



Progetto Business Intelligence per i Servizi Finanziari

Riccardo Savio 885955

Scelta degli stocks

NVDA



Leader mondiale nelle tecnologie di elaborazione grafica e intelligenza artificiale, NVIDIA sviluppa GPU avanzate per gaming, data center, e applicazioni di AI.

QCOM



Innovatore nel settore delle telecomunicazioni e semiconduttori, QUALCOMM è noto per i suoi chip e tecnologie per reti mobili, tra cui il 5G.

UNH



Azienda sanitaria globale, UnitedHealth Group offre una vasta gamma di servizi e prodotti per la gestione della salute e assicurazioni mediche.

Scelta degli stocks

LLY



Multinazionale farmaceutica, Eli Lilly sviluppa e commercializza farmaci innovativi per trattare malattie come il diabete, il cancro e disturbi neurologici.

NEE



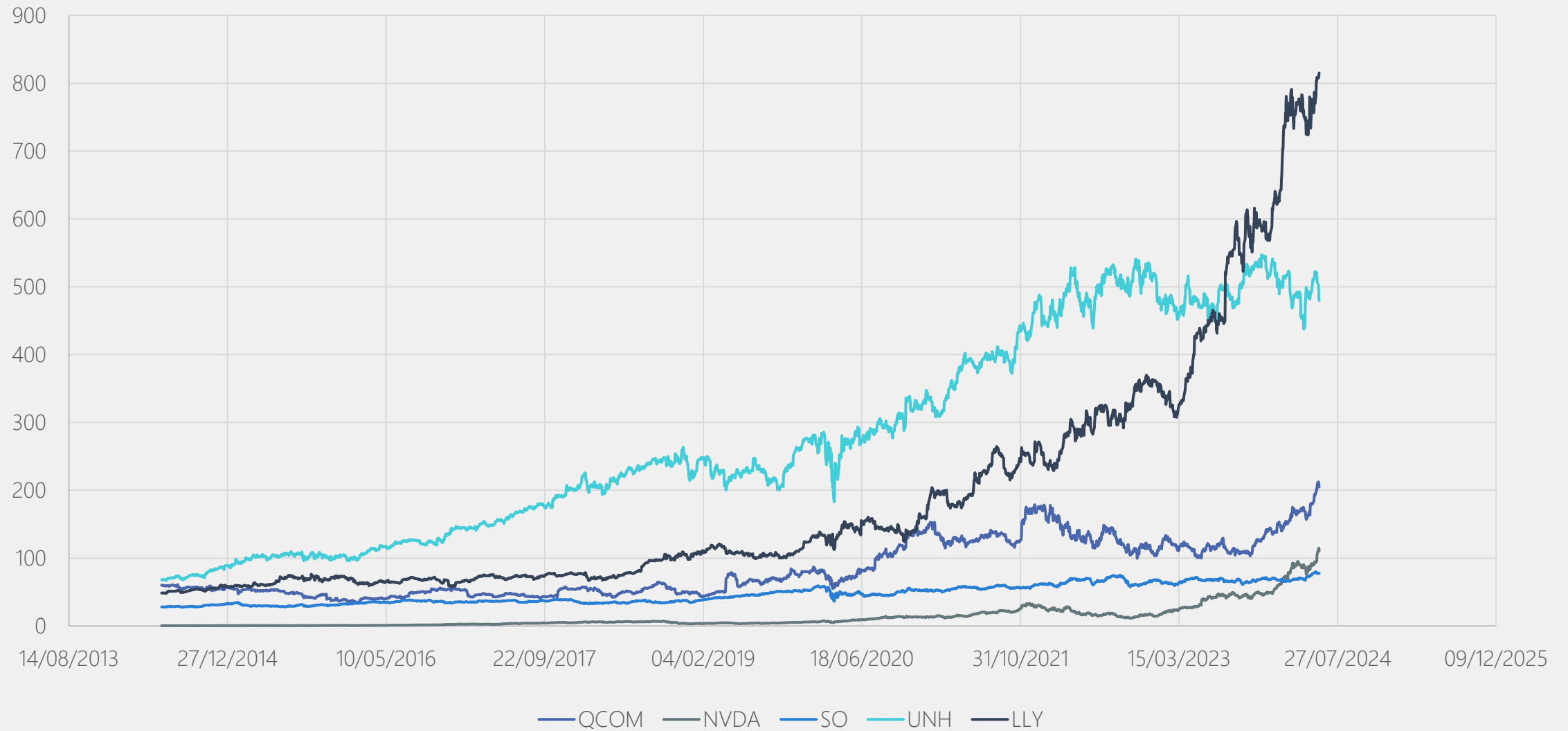
Leader nelle energie rinnovabili, NextEra Energy è uno dei maggiori produttori mondiali di energia solare ed eolica, con un forte impegno verso la sostenibilità.

SO

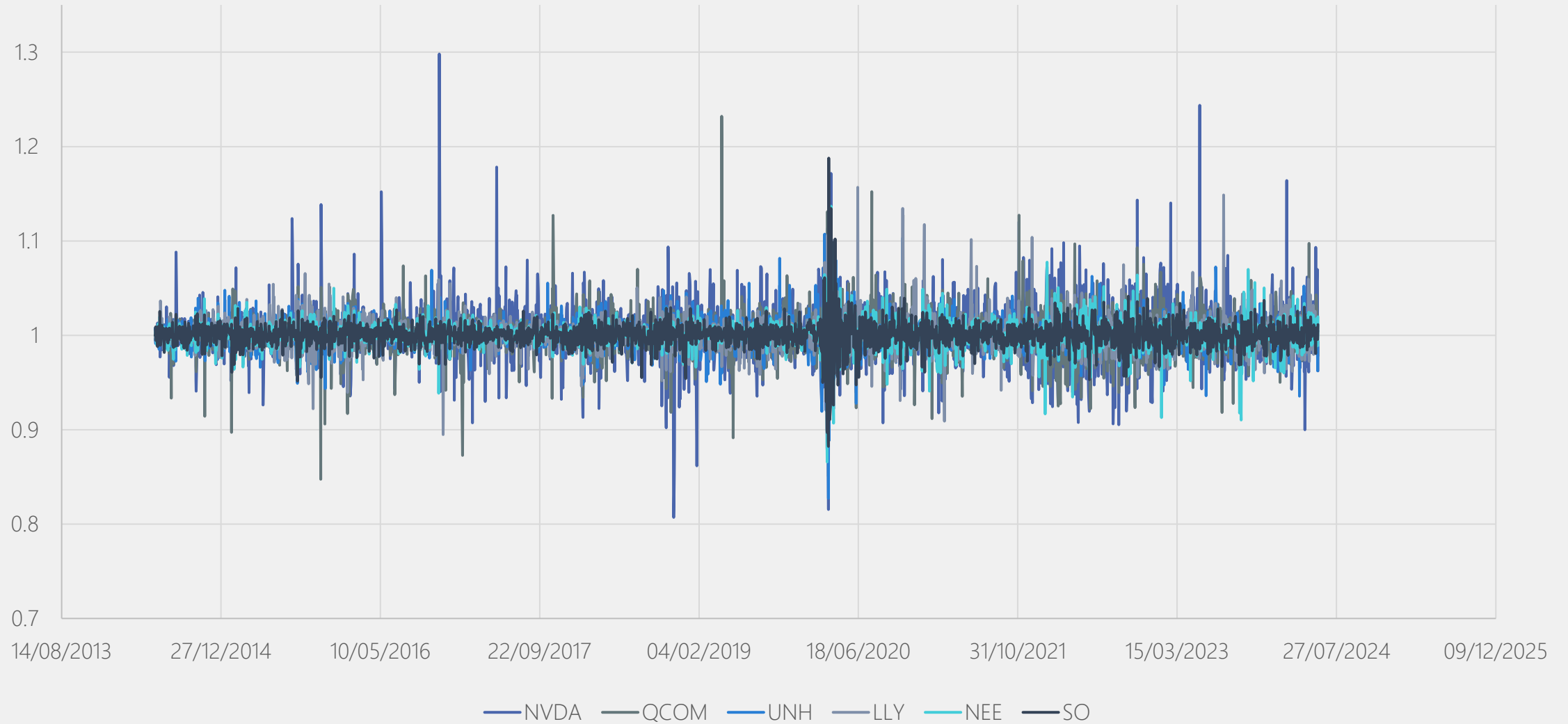


Fornitore di energia elettrica negli Stati Uniti, Southern Co gestisce centrali elettriche e reti di distribuzione, con un focus crescente sulle energie rinnovabili e la riduzione delle emissioni di carbonio.

