

Portafoglio Trading avanzato - Backtest da 26/11/2004 con cambio titoli ogni settimana

Durata anni 5,0
Performance portafoglio 994,18%
Performance annua composta 61,58%
Performance indice S&P500 -5,48%
Performance annua composta -1,12%

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performance indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
						9.648	9.648							
1	26/11/04	6	-2,6	0,7	-3,3	9.329	9.716							
2	03/12/04	6	-0,7	-0,3	-0,4	9.292	9.686							
3	10/12/04	6	3,3	0,5	2,8	9.552	9.735							
4	17/12/04	6	1,6	1,3	0,3	9.581	9.861							
5	24/12/04	6	2,3	0,1	2,2	9.791	9.871							
6	31/12/04	6	-4,3	-2,1	-2,2	9.576	9.664							
7	07/01/05	6	3,6	-0,1	3,7	9.930	9.654							
8	14/01/05	6	-1,1	-1,4	0,3	9.960	9.519							
9	21/01/05	6	0,5	0,3	0,2	9.980	9.548							
10	28/01/05	6	10,8	2,7	8,1	10.788	9.805							
11	04/02/05	6	0,3	0,2	0,1	10.799	9.825							
12	11/02/05	6	-3,5	-0,3	-3,2	10.454	9.796							
13	18/02/05	6	1,7	0,8	0,9	10.548	9.874							
14	25/02/05	6	3,8	0,9	2,9	10.854	9.963							
15	04/03/05	6	-3,9	-1,8	-2,1	10.626	9.783							
16	11/03/05	6	-2,3	-0,9	-1,4	10.477	9.695							
17	18/03/05	6	1,1	-1,5	2,6	10.749	9.550							
18	25/03/05	6	-1,9	0,1	-2,0	10.534	9.560							
19	01/04/05	6	0,1	0,7	-0,6	10.471	9.626							
20	08/04/05	6	-5,4	-3,3	-2,1	10.251	9.309							
21	15/04/05	6	2,5	0,8	1,7	10.426	9.383							
22	22/04/05	6	0,4	0,4	0,0	10.426	9.421							
23	29/04/05	6	3,2	1,3	1,9	10.624	9.543							
24	06/05/05	6	-2,3	-1,5	-0,8	10.539	9.400							
25	13/05/05	6	5,9	3,1	2,8	10.834	9.692							
26	20/05/05	6	3,5	0,8	2,7	11.126	9.769							
27	27/05/05	6	3,9	-0,2	4,1	11.582	9.750							
28	03/06/05	6	-0,8	0,2	-1,0	11.467	9.769							
29	10/06/05	6	3,0	1,6	1,4	11.627	9.925							
30	17/06/05	6	-0,5	-2,1	1,6	11.813	9.717							
31	24/06/05	6	3,3	0,2	3,1	12.179	9.736							
32	01/07/05	6	4,2	1,5	2,7	12.508	9.882							
33	08/07/05	6	-2,1	1,3	-3,4	12.083	10.011							
34	15/07/05	6	4,5	0,5	4,0	12.566	10.061							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performace indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
35	22/07/05	6	5,7	0,0	5,7	13.282	10.061							
36	29/07/05	6	3,2	-0,6	3,8	13.787	10.001							
37	05/08/05	6	2,3	0,3	2,0	14.063	10.031							
38	12/08/05	6	-2,0	-0,9	-1,1	13.908	9.940							
39	19/08/05	6	3,0	-1,2	4,2	14.492	9.821							
40	26/08/05	6	7,1	1,1	6,0	15.362	9.929							
41	02/09/05	6	4,6	1,9	2,7	15.777	10.118							
42	09/09/05	6	-6,3	-0,3	-6,0	14.830	10.087							
43	16/09/05	6	-2,7	-1,8	-0,9	14.697	9.906							
44	23/09/05	6	2,4	1,1	1,3	14.888	10.015							
45	30/09/05	6	-3,6	-2,7	-0,9	14.754	9.744							
46	07/10/05	6	-3,1	-0,8	-2,3	14.414	9.666							
47	14/10/05	6	0,2	-0,6	0,8	14.530	9.608							
48	21/10/05	6	2,1	1,6	0,5	14.602	9.762							
49	28/10/05	6	6,6	1,8	4,8	15.303	9.938							
50	04/11/05	6	-0,4	1,2	-1,6	15.058	10.057							
51	11/11/05	6	5,1	1,1	4,0	15.661	10.168							
52	18/11/05	6	2,3	1,6	0,7	15.770	10.330							
53	25/11/05	6	3,1	-0,2	3,3	16.291	10.310							
54	02/12/05	6	5,1	-0,5	5,6	17.203	10.258							
55	09/12/05	6	-1,3	0,6	-1,9	16.876	10.320							
56	16/12/05	6	-5,5	0,1	-5,6	15.931	10.330							
57	23/12/05	6	-2,1	-1,6	-0,5	15.851	10.165							
58	30/12/05	6	9,9	3,0	6,9	16.945	10.470							
59	06/01/06	6	1,1	0,2	0,9	17.098	10.491							
60	13/01/06	6	-5,1	-2,0	-3,1	16.568	10.281							
