

TS S&P 4 ORE

2015 - 2021

Analysis & Research

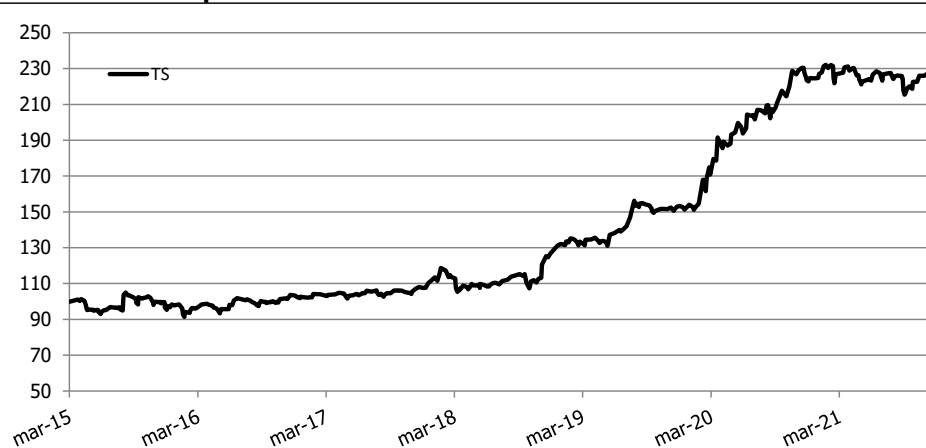
www.moneyriskanalysis.com

MRA money risk analysis

Performance

Cumulative Return	125.17%
Number of Periods:	392
% Positive Dailies:	51.0%
% Negative Dailies:	49.0%
Average Gain:	1.30%
Average Loss:	-0.90%
Highest Daily Return:	9.25%
Lowest Daily Return:	-4.45%
Average Daily Return:	0.22%
Compound. Daily Return:	0.21%
Compound. Annual Return:	13.30%

Performance Graph



Risk

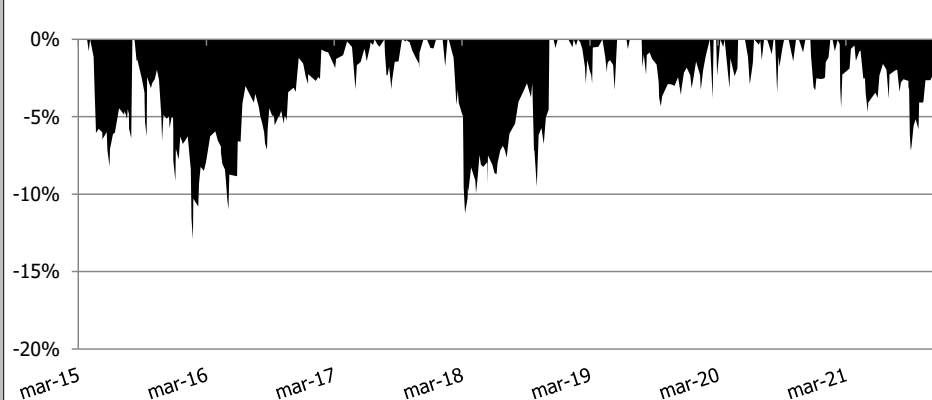
Maximum Drawdown:	-12.92%
Standard Deviation Daily:	1.59%
Standard Dev Annual:	12.34%
Sortino Ratio Annual:	1.84
Sharpe Ratio Annual:	0.85
Calmar Ratio Annual:	1.03

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.

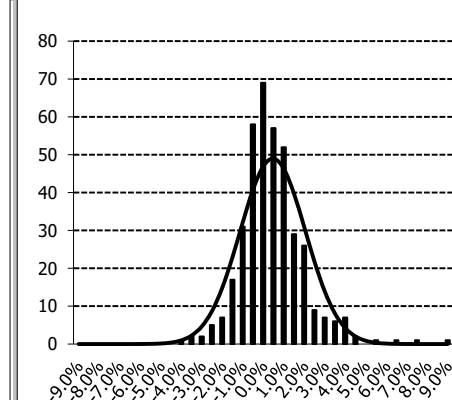
Description

Capitale Iniziale: 100.000 Euro
Periodo Analizzato: 6 anni
Rendimento Cumulativo: 125.17%
Rendimento Annuo Ponderato: 13.30%
Periodo Massima Perdita: -12.92%
Volatilità Annuo: 12.34%
Sharpe Ratio: 0.65

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.