

Portafoglio Aggressivo 3

Maggio 2018

Analysis & Research

www.moneyriskanalysis.com

MRA money risk analysis

Performance

Cumulative Return	71.99%
Number of Periods:	1091
% Positive Dailies:	57.4%
% Negative Dailies:	42.6%
Average Gain:	0.48%
Average Loss:	-0.52%
Highest Daily Return:	3.01%
Lowest Daily Return:	-3.94%
Average Daily Return:	0.05%
Compound. Daily Return:	0.05%
Compound. Annual Ret.:	13.34%

Performance Graph



Risk

Maximum Drawdown:	-13.15%
Standard Deviat. Daily:	0.68%
Standard Dev Annual:	10.80%
Sortino Ratio Annual:	1.38
Sharpe Ratio Annual:	1.04
Calmar Ratio Annual:	1.01

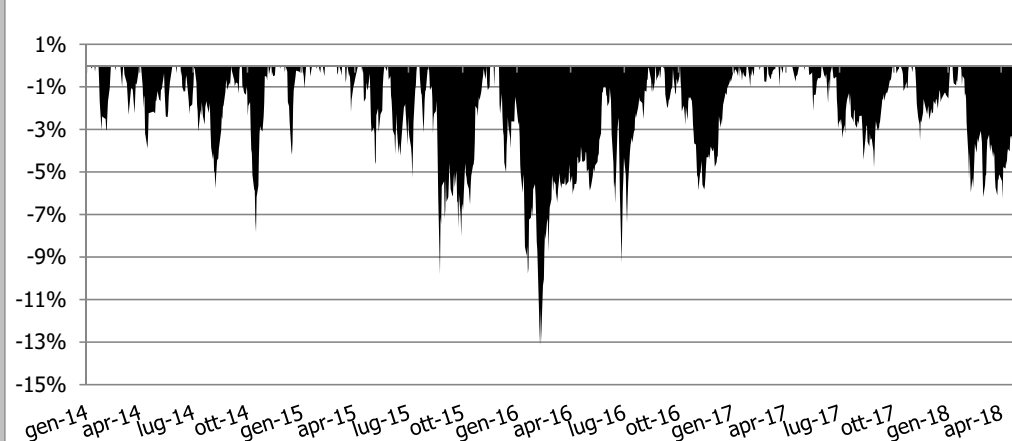
Le informazioni contenute in questo report sono state preparate con dati provenienti da fonti affidabili, ma adeguatezza, accuratezza o completezza di qualsiasi informazione non possono essere garantite.

Description

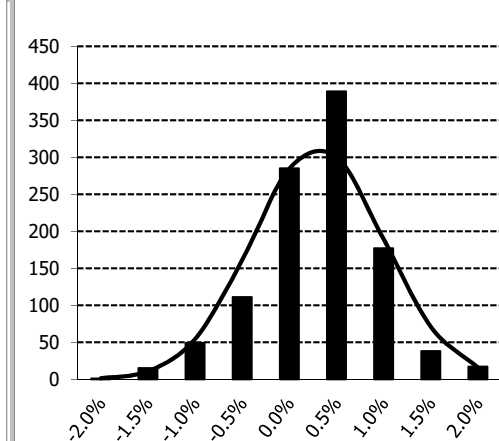
In questo report viene analizzato un portafoglio di Fondi di Investimento. Il portafoglio in questione è considerato "aggressivo" ed è così composto:
80% Fondi Azionari
20% Fondi Obbligazionari

Periodo Analizzato: 51 mesi
Rendimento Cumulativo: 63.81%
Rendimento Annuo Ponderato: 12.56%
Periodo Massima Perdita: -13.15%
Volatilità Annuo: 10.90%
Sharpe Ratio: 0.96

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.