

Report Simulazione Portafoglio Finanziario

Periodo analizzato: 2010-01-01 - 2025-07-01

Asset analizzati: AAPL, GOOG, MSFT

Composizione Portafoglio Ottimale:

AAPL: 51.12%

GOOG: 0.00%

MSFT: 48.88%

Risultati attesi:

Rendimento annuo atteso: 23.56%

Volatilità annua attesa: 24.14%

Sharpe ratio atteso: 0.98

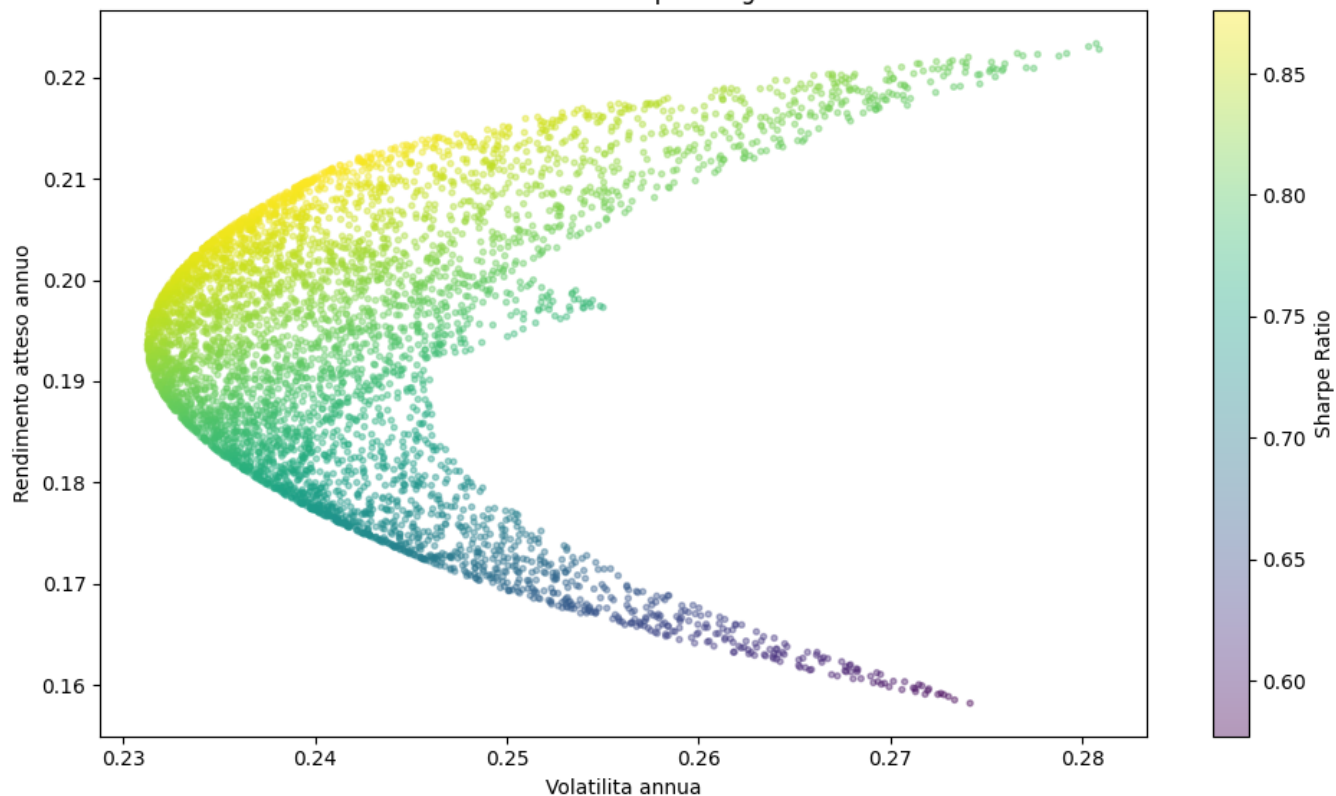
Cosa è lo Sharpe Ratio? È un indice che misura quanto rendimento ottieni rispetto al rischio: più è alto, meglio stai usando il rischio per ottenere ritorni.

Interpretazione dei Risultati:

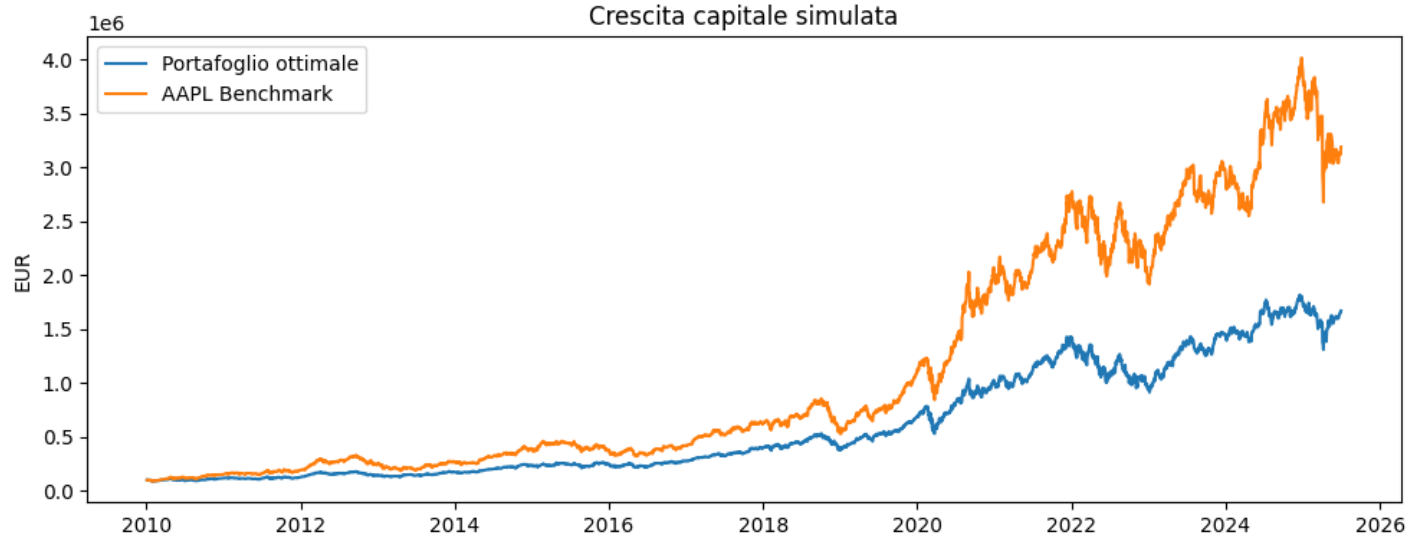
- Un portafoglio bilanciato aiuta a ridurre il rischio rispetto all'investimento in un solo asset.
- Un alto Sharpe Ratio indica una combinazione molto efficiente rischio/rendimento.
- Il grafico Monte Carlo mostra la posizione del portafoglio ottimale rispetto a migliaia di combinazioni casuali.
- Il grafico crescita capitale mostra quanto sarebbe cresciuto il capitale investendo nel portafoglio ottimale rispetto a un singolo asset benchmark.

Grafici:

Simulazione Monte Carlo portafogli randomici



Crescita capitale simulata



Capitale finale simulato: 1670502.11 EUR