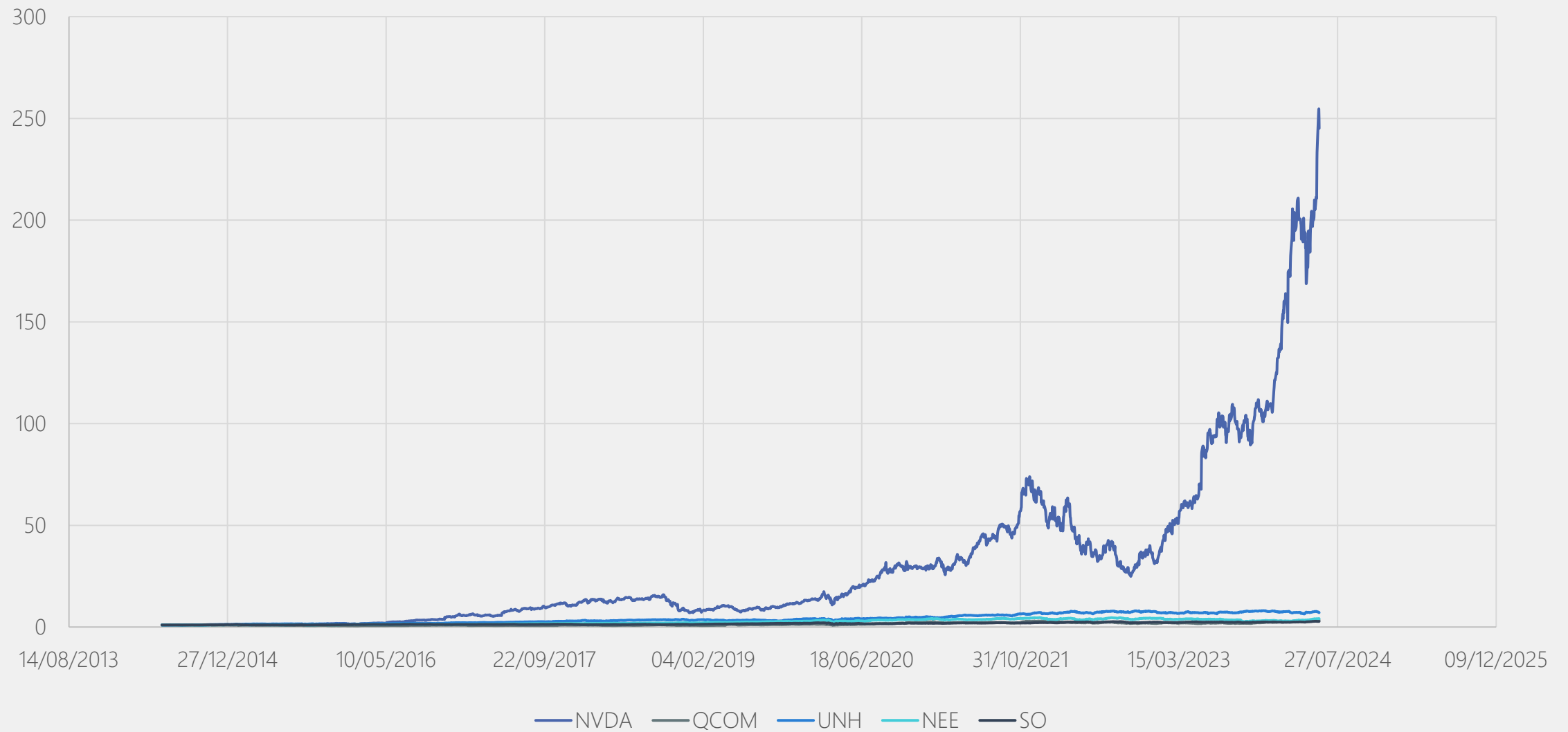
Prezzo degli stocks



Rendimenti lordi giornalieri



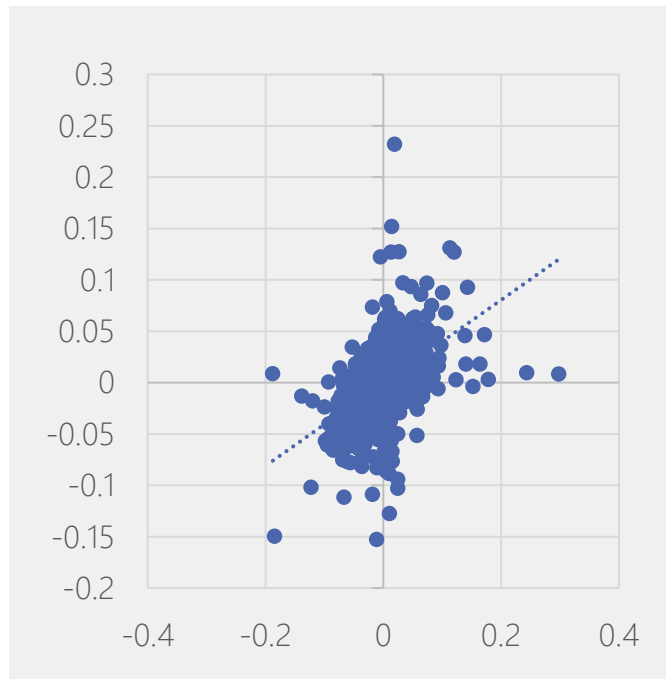
Rendimento cumulato



SETTORI

26,1%

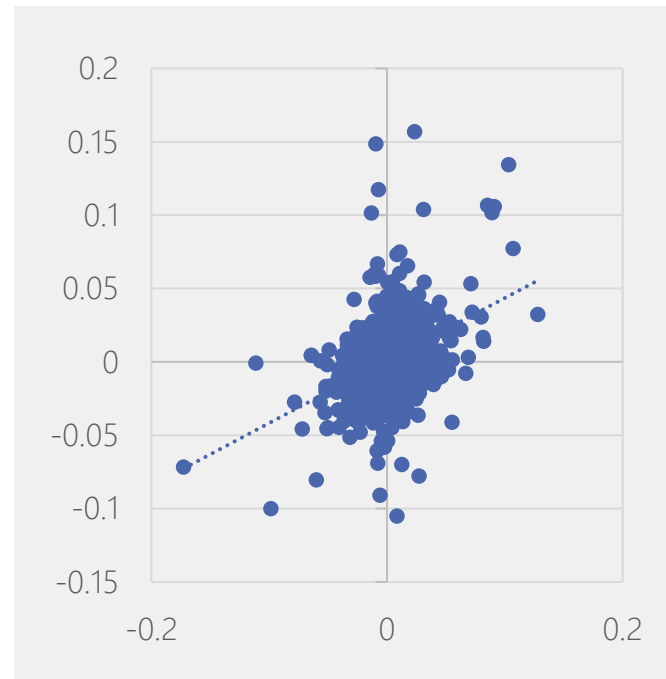
INFOTECH



Correlazione dei titoli NVDA e QCOM:
0.402777

14,5%

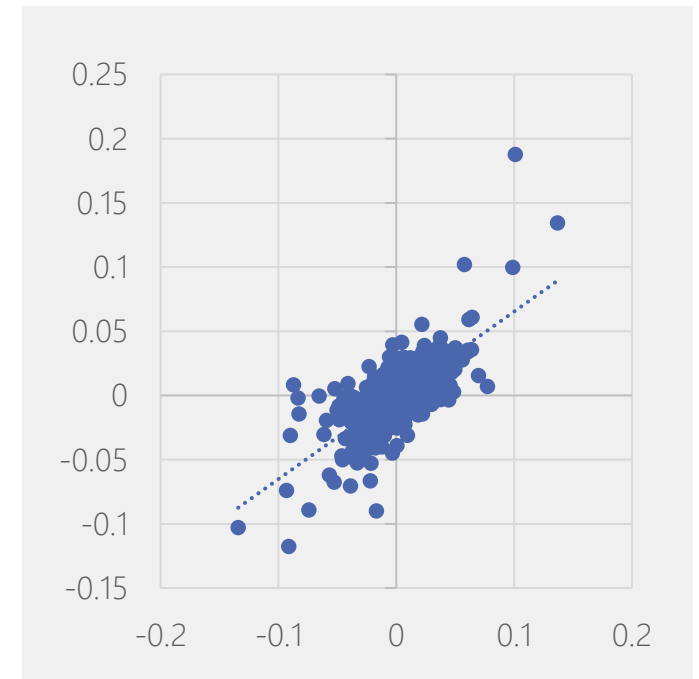
