

Portafoglio Prudente 3

Maggio 2018

Analysis & Research

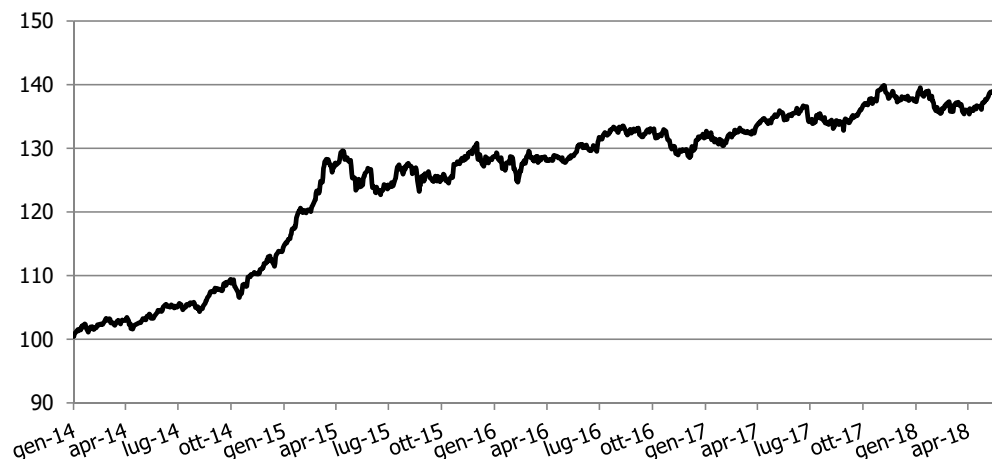
www.moneyriskanalysis.com

MRA money risk analysis

Performance

Cumulative Return	39.06%
Number of Periods:	1091
% Positive Dailies:	55.8%
% Negative Dailies:	44.2%
Average Gain:	0.24%
Average Loss:	-0.23%
Highest Daily Return:	1.17%
Lowest Daily Return:	-1.47%
Average Daily Return:	0.03%
Compound. Daily Return:	0.03%
Compound. Annual Ret.:	7.91%

Performance Graph



Risk

Maximum Drawdown:	-5.33%
Standard Deviat. Daily:	0.31%
Standard Dev Annual:	4.88%
Sortino Ratio Annual:	1.67
Sharpe Ratio Annual:	1.18
Calmar Ratio Annual:	1.48

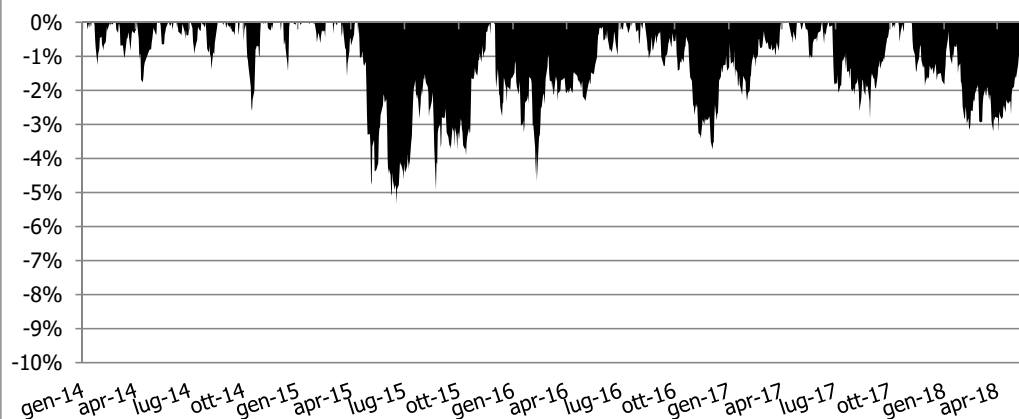
Le informazioni contenute in questo report sono state preparate con dati provenienti da fonti affidabili, ma adeguatezza, accuratezza o completezza di qualsiasi informazione non possono essere garantite.

Description

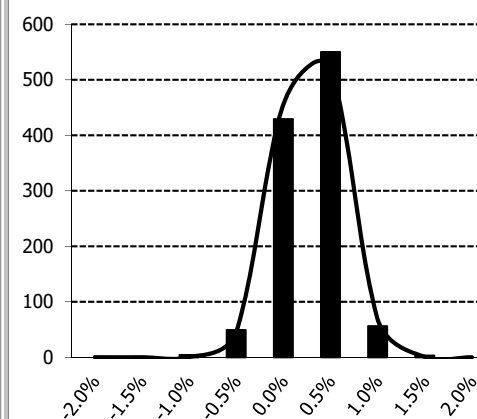
In questo report viene analizzato un portafoglio di Fondi di Investimento. Il portafoglio in questione è considerato "prudente" ed è così composto:
20% Fondi Azionari
80% Fondi Obbligazionari

Periodo Analizzato: 53 mesi
Rendimento Cumulativo: 39.06%
Rendimento Annuo Ponderato: 7.91%
Periodo Massima Perdita: -5.33%
Volatilità Annuo: 4.88%
Sharpe Ratio: 1.18

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.