

Portafoglio Equity

Ott. 2011- Apr. 2023

Analysis & Research

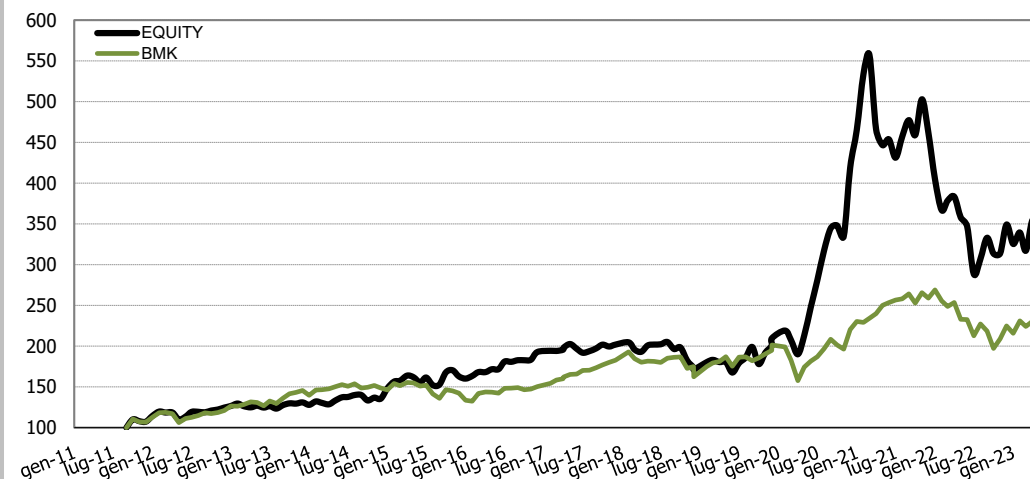
www.moneyriskanalysis.com



Performance

Cumulative Return	241.97%
Number of Periods:	139
% Positive Monthly:	61.2%
% Negative Monthly:	38.1%
Average Gain:	4.36%
Average Loss:	-4.22%
Highest Monthly Return:	25.16%
Lowest Monthly Return:	-16.83%
Average Monthly Return:	1.06%
Compound. Monthly Ret:	0.89%
Compound. Annual Ret:	11.20%

Performance Graph



Risk

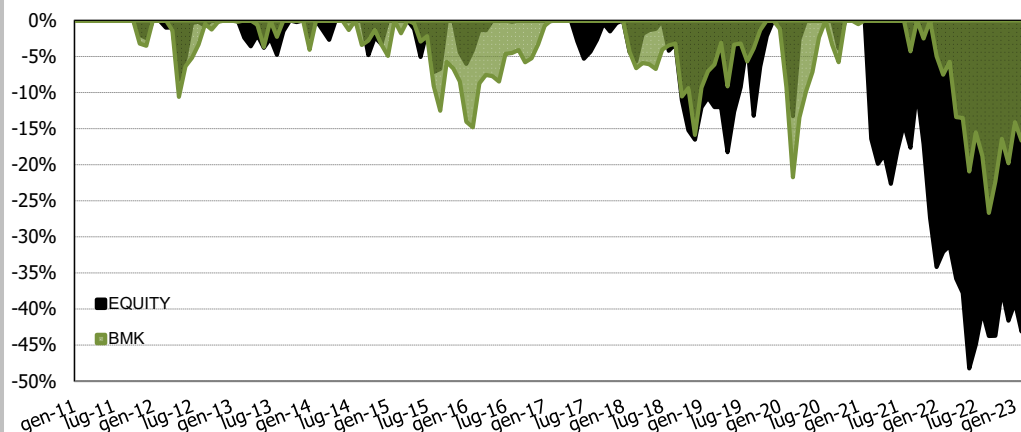
Maximum Drawdown:	-48.24%
Standard Deviat Monthly:	5.93%
Standard Deviat Annual:	20.54%
Sortino Ratio Annual:	0.79
Sharpe Ratio Annual:	0.57
Calmar Ratio Annual:	0.39
Risk Free Rate:	1.00%
Equity (Last Value)	341.97
MM5 (Last Value)	328.95
MM27 (Last Value)	401.38
Risk Free Rate	1.00%

Description

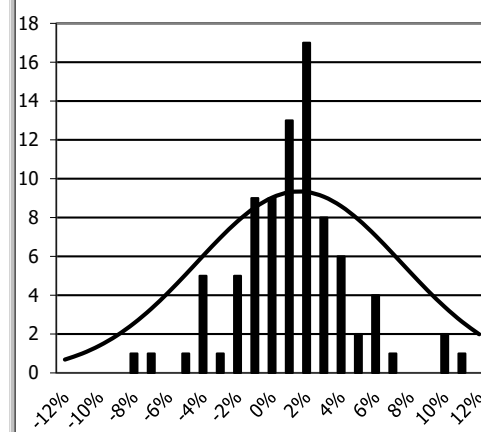
Starting Equity	€ 100,000
Analyzed Period (Months)	139

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.