HEALTHCARE



Correlazione dei titoli UNH e LLY:
0.533477

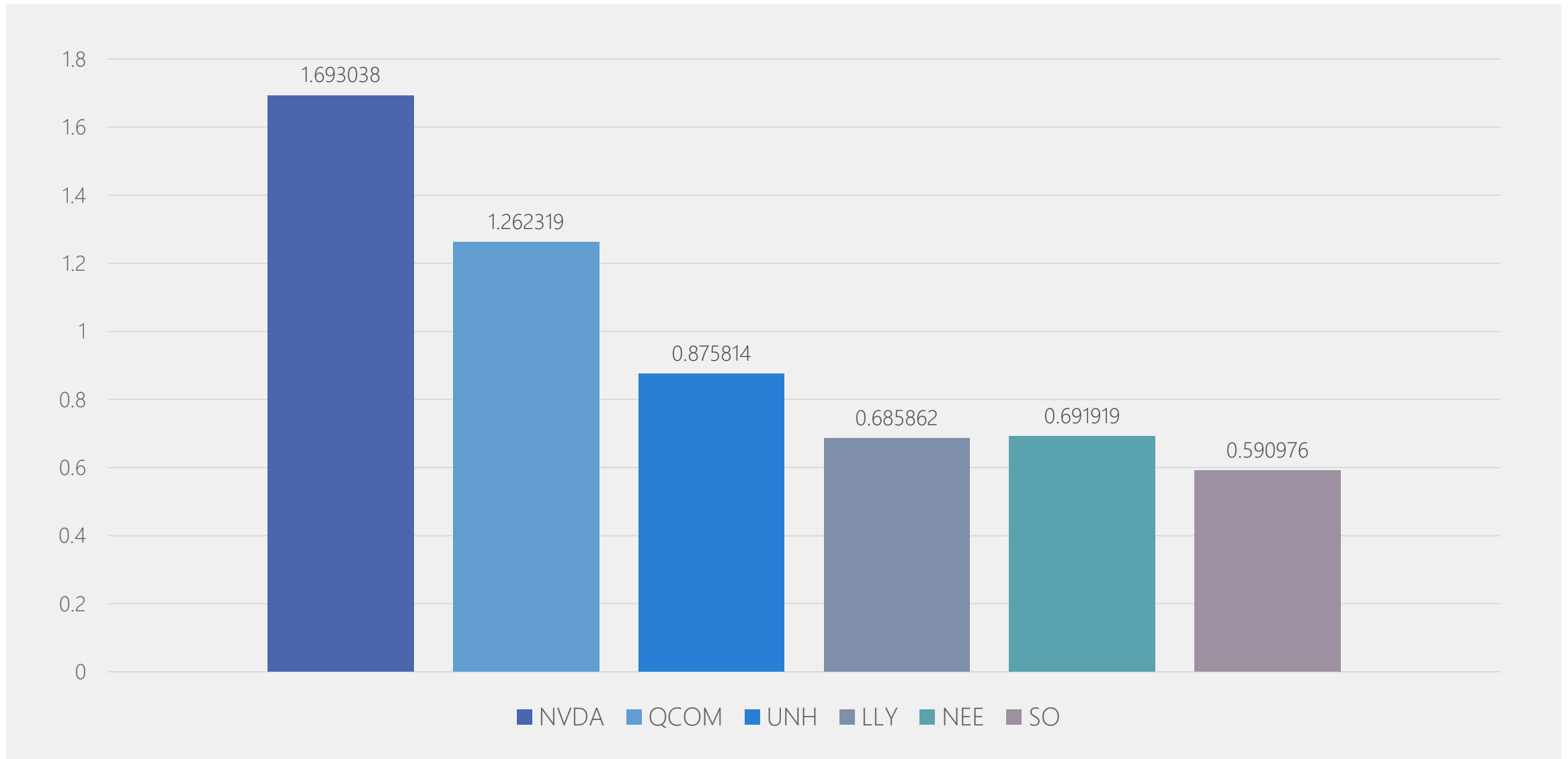
2,9%

UTILITIES

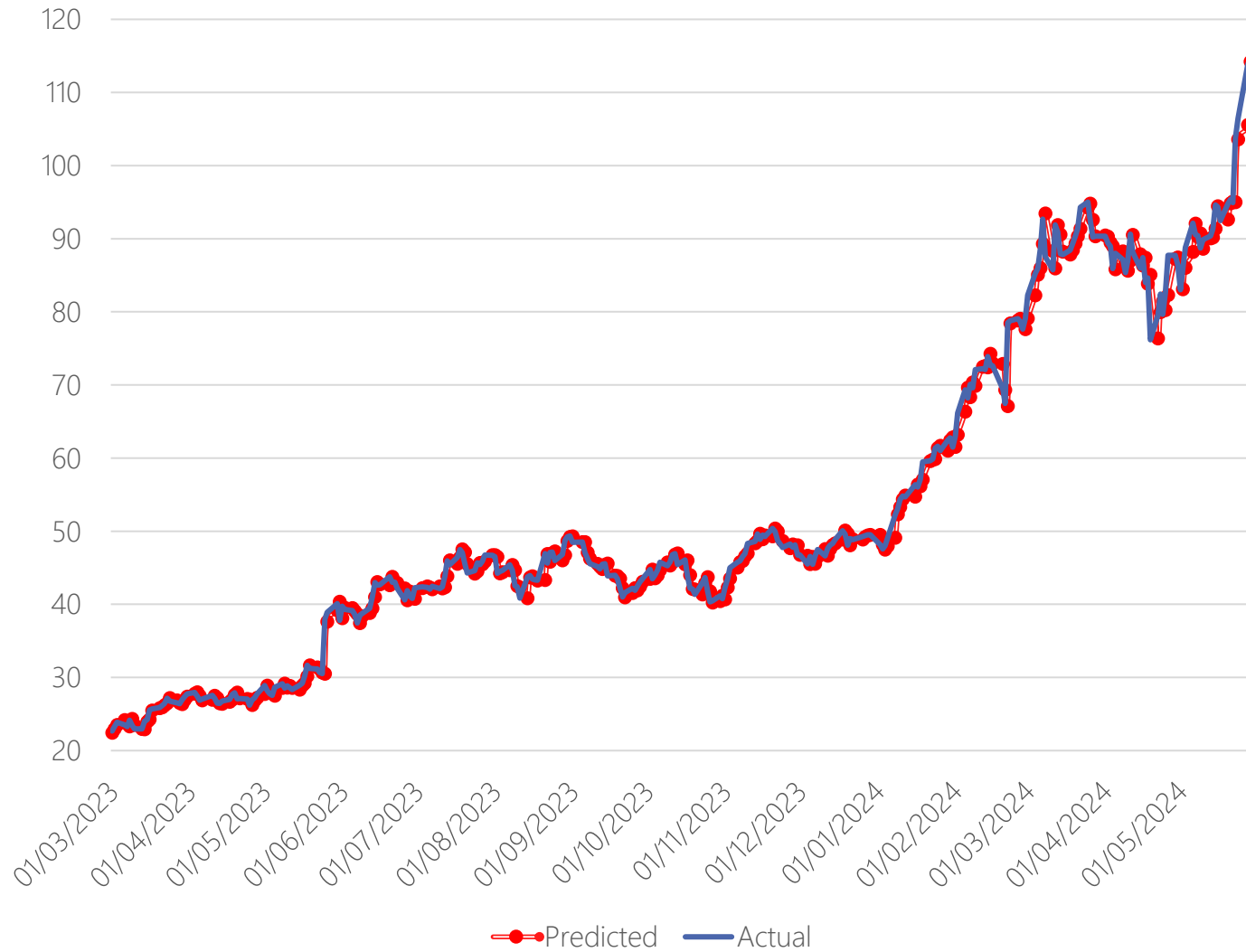


Correlazione dei titoli NEE e SO:
0.716652

Beta dei titoli



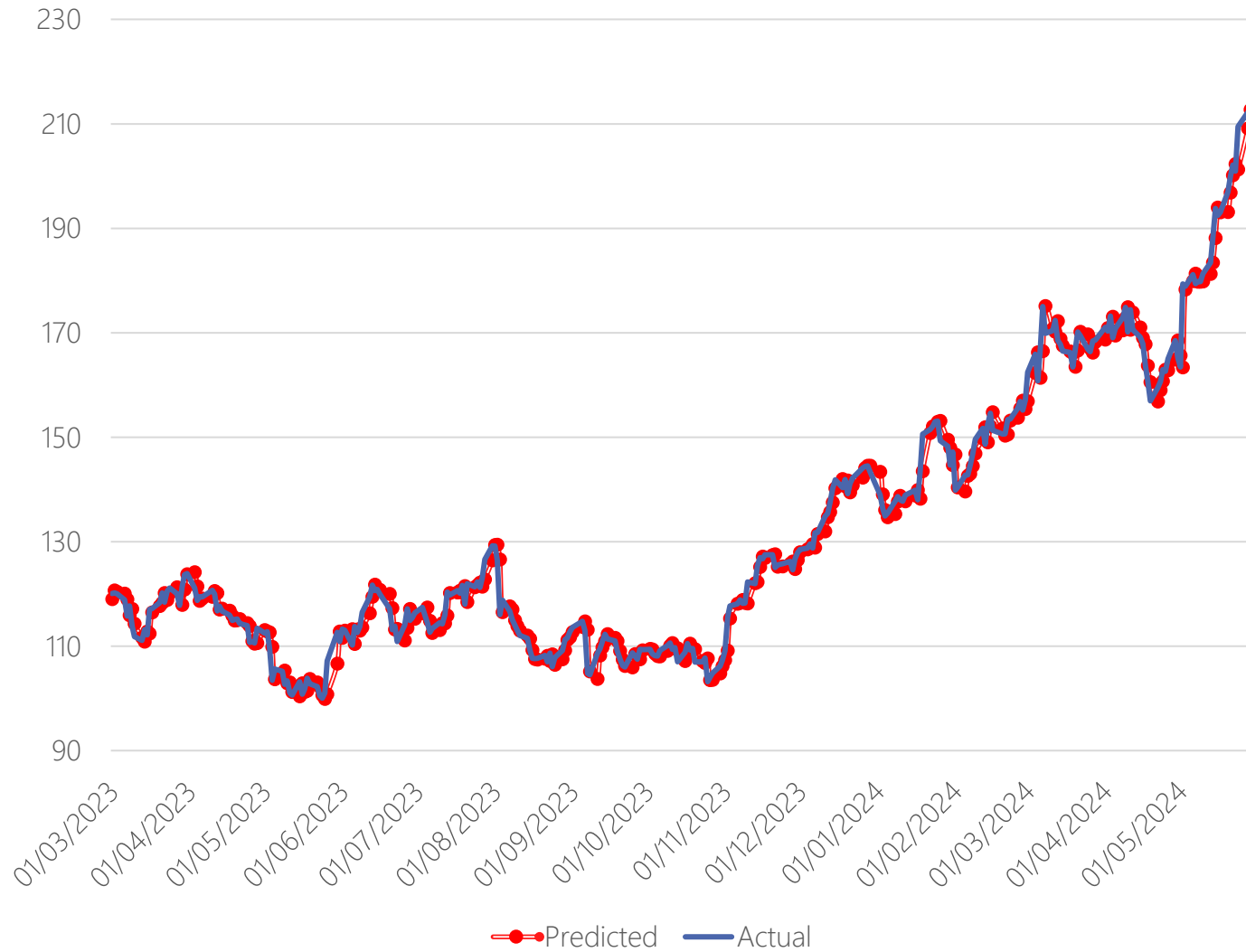
Predizione ARIMA NVDA



Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 1.8100
