

# PTFL\_AZIONARIO

OCT 2011 - OCT 2018

Analysis & Research

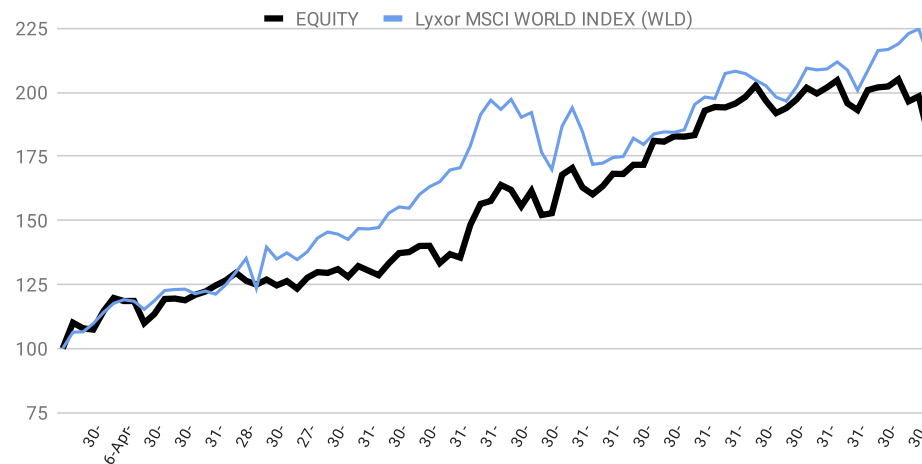
[www.moneyriskanalysis.com](http://www.moneyriskanalysis.com)



## Performance

Cumulative Return	82.37%
Number of Periods:	85
% Positive Dailies:	63.5%
% Negative Dailies:	36.5%
Average Gain:	2.53%
Average Loss:	-2.32%
Highest Monthly Return:	10.07%
Lowest Monthly Return:	-8.08%
Average Monthly Return:	0.76%
Compound. Monthly Return:	0.71%
Compound. Annual Return:	8.85%

## Performance Graph



## Risk

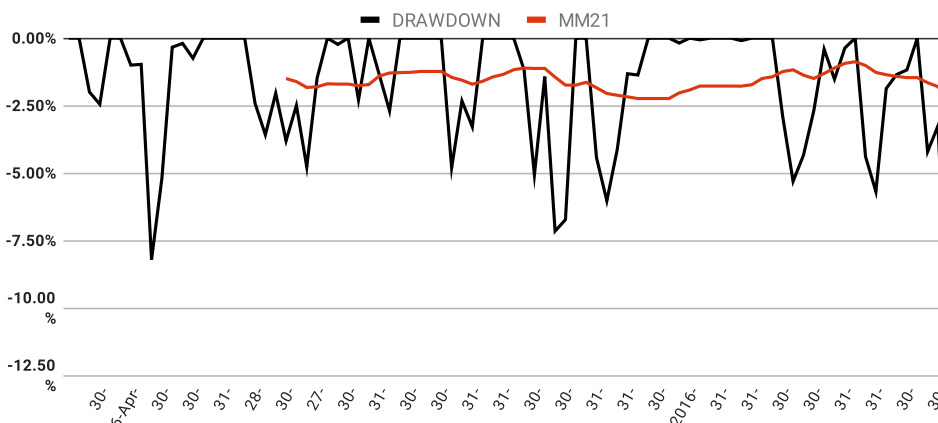
Maximum Drawdown:	-11.07%
Standard Deviation Monthly:	3.27%
Standard Dev Annual:	11.33%
Sortino Ratio Annual:	1.13
Sharpe Ratio Annual:	0.72
Equity (LastValue)	182.37
MM5 (LastValue)	196.91
MM27 (LastValue)	195.20
Risk Free Rate	1.00%

## Description

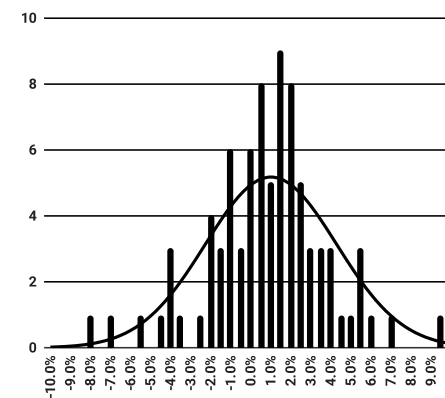
Starting Equity	100,000.00
Analyzed Period (Month)	85.00

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.

## Drawdown Analysis



## Monthly 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.**