

# IndiceA

## IndiceA Performance

Zaktualizowano: **Mon 30--01--2017**

Horyzont czasowy: **1 Tydzień**

Indeks bazowy: **EuroStoxx**

Data powstania: **Mon 07--10--2013**

Częstotliwość kalkulacji: **Cotygodniowa**

Symbol: **SX5E**

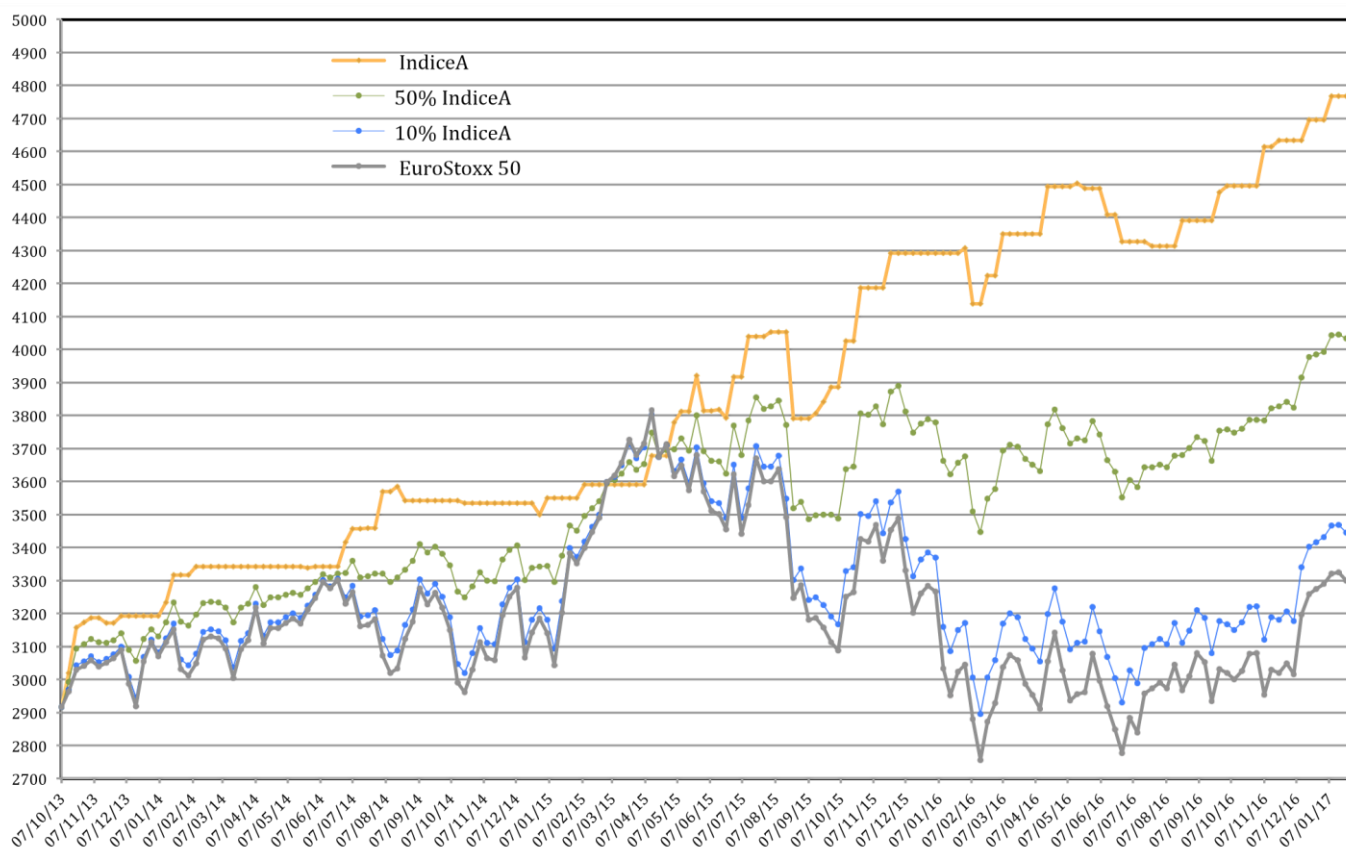
### Wystawienie IndiceA:

Pomiędzy 0 - 100%

Wydajność	EuroStoxx50 = 3303 (100% SX5E)	10% IndiceA = 3449 (90% SX5E + 10% IndiceA)	50% IndiceA = 4035 (50% SX5E + 50% IndiceA)	IndiceA = 4767 (100% IndiceA)
1. Zwrot (%)	+13.23%	+18.23%	+38.32%	+63.42%
2. Ryzyko (Maksymalna redukcja)	-27.77%	-23.87%	-11.37%	-6.46%
3. Czas (Wystawienie na ilość tygodni)	173 tygodnie	173 tygodnie	173 tygodnie	58 tygodnie
Stosunek Zwrot/Ryzyko	0.47	0.76	3.36	9.81
Stosunek Zwrot/Czas	0.07	0.10	0.22	1.09

Data rozpoczęcia **Pon 07--10--2013 (przy otwarciu):**

**punkty IndiceA = EuroStoxx 50 punktów = 2917 punktów**



**Statystyki:**

<b>Wydajność</b>	<b>EuroStoxx50 = 3303 (100% SX5E)</b>	<b>10% IndiceA = 3449 (90% SX5E + 10% IndiceA)</b>	<b>50% IndiceA = 4035 (50% SX5E + 50% IndiceA)</b>	<b>IndiceA = 4767 (100% IndiceA)</b>
Całkowity zwrot	+13.23%	+18.23%	+38.32%	+63.42%
Złożony roczny zwrot	+3.80%	+5.16%	+10.24%	+15.90%
Najwyższa redukcja	-27.77%	-23.87%	-11.37%	-6.46%
Zwrot YTD	+0.92%	+1.00%	+1.27%	+1.51%
Średni miesięczny zwrot	+0.31%	+0.42%	+0.81%	+1.23%
Średni tygodniowy zwrot	+0.07%	+0.09%	+0.18%	+0.28%
Standardowe roczne odchylenie	18.58%	16.64%	10.92%	8.62%
Współczynnik korelacji kontra SX5E	1	0.9797	0.9002	0.3570
Beta kontra SX5E	1	0.8772	0.5291	0.1656
Wskaźnik Sharpe'a (+)	0.20	0.31	0.93	1.84
Wskaźnik MAR (++)	0.13	0.21	0.90	2.46
<b>Alfa (+++)</b>	<b>0</b>	<b>+1.36%</b>	<b>+6.44%</b>	<b>+12.10%</b>

(+) = Roczny Zwrot dzielony przez roczny STD z współczynnikiem "0" jako wskaźnikiem wolnego ryzyka

(++) = Złożony Roczny Zwrot dzielony przez najwyższą redukcję

(+++ ) = Roczna nadwyżka kontra SX5E z współczynnikiem "0" jako wskaźnikiem wolnego ryzyka oraz "1" jako Beta

---

**IndiceA, Business Pôle, 1047 Route des Dolines, 06560 Sophia Antipolis, France, Email: [Contact@IndiceA.com](mailto:Contact@IndiceA.com)**