

MFO Premium

MultiSearch Screening Parameters



<p><u>Basic Info</u></p> <p>1) Asset Universe (Up To 5) 2) SubType (Up To 9) 3) Symbols (Up To 100)* 4) Age 5) Index Fund? 6) Names (Up To 10)*</p> <p><u>More Basic Info</u></p> <p>7) Type (Up To 5) 8) Objective (Up To 25) 9) Share Class 10) ETFs? 11) Smart Beta ETFs 12) Include Benchmark? 13) Socially Conscious?*</p> <p>14) ESC Score 15) Fund of Funds? 16) Management Approach 17) Interval Fund? 13) Include Averages?</p> <p><u>Categories</u></p> <p>14) U. S. Equity (Up To 9) 15) International Equity (Up To 9) 16) Global Equity (Up To 9) 17) Sector (Up To 9) 18) Commodity (Up To 4) 19) International Equity (Up To 9) 20) Trading (Up To 2) 21) Exclude Equity (Up To 25) 22) Exclude Mixed Asset, Alternative and Commodity (Up To 15) 23) Bond (Up To 9) 24) Mixed Asset (Up To 9) 25) Alternative (Up To 7) 26) Municipal Bond (Up To 9) 27) Money Market (Up To 7) 28) Index (Up To 7) 29) Trading (Up To 2) 30) Exclude Bond (Up To 25) 31) Exclude Money Market (Up To 6)</p> <p><u>Risk & Return Metrics</u></p> <p>32) MFO Risk (Up To 4) 33) Max Drawdown (MAXDD) 34) MAXDD Rating 35) Standard Deviation (STDEV) 36) STDEV Rating 37) MFO Rating 38) Annual Percent Return (APR) 39) APR Rating 40) Sharpe Ratio 41) Sharpe Rating</p> <p><u>More Risk Metrics</u></p> <p>42) Downside Deviation (DSDEV) 43) DSDEV Rating 44) Bear Market Dev (BMDEV) 45) BMDEV Rating 46) Down Market Dev (DMDEV) 47) DMDEV Rating 48) Max Volatility 49) Ulcer Index 50) Ulcer Rating 51) Recovery Time 52) Recovery Time Rating 53) Three Alarm Risk 54) Three Alarm Risk Rating 55) Current Drawdown (CDD)</p> <p><u>More Return Metrics</u></p> <p>56) Sortino Ratio 57) Sortino Rating 58) Martin Ratio 59) Excess Return 60) APR vs Peer 61) Batting Average 62) Batting Average Rating</p> <p><u>Rankings</u></p> <p>63) MFO Rank Position 64) MFO Rank Percent 65) APR Rank Position 66) APR Rank Percent 67) APR vs Peer 68) Batting Average 69) Batting Average Rating</p> <p><u>Display Period</u></p> <p>70) Unique (21) 71) Yearly (24) 72) Monthly (11) 73) Full Cycle (6) 74) Down Cycle (6) 75) Up Cycle (6)</p> <p><u>Pre-Set Screens</u></p> <p>76) Allocation (4) 77) Reference (2) 78) Model (2) 79) Sector (6) 80) Largest (11) 81) Unique (5)</p> <p><u>MFO Designations</u></p> <p>82) Great Owl Funds? 83) Fund Alarm Rating 84) Enhanced Strategy? 85) Profiled Funds? 86) Fund Family (Up To 5) 87) Fund Family Rating (Up To 4) 88) Reamer Ratio 89) Reamer Rating</p> <p><u>Multi-Year Ratings</u> <u>[1, 3, 5, 10, 20 yr, Comp]</u></p> <p>90) MFO Risk 91) APR Rating 92) Sharpe Rating 93) MFO Rating</p> <p><u>Lipper Leaders</u> <u>[1, 3, 5, 10 yr]</u></p> <p>94) Total Return 95) Consistent Return 96) Preservation 97) Expense 98) Tax Efficiency</p> <p><u>Capture Metrics</u> <u>[vs SP500, USBond, US6040, ACIXUS]</u></p> <p>99) Capture Ratio 100) Capture Rating 101) Upside Capture Ratio 102) Upside Capture Rating 103) Downside Capture Ratio 104) Downside Capture Rating</p>	<p><u>Correlation Metrics</u> <u>[vs Peer, B/M, SP500, USBond, ACIXUS]</u></p> <p>105) Correlation