- MAE: 1.1520

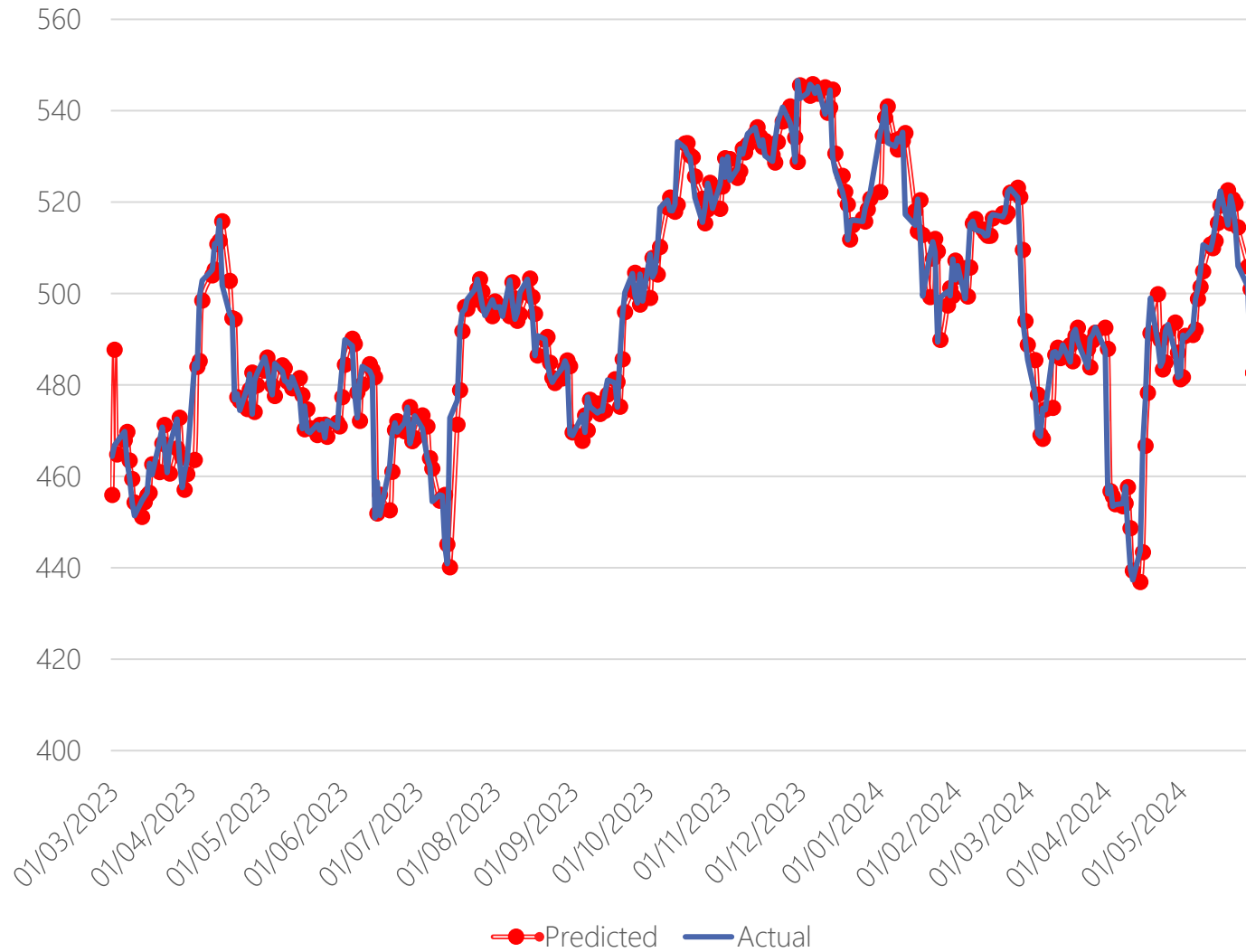
Predizione ARIMA QCOM



Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 2.6643
- MAE: 1.9286

Predizione ARIMA UNH



Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 6.7852
- MAE: 4.7885

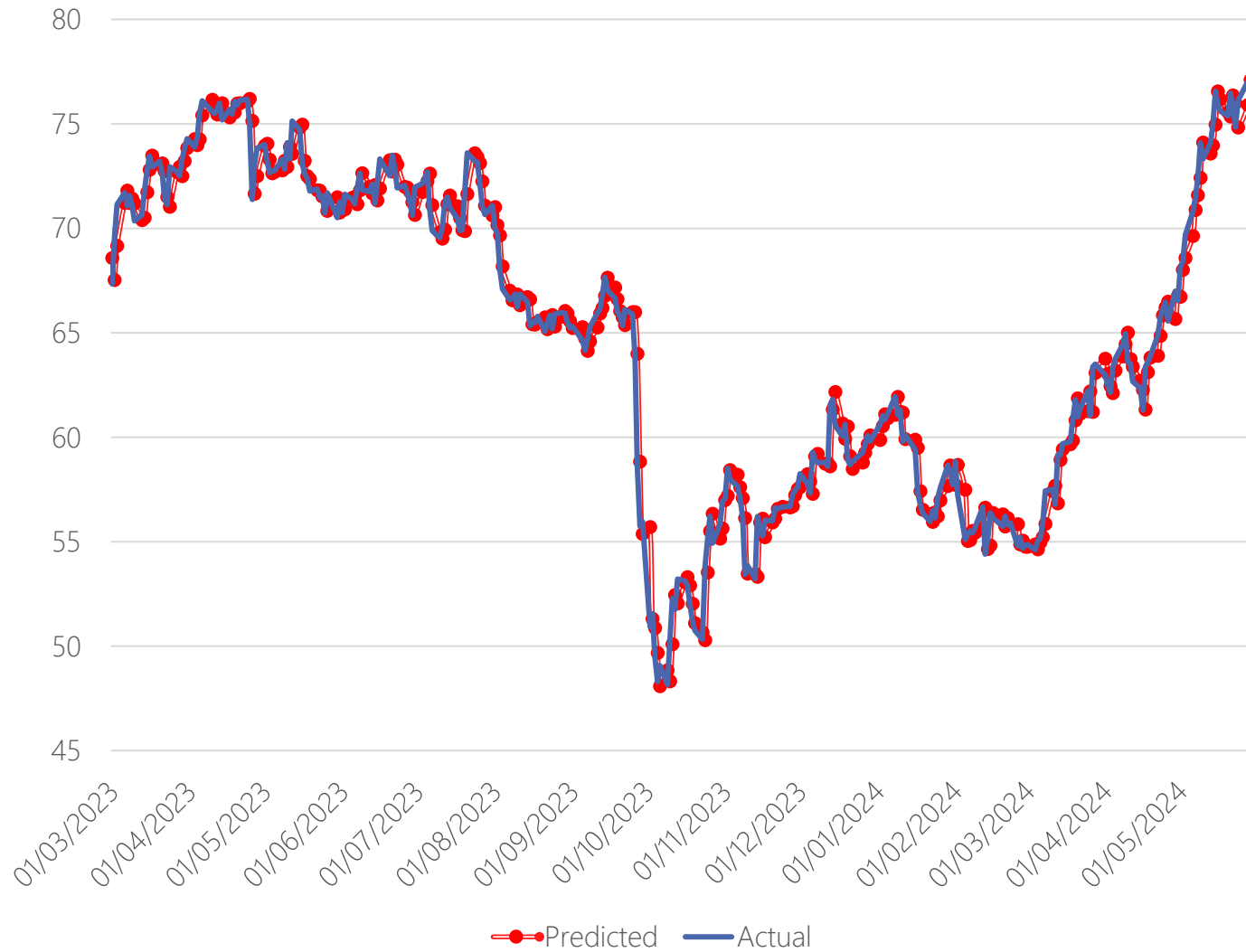
Predizione ARIMA LLY



Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 10.5573
- MAE: 6.9998

Predizione ARIMA NEE



Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 1.0422
- MAE: 0.7629

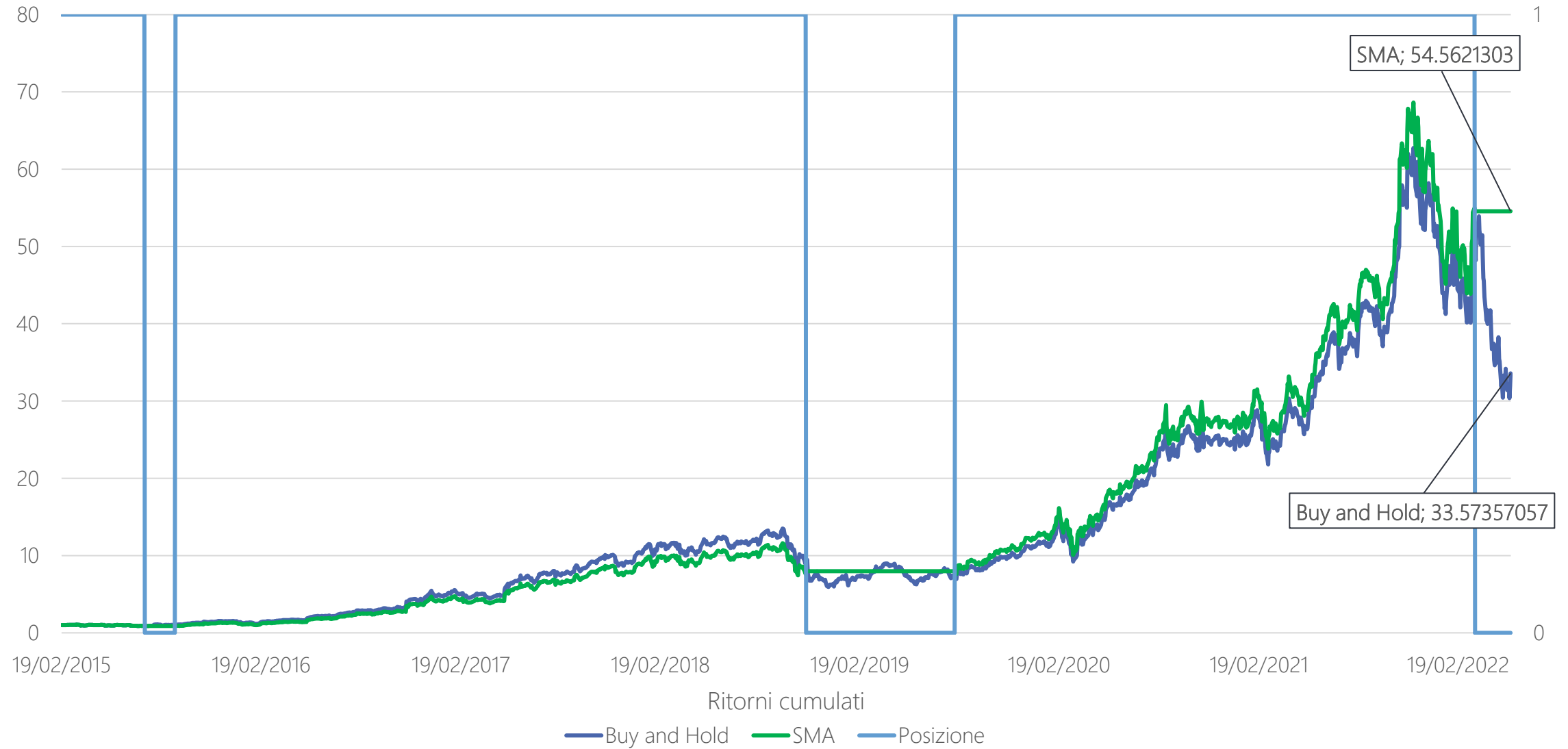
Predizione ARIMA NEE



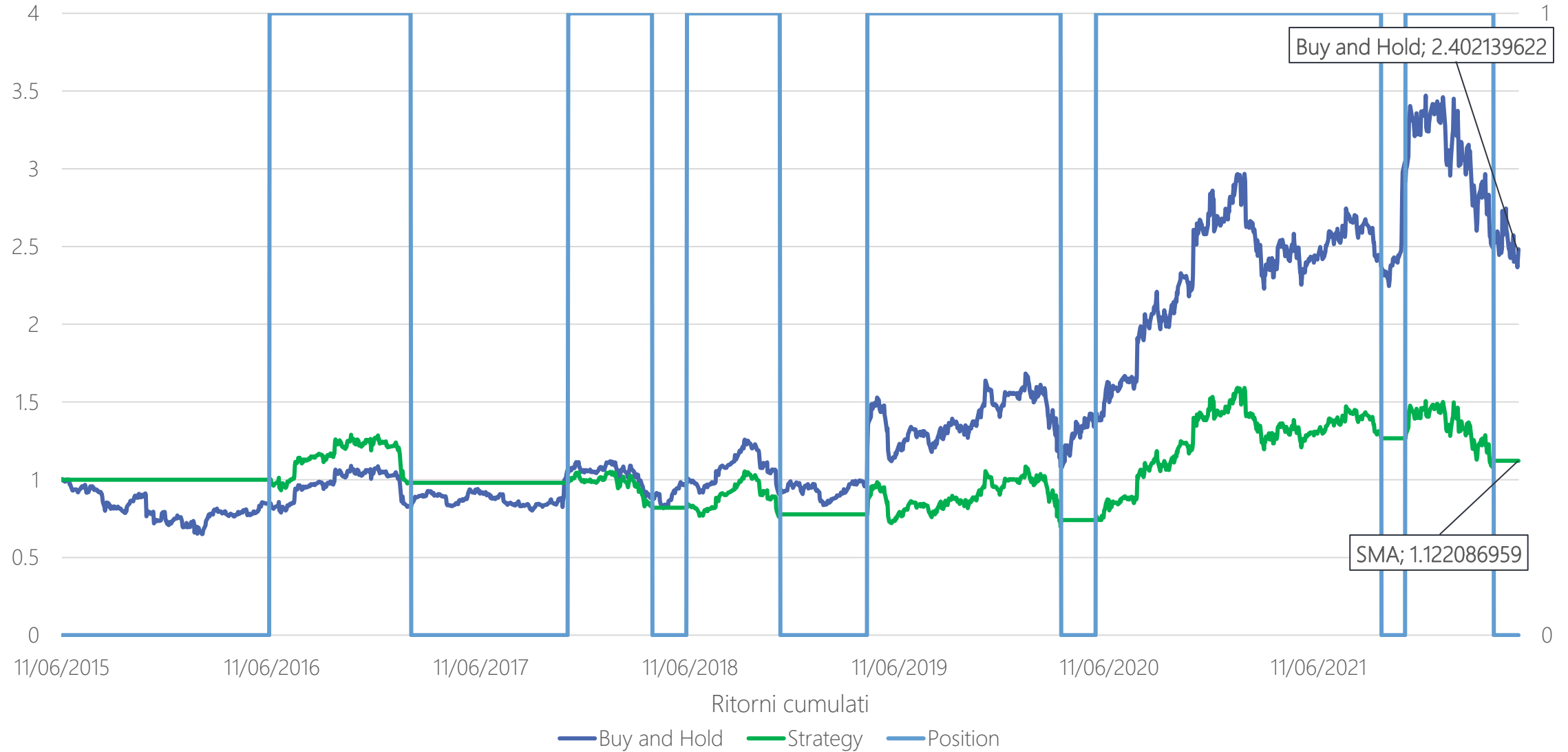
Prestazioni modello
ARIMA

- RMSE: 0.7687
