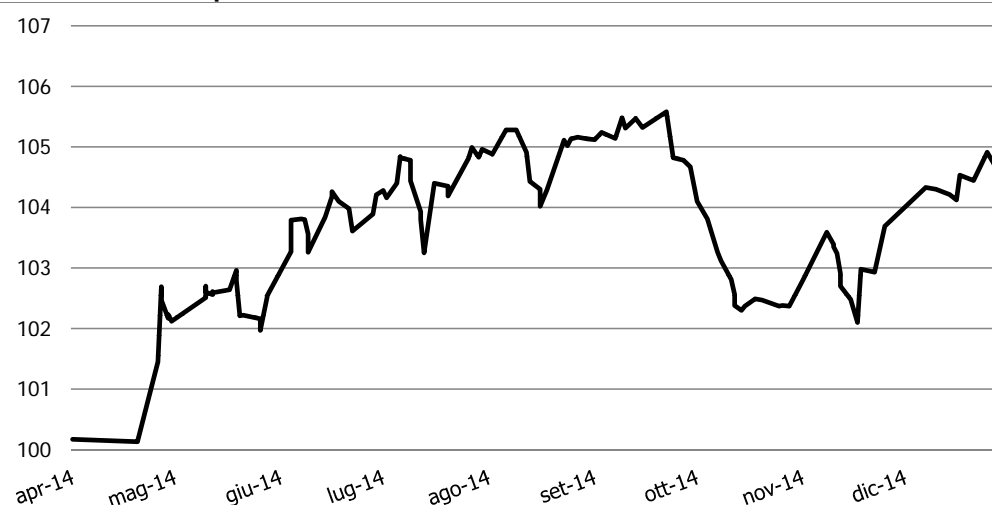
www.moneyriskanalysis.com



Performance

Cumulative Return	5.98%
Number of Periods:	119
% Positive Dailies:	41.2%
% Negative Dailies:	58.8%
Average Gain:	0.38%
Average Loss:	-0.18%
Highest Daily Return:	1.86%
Lowest Daily Return:	-0.72%
Average Daily Return:	0.05%
Compound. Daily Return:	0.05%
Compound. Annual Return:	8.06%

Performance Graph



Risk

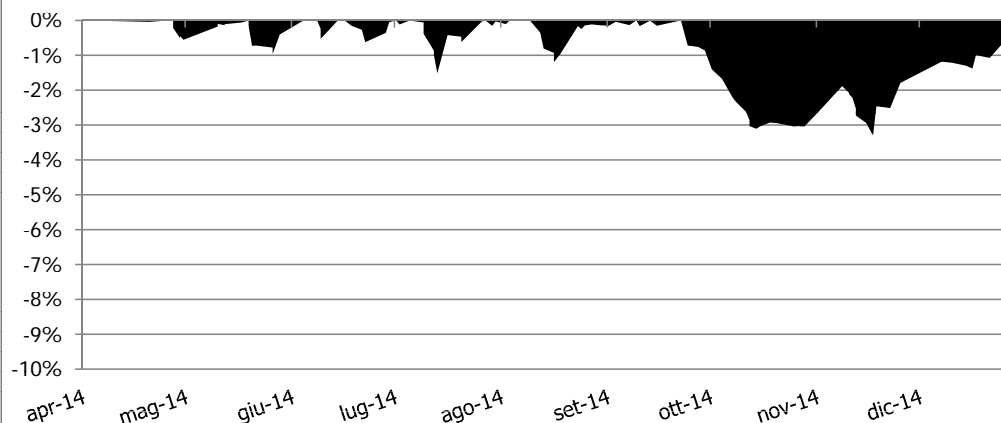
Maximum Drawdown:	-3.30%
Standard Deviation Daily:	0.39%
Standard Dev Annual:	4.95%
Sortino Ratio Annual:	2.68
Sharpe Ratio Annual:	1.17
Calmar Ratio Annual:	2.44

Le informazioni contenute in questo report sono state preparate con dati provenienti da fonti affidabili, ma adeguatezza, accuratezza o completezza di qualsiasi informazione non possono essere garantite.

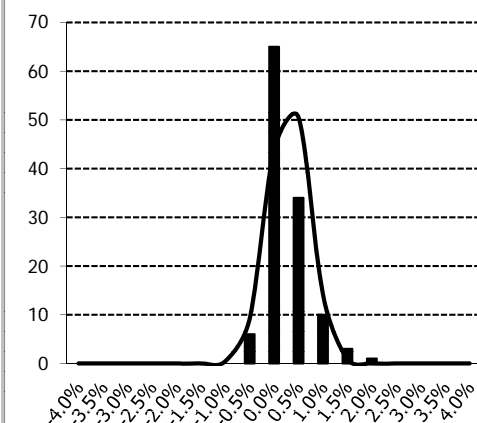
Description

Capitale Iniziale: 200.000 Euro
 Periodo Analizzato: 9 mesi
 Rendimento Cumulativo: 5.98%
 Rendimento Annuo Ponderato: 8.06%
 Periodo Massima Perdita: -3.30%
 Volatilità Annuo: 4.95%
 Sharpe Ratio: 1.17

Drawdown Analysis



Daily Distribution



La performance del passato non è indicativa di uguali rendimenti nel futuro. Questo report non rappresenta una sollecitazione a comprare quote di Fondi di Investimento o di qualsiasi altro strumento finanziario, nè un servizio di consulenza, ma solo un servizio di elaborazione ed analisi di dati storici di strumenti finanziari.

Copyright Money Risk Analysis (C) Riproduzione riservata.