R 106) R-squared</p> <p><u>Alpha Beta Metrics</u></p> <p>107) Alpha 108) Alpha Rating 109) Information Ratio 110) Information Rating 111) Beta vs SP500 112) Beta vs Benchmark (B/M) 113) Tracking Error (TEDEV) 114) TEDEV Rating</p> <p><u>Ferguson Metrics</u> <u>[3, 5, 10 yr, Life]</u></p> <p>115) Outperformance Measure (FOM) 116) FOM Rating 117) Consistency Index (FCI) 118) FCI Rating</p> <p><u>Trend Metrics</u> <u>[10, 3 mo]</u></p> <p>119) Trend 120) Trend Rating 121) Simple Moving Avg (SMA) 122) SMA Rating</p> <p><u>Rolling Averages</u> <u>[1, 3, 5, 10, 20 yr]</u></p> <p>123) APR avg Rating 124) APR avg Threshold 125) APR min Threshold 126) Rolling Batting Average 127) Rolling Batting Average Rating</p> <p><u>Management Info</u></p> <p>128) Manager Names (Up To 5)* 129) Adviser Names (Up To 5)* 130) Manager Tenure 131) Mgmt Company City 132) Mgmt Company State</p> <p><u>Purchase Info</u></p> <p>133) Expense Ratio (ER) 134) ER Rating 135) Open or Closed? 136) 12b-1 Fee? 137) Net Management Fee 138) Min Initial Purchase 139) Front Load? 140) Redemption Fee? 141) Net Acquired Fee</p> <p><u>AUM Info</u></p> <p>142) Assets Under Mgmt (AUM) Min 143) AUM Max 144) AUM Rank (In Category) 145) AUM Rank (All Rated Funds)</p> <p><u>Portfolio Info</u></p> <p>146) Yield 147) Yield Rating 148) Dividend Frequency 149) Managed Volatility? 150) Cash Allocation 151) Bond Allocation 152) Equity Allocation 153) Number of Holdings 154) Concentration (Top 10 Holdings) 155) Dividend Payout 156) Div Payout Rating 157) Market Cap (Min) 158) Market Cap (Max) 159) Turnover 160) Effective Maturity 161) Bond Quality</p> <p><u>More Portfolio Info</u></p> <p>162) Price/Earnings (P/E) 163) P/E Rating 164) Price/Sales (P/S) 165) P/S Rating 166) Debt/Equity (D/E) 167) D/E Rating 168) Return on Assets (ROA) 169) ROA Rating 170) Return on Equity (ROE) 171) ROE Rating 172) Operating Cash Growth 173) Op Cash Growth Rating 174) Sales Growth 175) Sales Growth Rating 176) Price/Book (P/B) 177) P/B Rating 178) Price/Cash (P/C) 179) P/C Rating 180) Return on Capital (ROC) 181) ROC Rating 182) Return on Income (ROI) 183) ROI Rating 184) Earnings per Share (EPS) Growth 185) EPS Growth Rating 186) Sales/Share (SPS) Growth 187) SPS Growth Rating 188) Dividend Growth 189) Div Growth Rating</p> <p><u>Ten Top Holdings</u></p> <p>190) Name (Up To 5) 191) Country (Up To 5) 192) Currency (Up To 5) 193) Ticker or CUSIP (Up To 5) 194) Sector (Up To 5) 195) Debt (Up To 5)</p> <p><u>Sector Allocation</u></p> <p>196) Basic Materials 197) Industrials 198) Consumer Goods 199) Oil & Gas 200) Consumer Services 201) Technology 202) Financials 203) Telecommunications 204) Health Care 205) Utilities</p> <p><u>Watchlists</u></p> <p>206) 25 Available, Stored In User Profile (Up to 100 Tickers Each)</p> <p><u>Searches</u></p> <p>207) 25 Available, Stored In User Profile</p> <p><u>Preferences</u></p> <p>208) 10 Available, Stored In User Profile</p>
--	--

* Plus Option: Can Include In Search Independent of Other Criteria

As of 25 July 2021