- MAE: 0.6007

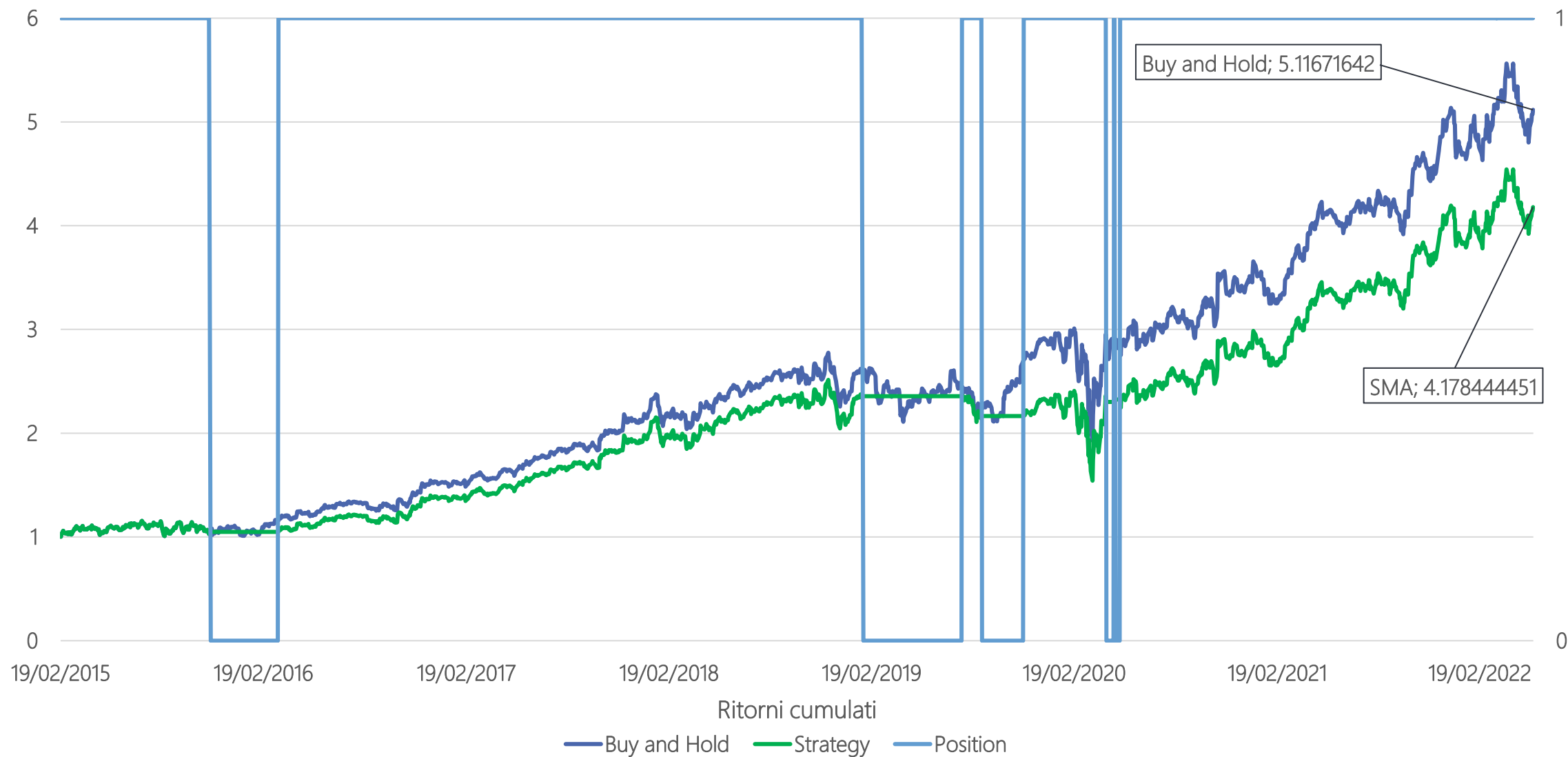
Strategia SMA applicata a NVDA



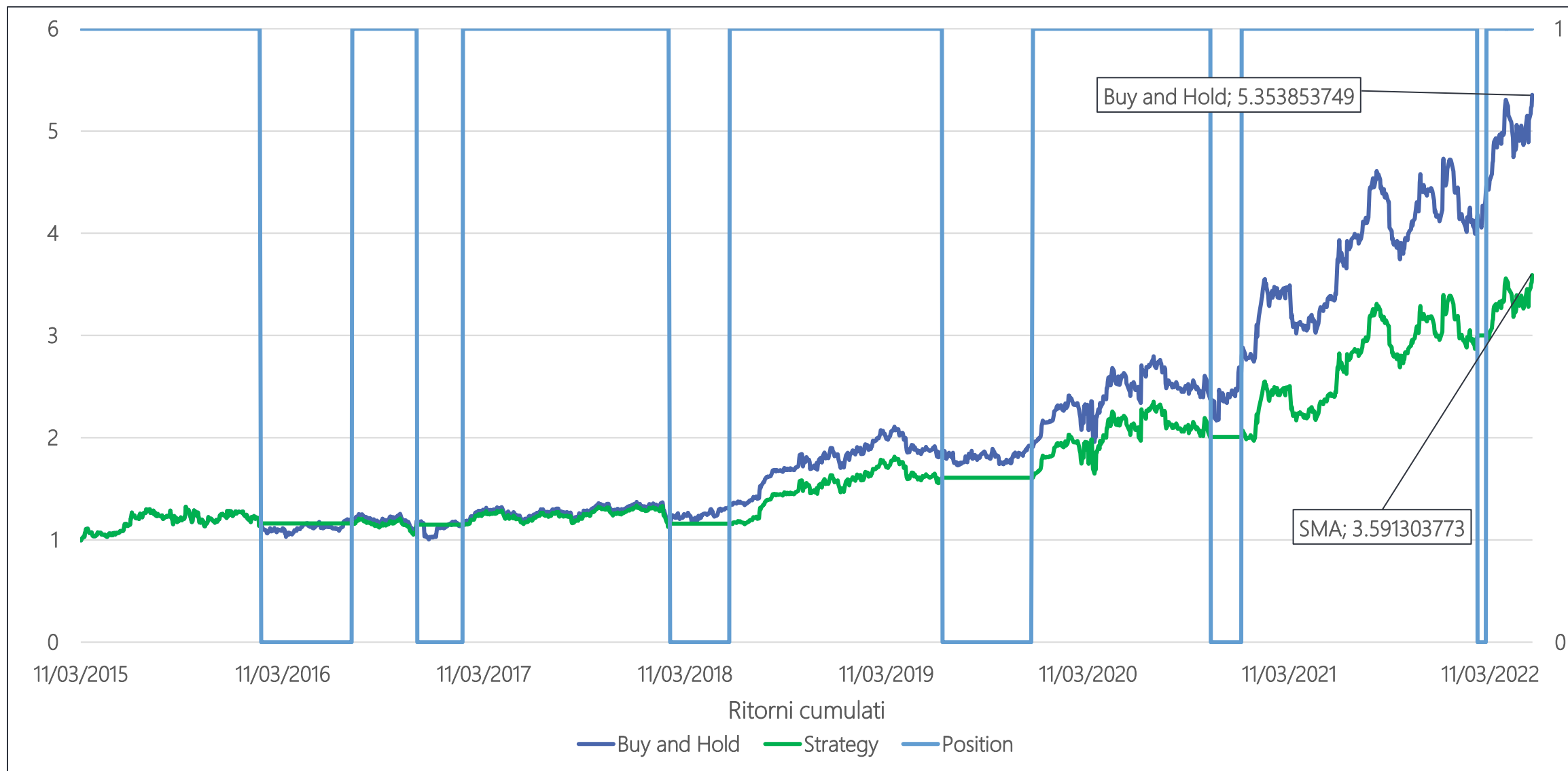
Strategia SMA applicata a QCOM



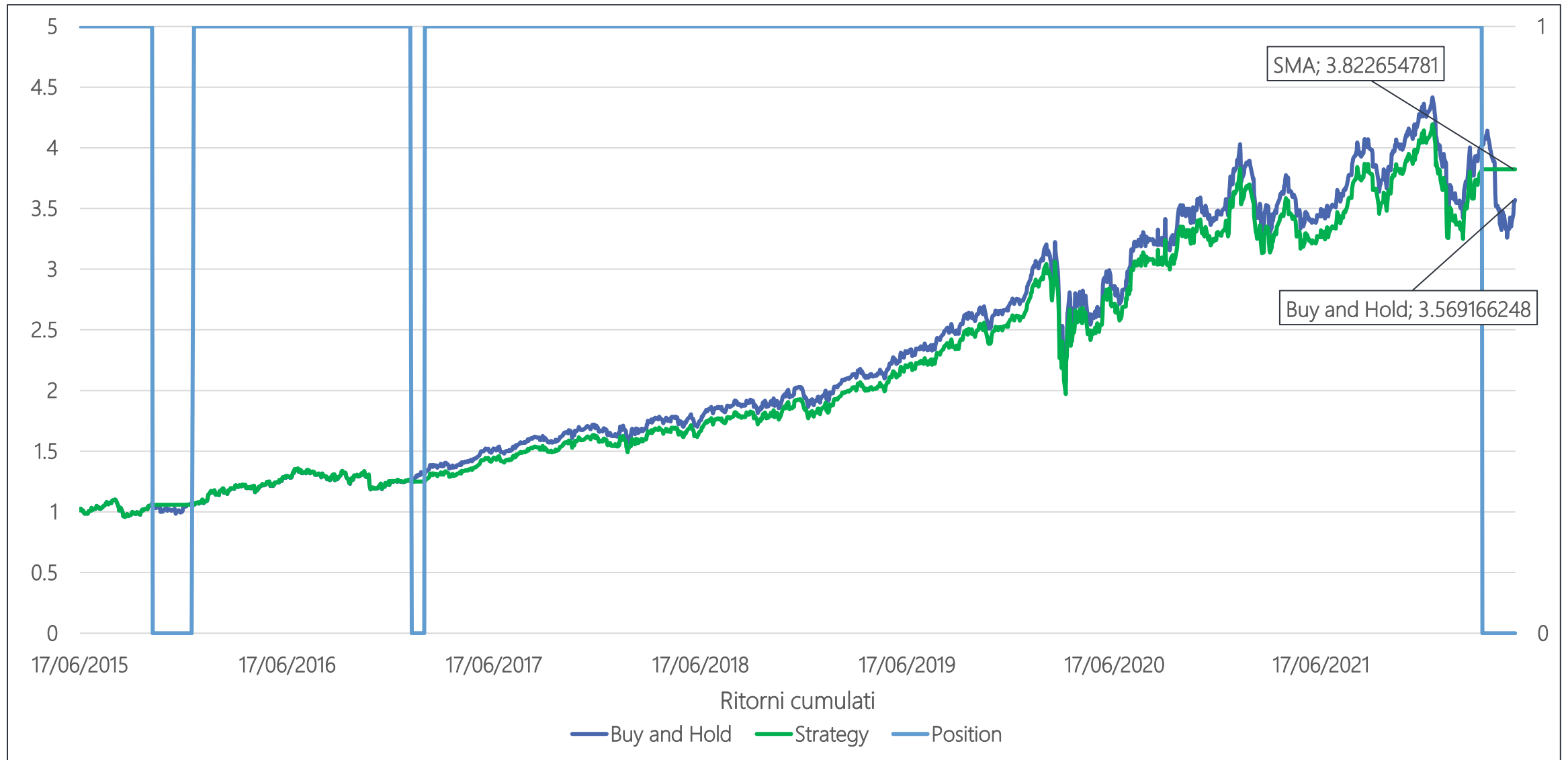
Strategia SMA applicata a UNH



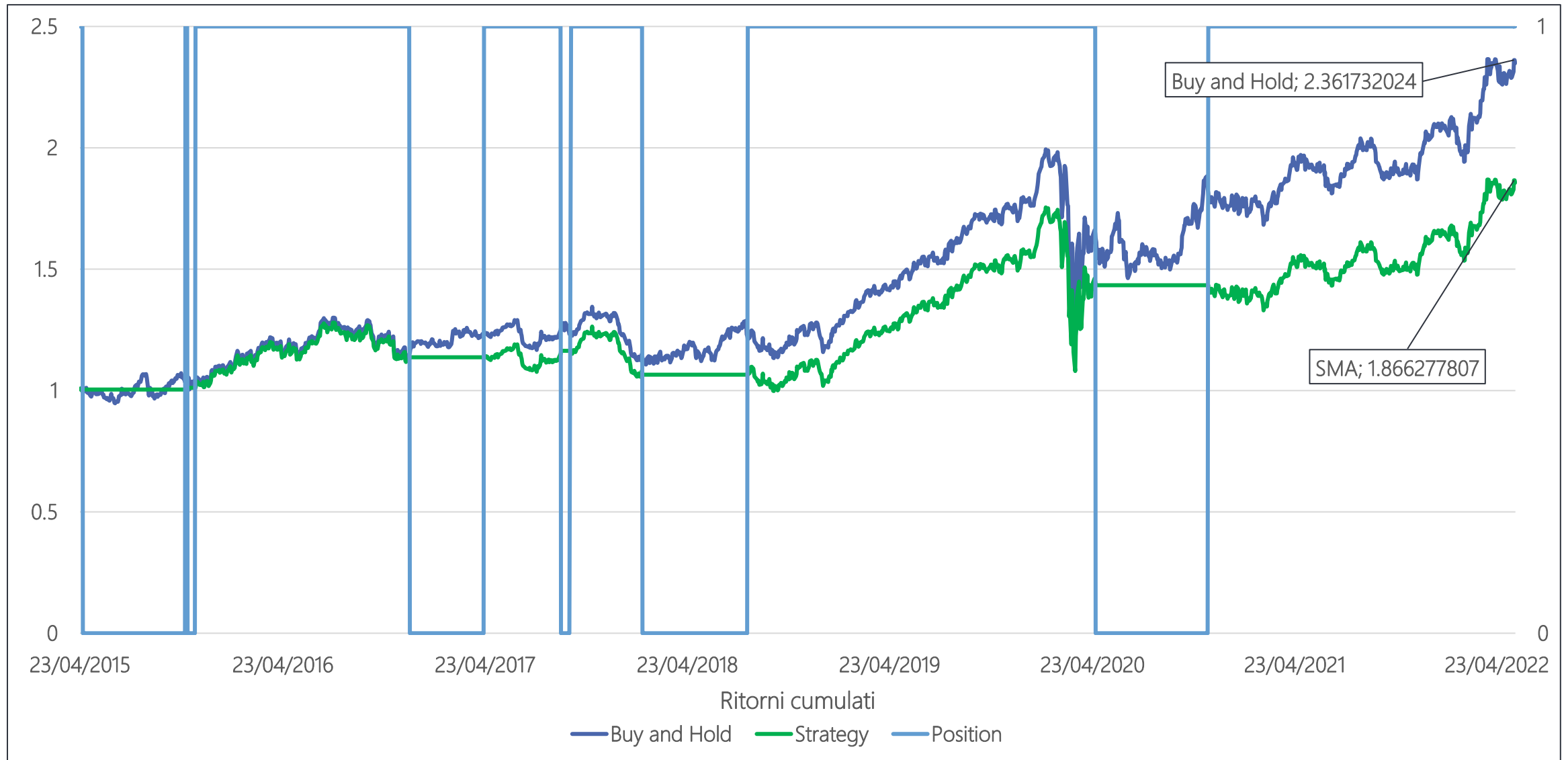
Strategia SMA applicata a LLY



