

Portafoglio Dinamico

Ott. 2011- Apr. 2023

Analysis & Research

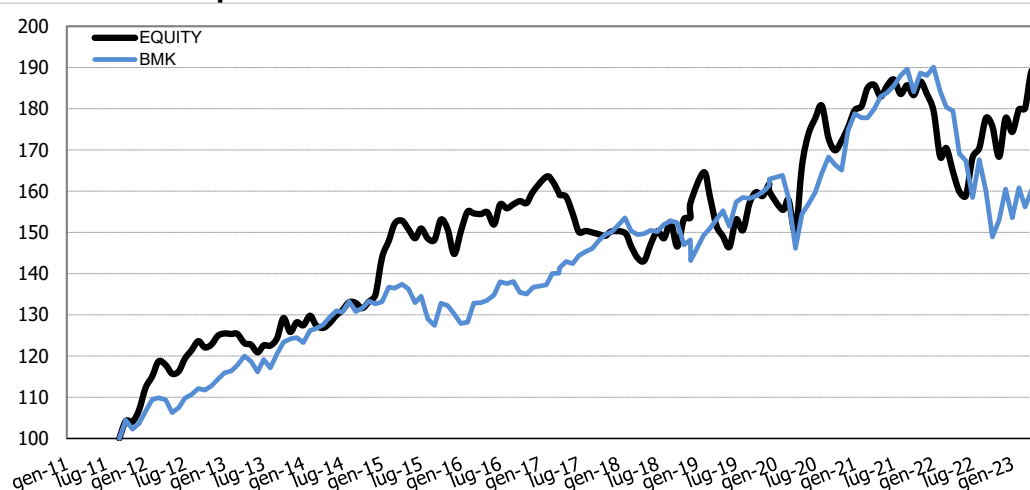
www.moneyriskanalysis.com



Performance

Cumulative Return	86.14%
Number of Periods:	139
% Positive Monthly:	53.2%
% Negative Monthly:	46.8%
Average Gain:	2.33%
Average Loss:	-1.63%
Highest Monthly Return:	10.54%
Lowest Monthly Return:	-6.23%
Average Monthly Return:	0.48%
Compound. Monthly Ret:	0.45%
Compound. Annual Ret:	5.51%

Performance Graph



Risk

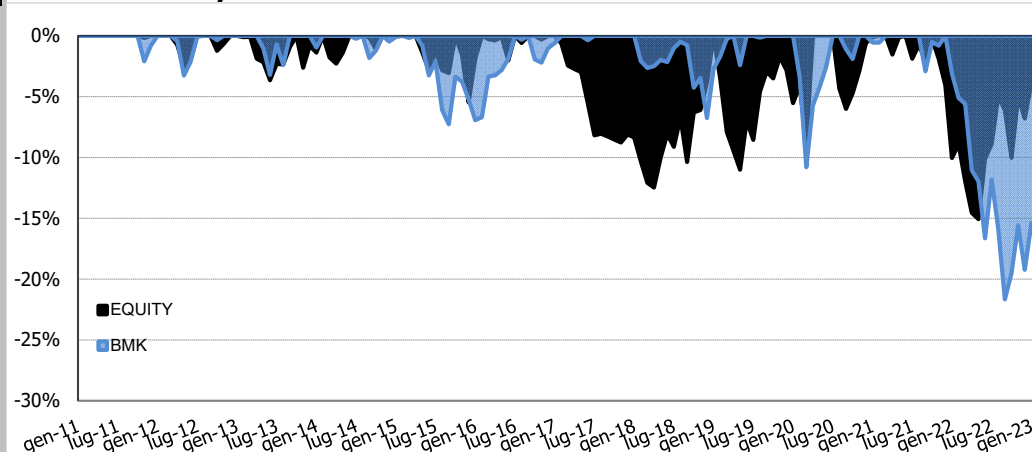
Maximum Drawdown:	-15.07%
Standard Deviat Monthly:	2.56%
Standard Deviat Annual:	8.87%
Sortino Ratio Annual:	0.85
Sharpe Ratio Annual:	0.54
Calmar Ratio Annual:	0.28
Risk Free Rate:	1.00%
Equity (Last Value)	186.14
MM5 (Last Value)	176.08
MM27 (Last Value)	177.17
Risk Free Rate	1.00%

Description

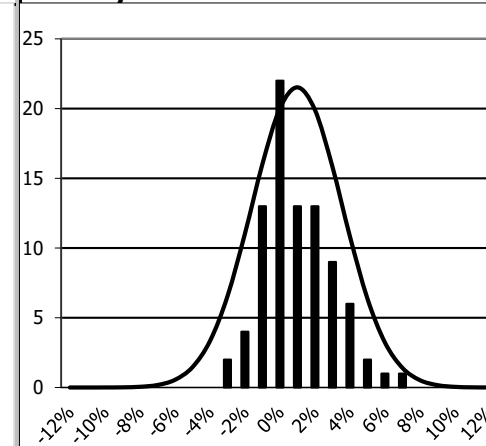
Starting Equity	€ 100,000
Analyzed Period (Months)	139

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.