

MFO Premium

MultiSearch Screening Parameters



<p style="text-align: center;"><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 style="text-align: center;"><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) Include Averages? 14) Socially Conscious?*\n 15) ESC Score 16) Fund of Funds? 17) Management Approach 18) Interval Fund? 19) Benchmark (Up To 5)</p> <p style="text-align: center;"><u>Categories</u></p> <p>20) U. S. Equity (Up To 9) 21) International Equity (Up To 9) 22) Global Equity (Up To 9) 23) Sector Equity (Up To 9) 24) Commodity (Up To 4) 25) International Equity (Up To 9) 26) Trading (Up To 2) 27) Exclude Equity (Up To 25) 28) Exclude Mixed Asset, Alternative and Commodity (Up To 15) 29) Bond (Up To 9) 30) Mixed Asset (Up To 9) 31) Alternative (Up To 7) 32) Municipal Bond (Up To 9) 33) Money Market (Up To 7) 34) Index (Up To 7) 35) Trading (Up To 2) 36) Exclude Bond (Up To 25) 37) Exclude Money Market (Up To 6)</p> <p style="text-align: center;"><u>Risk & Return Metrics</u></p> <p>38) MFO Risk (Up To 4) 39) Max Drawdown (MAXDD) 40) MAXDD Rating 41) Standard Deviation (STDEV) 42) STDEV Rating 43) MFO Rating 44) Annual Percent Return (APR) 45) APR Rating 46) Sharpe Ratio 47) Sharpe Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>More Risk Metrics</u></p> <p>48) Downside Deviation (DSDEV) 49) DSDEV Rating 50) Bear Market Dev (BMDEV) 51) BMDEV Rating 52) Down Market Dev (DMDEV) 53) DMDEV Rating 54) Max Volatility 55) Ulcer Index 56) Ulcer Rating 57) Recovery Time 58) Recovery Time Rating 59) Three Alarm Risk 60) Three Alarm Risk Rating 61) Current Drawdown (CDD)</p> <p style="text-align: center;"><u>More Return Metrics</u></p> <p>62) Sortino Ratio 63) Sortino Rating 64) Martin Ratio 65) Excess Return 66) APR vs Peer 67) Batting Average 68) Batting Average Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Rankings</u></p> <p>69) MFO Rank Position 70) MFO Rank Percent 71) APR Rank Position 72) APR Rank Percent</p> <p style="text-align: center;"><u>Display Period</u></p> <p>73) Unique (23) 74) Yearly (27) 75) Monthly (11) 76) Decadal (10) 77) Full Cycle (9) 78) Bear Market (9) 79) Bull Market (9) 80) Calendar Decade (11)</p> <p style="text-align: center;"><u>Pre-Set Screens</u></p> <p>81) Allocation (4) 82) Reference (2) 83) Model (2) 84) Sector (6) 85) Largest (11) 86) Unique (5)</p> <p style="text-align: center;"><u>MFO Designations</u></p> <p>87) Great Owl Funds? 88) Fund Alarm Rating 89) Enhanced Strategy? 90) Profiled Funds? 91) Fund Family (Up To 10) 92) Fund SubFamily (Up To 5) 93) Fund Family Rating (Up To 4) 94) Reamer Ratio 95) Reamer Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Multi-Year Ratings</u> <u>[1, 3, 5, 10, 20 yr, Comp]</u></p> <p>96) MFO Risk 97) APR Rating 98) Sharpe Rating 99) MFO Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Lipper Leaders</u> <u>[1, 3, 5, 10 yr]</u></p> <p>100) Total Return 101) Consistent Return 102) Preservation 103) Expense 104) Tax Efficiency</p> <p style="text-align: center;"><u>Capture Metrics</u> <u>[vs SP500, USBond, US6040, ACIXUS]</u></p> <p>105) Capture Ratio 106) Capture Rating 107) Upside Capture Ratio 108) Upside Capture Rating 109) Downside Capture Ratio 110) Downside Capture Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Correlation Metrics</u> <u>[vs Peer, B/M, SP500, USBond, ACIXUS]</u></p> <p>111) Correlation R 112) R-squared</p> <p style="text-align: center;"><u>Alpha Beta Metrics</u></p> <p>113) Alpha 114) Alpha Rating 115) Information Ratio 116) Information Rating 117) Beta vs SP500 118) Beta vs Benchmark (B/M) 119) Tracking Error (TEDEV) 120) TEDEV Rating</p>	<p style="text-align: center;"><u>Ferguson Metrics</u> <u>[3, 5, 10 yr, Life]</u></p> <p>121) Outperformance Measure (FOM) 122) FOM Rating 123) Consistency Index (FCI) 124) FCI Rating 125) Mega Ratio (FMR) 126) FMR Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Trend