Strategia SMA applicata a NEE



Strategia SMA applicata a SO



Portfolio con Sharpe Ratio Massimo

43% RENDIMENTO
ATTESO

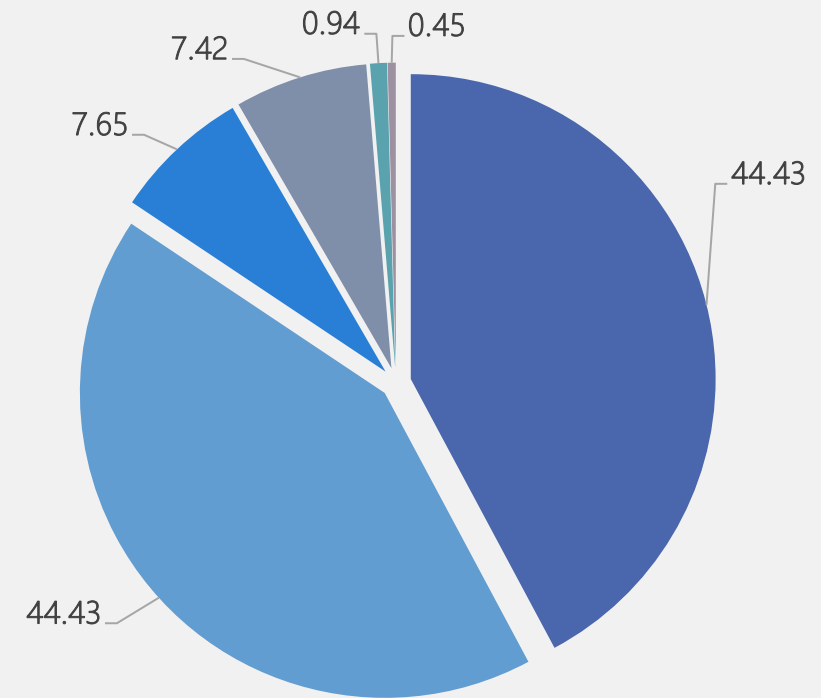
26% VOLATILITA

166% SHARPE RATIO

1.096 BETA su
SP500

Portfolio costruito tramite il metodo di
simulazione Montecarlo sui rendimenti
passati dei singoli stocks

