PORTAFOGLIO FINALE NOVEMBRE

PORTAFOGLIO EQUITY GLOBAL

Nome	31/10/2024	Mercato	Codice	PESO	30/11/2024	performance	contributo %
APPLOVIN CORP.	169,39	Azioni NASDAQ	APP	10%	336,75	98,80	9,88
AXON ENTERPRISE INC.	423,5	Azioni NASDAQ	AXON	10%	646,96	52,77	5,28
JD.COM INC. ADS	40,62	Azioni NASDAQ	JD	10%	37,38	-7,98	- 0,80
MICROSTRATEGY INC.	244,35	Azioni NASDAQ	MSTR	10%	387,47	58,57	5,86
PALANTIR TECHNOLOGIES	41,56	Azioni NYSE	PLTR	10%	67,08	61,41	6,14
SEA LTD.	94	Azioni NYSE	SE	10%	113,73	20,99	2,10
SIEMENS ENERGY AG NA O.N.	37,53	Azioni Germania	ENR	10%	51,02	35,94	3,59
TPG INC.	67,68	Azioni NASDAQ	TPG	10%	69,96	3,37	0,34
UNITED AIRLINES HLD.	78,25	Azioni NASDAQ	UAL	10%	96,83	23,74	2,37
ZAI LAB LTD.	30,22	Azioni NASDAQ	ZLAB	10%	28,85	-4,53	- 0,45
							34,31
BENCHMARK MSCI AC WORLD EQ MENSILE	832,89				862,49		3,55
PERFORMANCE DA OTTOBRE 2011 BASE 100	631,39%						731388

PERFORMANCE 2019 +22,53%
PERFORMANCE 2020 +121,92%
PERFORMANCE 2021 -13,02%
PERFORMANCE 2022 -19,60%
PERFORMANCE 2023 +33.32%

PORTAFOGLIO INIZIALE DICEMBRE

PORTAFOGLIO EQUITY GLOBAL

Nome	30/11/2024	Mercato	Codice	PESO	30/11/2024	performance	contributo %
AXON ENTERPRISE INC.	AXON	646,96	APP	10%	646,96	0,00	-
DOORDASH INC.	DASH	180,48	AXON	10%	180,48	0,00	-
EXELIXIS INC.	EXEL	36,46	JD	10%	36,46	0,00	-
FAIR ISAAC CORP.	FICO	2380,92	MSTR	10%	2380,92	0,00	-
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC.	IBKR	191,09	PLTR	10%	191,09	0,00	-
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	RCL	244,38	SE	10%	244,38	0,00	-
SIEMENS ENERGY AG NA O.N.	ENR	51,02	ENR	10%	51,02	0,00	-
SPORTRADAR GROUP AG	SRAD	17,34	TPG	10%	17,34	0,00	-
UNITED AIRLINES HLD.	UAL	96,83	UAL	10%	96,83	0,00	-
VISTRA CORP.	VST	159,95	ZLAB	10%	159,95	0,00	-
							-
BENCHMARK MSCI AC WORLD EQ MENSILE	862,49				862,49		0,00
PERFORMANCE DA OTTOBRE 2011 BASE 100	631,39%						731388

METOLOGIA: Ogni 1 del mese viene aggiornato il portafoglio in base al modello quantitativo MRA.

La **SELEZIONE** riguarda una rosa di 350 titoli appartenenti ai seguenti indici:
NYSE, NASDAQ, DAX30, CAC40, FTSEMIB40, AEX25, IBEX, PSI20.

I primi dieci titoli per punteggio indicatore MRA entrano a far parte del portafoglio in misura del 10% ciascuno.

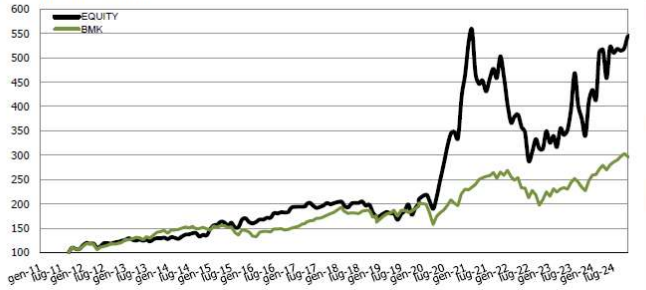
Confronto portafoglio Equity con MSCI World dal 2011 al 31 OTTOBRE 2024

Portafoglio Equity | Ott. 2011- Ott. 2024 | Analysis & Research | www.moneyriskanalysis.com | MRA

