

Portafoglio Bilanciato 3

Maggio 2018

Analysis & Research

www.moneyriskanalysis.com

MRA money risk analysis

Performance

Cumulative Return	55.12%
Number of Periods:	1091
% Positive Dailies:	58.0%
% Negative Dailies:	42.0%
Average Gain:	0.34%
Average Loss:	-0.37%
Highest Daily Return:	1.94%
Lowest Daily Return:	-2.64%
Average Daily Return:	0.04%
Compound. Daily Return:	0.04%
Compound. Annual Ret.:	10.67%

Performance Graph



Risk

Maximum Drawdown:	-8.98%
Standard Deviat. Daily:	0.47%
Standard Dev Annual:	7.50%
Sortino Ratio Annual:	1.55
Sharpe Ratio Annual:	1.13
Calmar Ratio Annual:	1.19

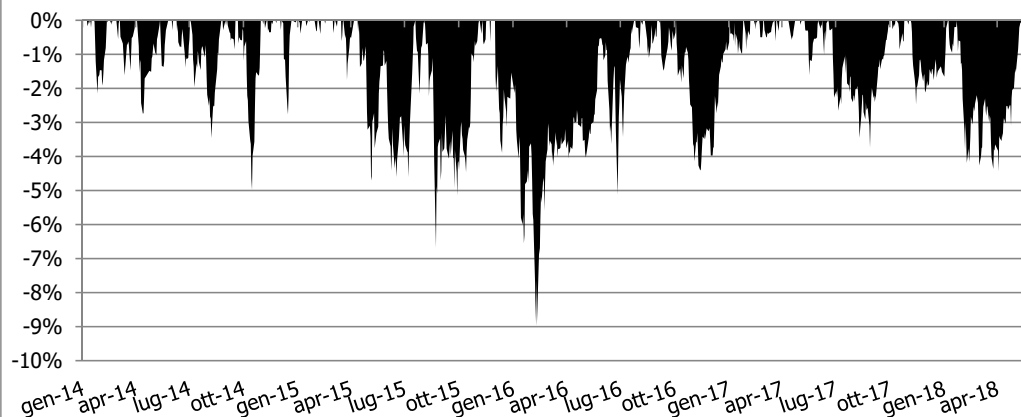
Le informazioni contenute in questo report sono state preparate con dati provenienti da fonti affidabili, ma adeguatezza, accuratezza o completezza di qualsiasi informazione non possono essere garantite.

Description

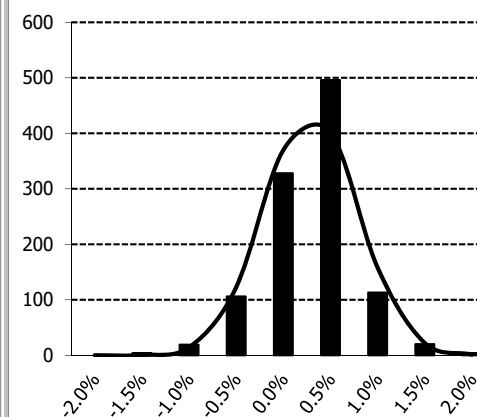
In questo report viene analizzato un portafoglio di Fondi di Investimento. Il portafoglio in questione è considerato "bilanciato" ed è così composto:
50% Fondi Azionari
50% Fondi Obbligazionari

Periodo Analizzato: 53 mesi
Rendimento Cumulativo: 55.12%
Rendimento Annuo Ponderato: 10.67%
Periodo Massima Perdita: -8.98%
Volatilità Annuo: 7.50%
Sharpe Ratio: 1.13

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.