

Portafoglio ETF

Ott. 2018- Dic. 2021

Analysis & Research

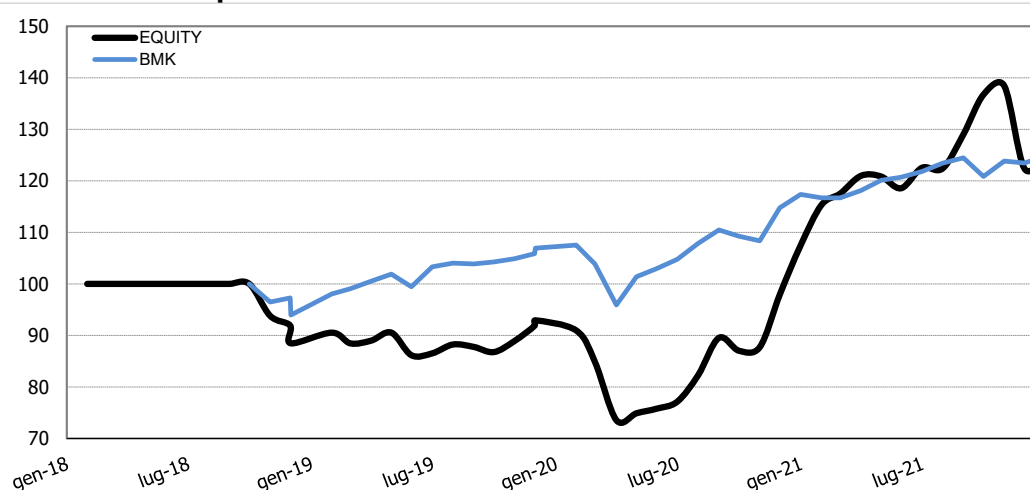
www.moneyriskanalysis.com



Performance

| | |
|-------------------------|---------|
| Cumulative Return | 24.89% |
| Number of Periods: | 39 |
| % Positive Monthly: | 61.5% |
| % Negative Monthly: | 38.5% |
| Average Gain: | 3.61% |
| Average Loss: | -3.96% |
| Highest Monthly Return: | 11.67% |
| Lowest Monthly Return: | -13.33% |
| Average Monthly Return: | 0.70% |
| Compound. Monthly Ret: | 0.57% |
| Compound. Annual Ret: | 7.08% |

Performance Graph



Risk

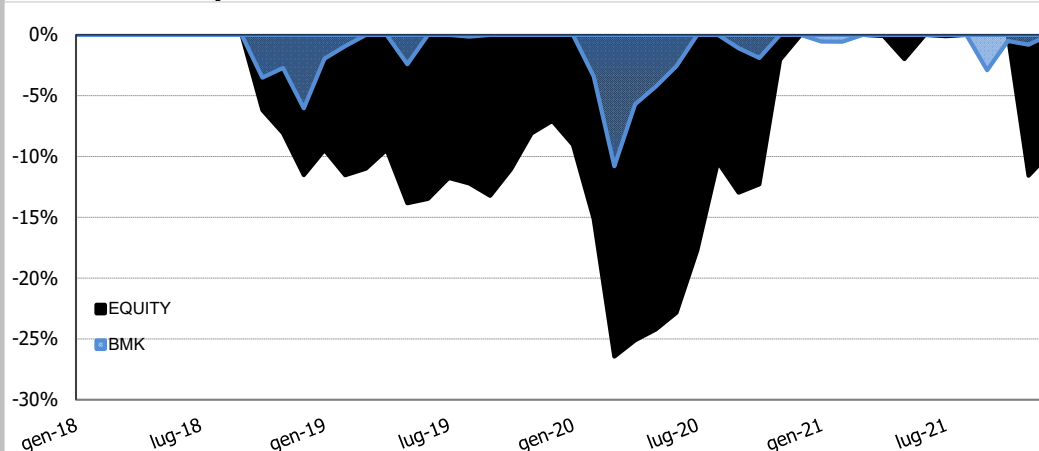
| | |
|--------------------------|---------|
| Maximum Drawdown: | -26.45% |
| Standard Deviat Monthly: | 5.08% |
| Standard Deviat Annual: | 17.60% |
| Sortino Ratio Annual: | 0.87 |
| Sharpe Ratio Annual: | 0.42 |
| Calmar Ratio Annual: | #DIV/0! |
| Risk Free Rate: | 1.00% |
| Equity (Last Value) | 124.89 |
| MM5 (Last Value) | 122.67 |
| MM27 (Last Value) | 97.01 |
| Risk Free Rate | 1.00% |

Description

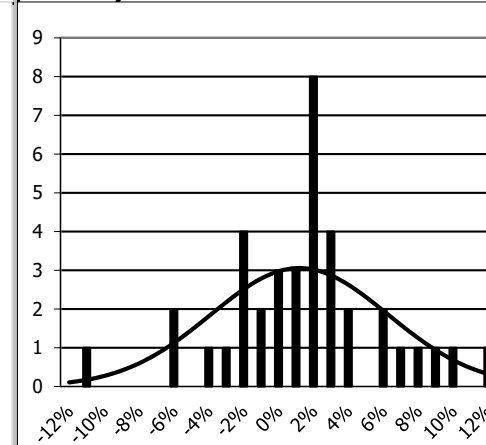
| | |
|--------------------------|-----------|
| Starting Equity | € 100,000 |
| Analyzed Period (Months) | 39 |

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.