

PTFL_OBBLIGAZ

OCT 2011 - OCT 2018

Analysis & Research

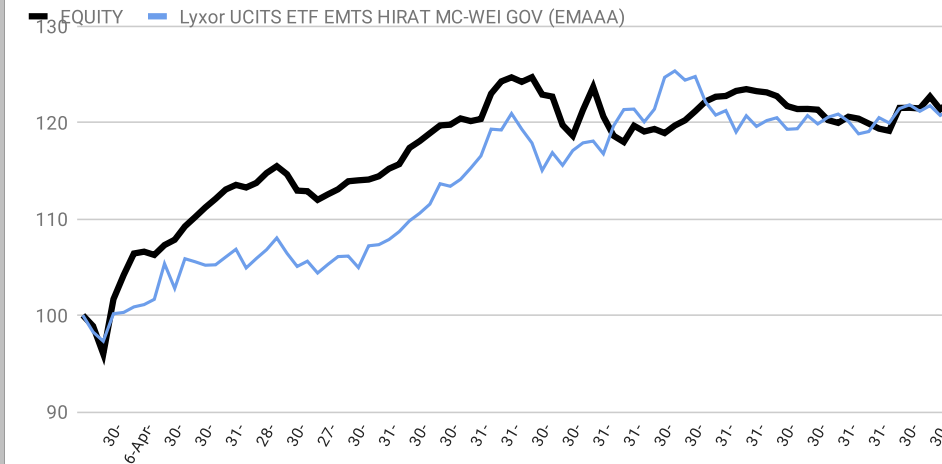
www.moneyriskanalysis.com



Performance

| | |
|---------------------------|--------|
| Cumulative Return | 22.13% |
| Number of Periods: | 85 |
| % Positive Dailies: | 61.2% |
| % Negative Dailies: | 38.8% |
| Average Gain: | 0.86% |
| Average Loss: | -0.73% |
| Highest Monthly Return: | 5.91% |
| Lowest Monthly Return: | -2.92% |
| Average Monthly Return: | 0.24% |
| Compound. Monthly Return: | 0.24% |
| Compound. Annual Return: | 2.86% |

Performance Graph



Risk

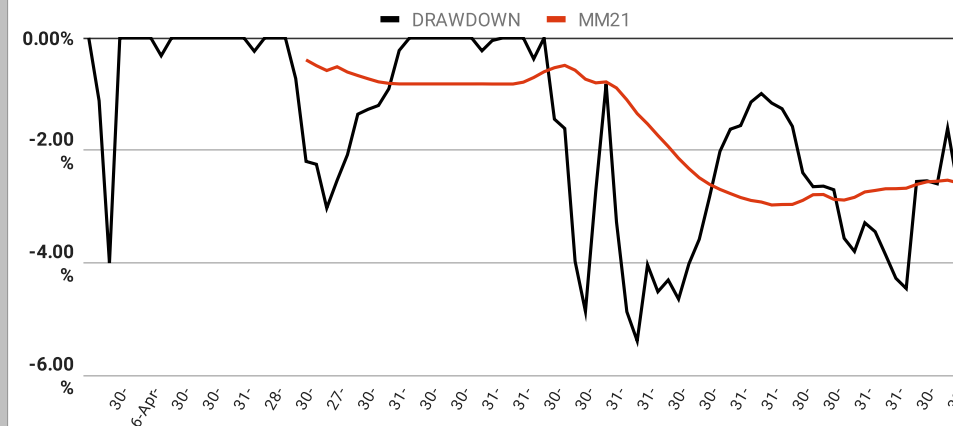
| | |
|-----------------------------|--------|
| Maximum Drawdown: | -5.39% |
| Standard Deviation Monthly: | 1.16% |
| Standard Dev Annual: | 4.03% |
| Sortino Ratio Annual: | 0.77 |
| Sharpe Ratio Annual: | 0.47 |
| Equity (LastValue) | 122.13 |
| MM5 (LastValue) | 121.84 |
| MM27 (LastValue) | 121.52 |
| Risk Free Rate | 1.00% |

Description

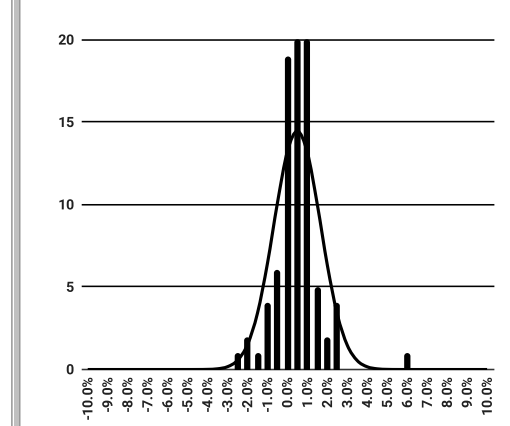
| | |
|-------------------------|------------|
| Starting Equity | 100,000.00 |
| Analyzed Period (Month) | 85.00 |

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.