Performance

Cumulative Return	444.56%
Number of Periods:	157
% Positive Monthly:	61.1%
% Negative Monthly:	38.2%
Average Gain:	4.96%
Average Loss:	-4.54%
Highest Monthly Return:	25.16%
Lowest Monthly Return:	-16.83%
Average Monthly Return:	1.30%
Compound. Monthly Ret:	1.09%
Compound. Annual Ret:	13.83%

Performance Graph



Risk

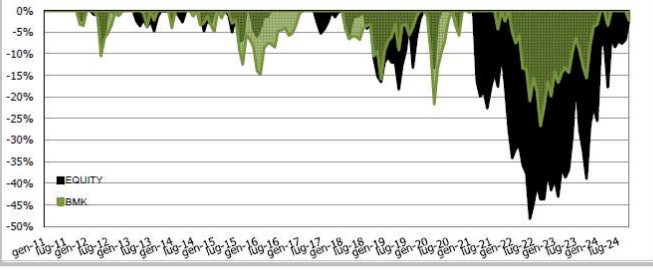
Maximum Drawdown:	-48.24%
Standard Deviat Monthly:	6.67%
Standard Deviat Annual:	23.10%
Sortino Ratio Annual:	0.92
Sharpe Ratio Annual:	0.63
Calmar Ratio Annual:	0.39
Risk Free Rate:	1.00%
Equity (Last Value)	544.56
MM5 (Last Value)	521.54
MM27 (Last Value)	414.63
Risk Free Rate	1.00%

Description

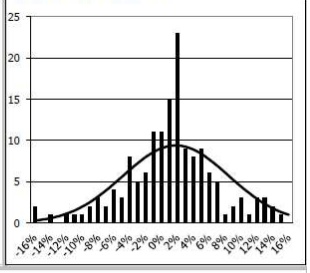
Starting Equity	€ 100,000
Analyzed Period (Months)	157

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.

Performance mensili dal 2015

Equity Glb	JAN	FEB	MAR	APR	MAY	JUN	JUL	AUG	SEP	OCT	NOV	DEC	Year
2015	9.44%	5.52%	0.72%	3.97%	-1.18%	-3.94%	3.83%	-5.81%	0.46%	9.80%	1.58%	-4.43%	20.24%
2016	-1.67%	2.01%	2.94%	-0.05%	2.13%	0.00%	5.45%	-0.18%	1.15%	-0.06%	0.33%	5.20%	18.37%
2017	0.76%	-0.09%	0.78%	1.35%	2.22%	-2.92%	-2.46%	1.02%	1.72%	2.35%	-1.12%	1.17%	4.71%
2018	1.39%	-4.39%	-1.35%	4.05%	0.53%	0.17%	1.39%	-4.21%	0.99%	-8.08%	-4.68%	-1.54%	-15.21%
2019	5.39%	1.53%	-1.48%	0.00%	-7.11%	6.87%	3.91%	6.92%	-10.6%	7.85%	4.52%	4.55%	22.54%
2020	4.47%	-5.31%	-8.41%	12.3%	16.0%	13.5%	12.9%	8.59%	1.07%	-3.87%	25.2%	11.1%	121.87%
2021	14.68%	4.45%	-16.41%	-4.15%	1.58%	-4.97%	6.03%	4.42%	-3.83%	9.56%	-8.15%	-12.39%	-13.02%
2022	-9.35%	3.18%	1.26%	-6.61%	-3.09%	-16.83%	6.41%	8.44%	-5.81%	0.05%	11.31%	-6.82%	-19.61%
2023	4.32%	-6.60%	11.89%	-3.59%	2.83%	12.31%	18.60%	-14.07%	-6.75%	-9.34%	20.43%	5.87%	33.33%
2024	-4.36%	23.15%	1.06%	-11.25%	13.91%	-2.25%	1.56%	-0.68%	0.98%	4.76%			25.52%

General Disclaimer

L'analisi dei dati e le informazioni contenute in questo documento sono preparate a solo scopo informativo, e non rappresentano un'offerta o sollecitazione di un'offerta a comprare o vendere quote di Fondi di Investimento o di qualsiasi altro strumento finanziario, o a sottoscrivere Contratti di Gestione di qualunque societa'.

Questo documento non fornisce nessuna indicazione, consulenza o informazione necessaria a prendere alcuna decisione il servizio fornito in questo sito e nei report è esclusivamente di analisi: pertanto, in nessun modo i segnali contenuti in questi portafogli o sui nostri report devono essere intesi come raccomandazioni di acquisto, vendita o comunque di operatività o consulenza personalizzata, in ossequio alle vigenti leggi italiane e europee (MiFid 2).di investimento. La performance del passato non e' indicativa di uguali rendimenti nel futuro.

Copyright Money Risk Analysis © Riproduzione riservata