■ NVDA ■ LLY ■ UNH ■ NEE ■ SO ■ QCOM



Portfolio con Volatilità Minima

20% RENDIMENTO
ATTESO

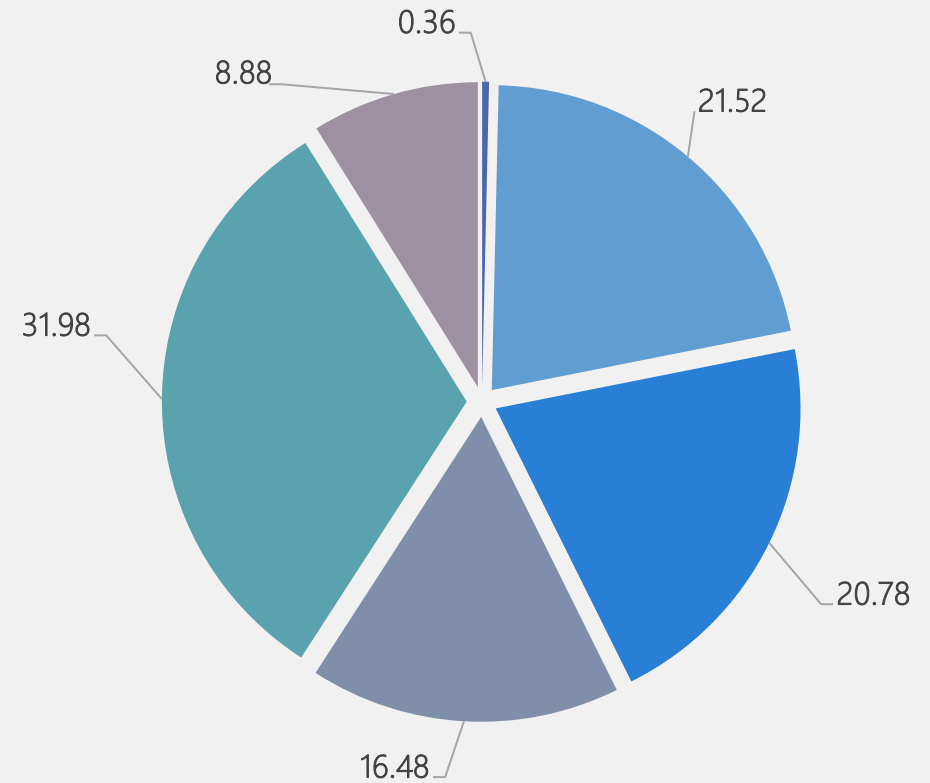
18% VOLATILITÀ

114% SHARPE RATIO

0.751 BETA su
SP500

Portfolio costruito tramite il metodo di
simulazione Montecarlo sui rendimenti
passati dei singoli stocks

■ NVDA ■ LLY ■ UNH ■ NEE ■ SO ■ QCOM





GRAZIE