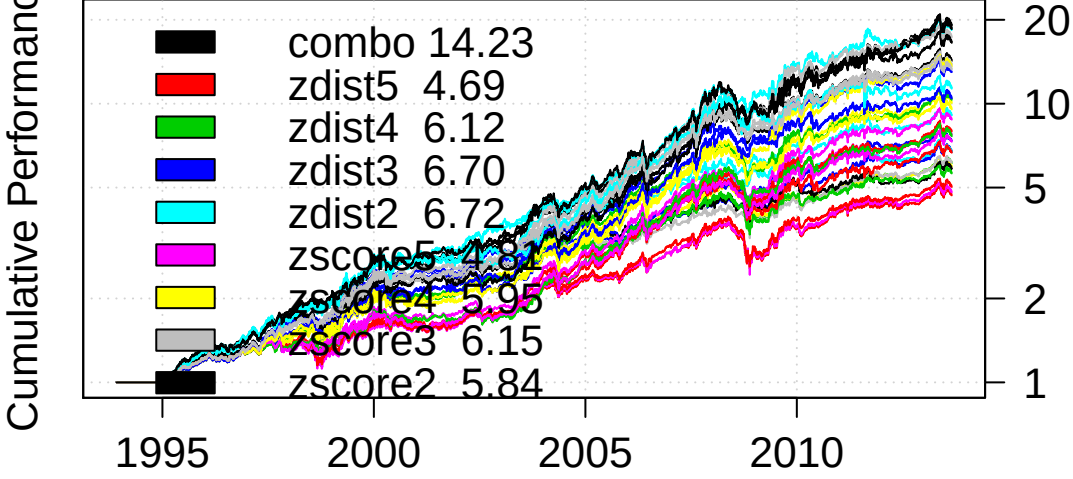

System	combo	zdist5	zdist4	zdist3	zdist2	zscore5	zscore4	zscore3	zscore2	zscore5 ewma	zscore4 ewma	zscore3 ewma	zscore2 ewma	zscore5 ewma2	zscore4 ewma2	zscore3 ewma2	zscore2 ewma2	zscore5 ewma3	zscore4 ewma3	zscore3 ewma3	zscore2 ewma3	zscore5 ewma4	zscore4 ewma4	zscore3 ewma4	zscore2 ewma4	zscore5 ewma5	zscore4 ewma5	zscore3 ewma5	zscore2 ewma5	zscore5 ewma6	zscore4 ewma6	zscore3 ewma6	zscore2 ewma6
Period	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31	1997-01-01 - 2012-12-31
Cagr	0.14	0.05	0.06	0.07	0.07	0.05	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07	0.06	0.06	0.07	0.07
Sharpe	1.1	0.52	0.73	0.81	0.81	0.58	0.69	0.76	0.76	0.69	0.73	0.78	0.78	0.73	0.76	0.79	0.79	0.76	0.78	0.79	0.79	0.78	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79	0.79
DVR	0.9	0.1	0.4	0.5	0.5	0.2	0.3	0.4	0.4	0.3	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4	0.4
Volatility	0.13	0.09	0.08	0.08	0.08	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09	0.09
MaxDD	-0.23	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20	-0.20
AvgDD	0.02	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
VaR	0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02	-0.02
CVaR	0.02	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04	-0.04
Exposure	0.92	0.51	0.61	0.66	0.66	0.56	0.61	0.64	0.64	0.61	0.63	0.65	0.65	0.63	0.64	0.65	0.65	0.64	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65	0.65