Metrics</u> <u>[3, 10 mo]</u></p> <p>127) Simple Moving Avg (SMA) 128) SMA Rating 129) Exponential Moving Avg (EMA) 130) EMA Rating 131) Trend vs SMA 132) Trend vs SMA Rating 133) Trend vs EMA 134) Trend vs EMA Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Momentum</u> <u>[3, 10, 6, 12 mo]</u></p> <p>135) MoM 136) MoM Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Rolling Averages</u> <u>[1, 3, 5, 10, 20 yr]</u></p> <p>137) APR avg Rating 138) APR avg Threshold 139) APR min Threshold 140) Rolling Batting Average 141) Rolling Batting Average Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Management Info</u></p> <p>142) Manager Names (Up To 5)* 143) Manager Tenure 144) Management City 145) Adviser Names (Up To 5)* 146) SubAdviser (Up To 5) 147) Management State</p> <p style="text-align: center;"><u>Purchase Info</u></p> <p>148) Expense Ratio (ER) 149) ER Rating 150) Open or Closed? 151) 12b-1 Fee? 152) Net Management Fee 153) Min Initial Purchase 154) Front Load? 155) Redemption Fee? 156) Net Acquired Fee</p> <p style="text-align: center;"><u>Taxes</u> <u>[1, 3, 5, 10 yr]</u></p> <p>157) Tax Cost Ratio (TCR) Pre-Liquidation 158) TCR Pre Rating 159) Tax Cost Ratio (TCR) Post-Liquidation 160) TCR Post Rating 161) Return After Tax (RAT) Pre-Liquidation 162) RAT Pre Rating 163) Return After Tax (RAT) Post-Liquidation 164) RAT Post Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>AUM Info</u></p> <p>165) Assets Under Mgmt (AUM) Min 166) AUM Max 167) AUM Rank (In Category) 168) AUM Rank (All Rated Funds)</p> <p style="text-align: center;"><u>Portfolio Info</u></p> <p>169) Yield 170) Yield Rating 171) Dividend Frequency 172) Managed Volatility? 173) Cash Allocation 174) Bond Allocation 175) Equity Allocation 176) Number of Holdings 177) Concentration (Top 10 Holdings) 178) Dividend Payout 179) Div Payout Rating 180) Market Cap (Min) 181) Market Cap (Max) 182) Turnover</p> <p style="text-align: center;"><u>Equity Info</u></p> <p>183) Price/Earnings (P/E) 184) P/E Rating 185) Price/Sales (P/S) 186) P/S Rating 187) Debt/Equity (D/E) 188) D/E Rating 189) Return on Assets (ROA) 190) ROA Rating 191) Return on Equity (ROE) 192) ROE Rating 193) Operating Cash Growth 194) Op Cash Growth Rating 195) Sales Growth 196) Sales Growth Rating 197) Price/Book (P/B) 198) P/B Rating 199) Price/Cash (P/C) 200) P/C Rating 201) Return on Capital (ROC) 202) ROC Rating 203) Return on Investment (ROI) 204) ROI Rating 205) Earnings per Share (EPS) Growth 206) EPS Growth Rating 207) Sales/Share (SPS) Growth 208) SPS Growth Rating 209) Dividend Growth 210) Div Growth Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Bond Info</u></p> <p>211) Bond Quality 212) Junk 213) Junk Plus Non-Rated 214) Duration 215) Duration Rating 216) Nominal Maturity 217) Nominal Maturity Rating 218) Effective Maturity 219) Effective Maturity Rating 220) Yield To Maturity 221) Yield To Maturity Rating 222) Average Coupon 223) Average Coupon Rating</p> <p style="text-align: center;"><u>Ten Top Holdings</u></p> <p>224) Name (Up To 5) 225) Country (Up To 5) 226) Currency (Up To 5) 227) Ticker or CUSIP (Up To 5) 228) Sector (Up To 5) 229) Debt (Up To 9)</p> <p style="text-align: center;"><u>Sector Allocation</u></p> <p>230) Basic Materials 231) Industrials 232) Consumer Goods 233) Oil & Gas 234) Consumer Services 235) Technology 236) Financials 237) Telecommunications 238) Health Care 239) Utilities</p> <p style="text-align: center;"><u>Watchlists</u></p> <p>240) 25 Available, Stored In User Profile (Up to 100 Tickers Each)</p> <p style="text-align: center;"><u>Searches</u></p> <p>241) 25 Available, Stored In User Profile</p> <p style="text-align: center;"><u>Preferences</u></p> <p>242) 10 Available, Stored In User Profile</p>
---	---

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

As of 1 January 2022