61	20/01/06	6	6,8	1,8	5,0	17.396	10.466							
62	27/01/06	6	1,9	-1,5	3,4	17.988	10.309							
63	03/02/06	6	-1,6	0,2	-1,8	17.664	10.330							
64	10/02/06	6	6,7	1,6	5,1	18.565	10.495							
65	17/02/06	6	1,0	0,2	0,8	18.713	10.516							
66	24/02/06	6	0,4	-0,2	0,6	18.825	10.495							
67	03/03/06	6	-0,3	-0,4	0,1	18.844	10.453							
68	10/03/06	6	8,6	2,0	6,6	20.088	10.662							
69	17/03/06	6	-0,5	-0,3	-0,2	20.048	10.630							
70	24/03/06	6	8,5	-0,6	9,1	21.872	10.566							
71	31/03/06	6	4,5	0,1	4,4	22.835	10.577							
72	07/04/06	6	-0,8	-0,5	-0,3	22.766	10.524							
73	14/04/06	6	3,7	1,7	2,0	23.221	10.703							
74	21/04/06	6	3,4	-0,1	3,5	24.034	10.692							
75	28/04/06	6	0,7	1,2	-0,5	23.914	10.820							
76	05/05/06	6	-2,8	-2,6	-0,2	23.866	10.539							
77	12/05/06	6	-6,4	-1,9	-4,5	22.792	10.339							
78	19/05/06	6	4,1	1,0	3,1	23.499	10.442							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performace indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
79	26/05/06	6	6,1	0,6	5,5	24.791	10.505							
80	02/06/06	6	-4,1	-2,8	-1,3	24.469	10.211							
81	09/06/06	6	1,8	-0,1	1,9	24.934	10.200							
82	16/06/06	6	2,3	-0,6	2,9	25.657	10.139							
83	23/06/06	6	4,0	2,1	1,9	26.144	10.352							
84	30/06/06	6	5,2	-0,4	5,6	27.608	10.311							
85	07/07/06	6	-9,7	-2,3	-7,4	25.565	10.074							
86	14/07/06	6	1,1	0,3	0,8	25.770	10.104							
87	21/07/06	6	6,0	3,1	2,9	26.517	10.417							
88	28/07/06	6	4,9	0,1	4,8	27.790	10.427							
89	04/08/06	6	-0,1	-1,0	0,9	28.040	10.323							
90	11/08/06	6	5,4	2,8	2,6	28.769	10.612							
91	18/08/06	6	-2,9	-0,6	-2,3	28.108	10.548							
92	25/08/06	6	0,4	1,2	-0,8	27.883	10.675							
93	01/09/06	6	-0,2	-0,9	0,7	28.078	10.579							
94	08/09/06	6	1,9	1,6	0,3	28.162	10.748							
95	15/09/06	6	0,1	-0,4	0,5	28.303	10.705							
96	22/09/06	6	1,4	1,6	-0,2	28.246	10.877							
97	29/09/06	6	1,1	1,0	0,1	28.275	10.985							
98	06/10/06	6	2,6	1,2	1,4	28.670	11.117							
99	13/10/06	6	1,3	0,2	1,1	28.986	11.139							
100	20/10/06	6	0,9	0,6	0,3	29.073	11.206							
101	27/10/06	6	-1,8	-0,9	-0,9	28.811	11.105							
102	03/11/06	6	2,5	1,2	1,3	29.186	11.239							
103	10/11/06	6	3,3	1,5	1,8	29.711	11.407							
104	17/11/06	6	1,3	0,0	1,3	30.097	11.407							
105	24/11/06	6	-1,5	-0,3	-1,2	29.736	11.373							
106	01/12/06	6	1,5	0,9	0,6	29.914	11.475							
107	08/12/06	6	-0,6	1,2	-1,8	29.376	11.613							
108	15/12/06	6	-1,9	-1,1	-0,8	29.141	11.485							
109	22/12/06	6	0,7	0,5	0,2	29.199	11.543							
110	29/12/06	6	3,3	-0,6	3,9	30.338	11.473							
111	05/01/07	6	1,1	1,5	-0,4	30.217	11.646							
112	12/01/07	6	-0,5	0,0	-0,5	30.066	11.646							
113	19/01/07	6	-1,5	-0,6	-0,9	29.795	11.576							
114	26/01/07	6	6,1	1,8	4,3	31.076	11.784							
115	02/02/07	6	1,9	-0,7	2,6	31.884	11.702							
116	09/02/07	6	2,5	1,2	1,3	32.299	11.842							
117	16/02/07	6	2,9	-0,3	3,2	33.332	11.806							
118	23/02/07	6	-3,9	-4,4	0,5	33.499	11.287							
119	02/03/07	6	7,3	1,1	6,2	35.576	11.411							
120	09/03/07	6	2,1	-1,1	3,2	36.714	11.286							
121	16/03/07	6	4,4	3,5	0,9	37.045	11.681							
122	23/03/07	6	-2,5	-1,1	-1,4	36.526	11.552							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performance indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
123	30/03/07	6	-1,0	1,6	-2,6	35.576	11.737							
124	06/04/07	6	1,8	0,6	1,2	36.003	11.807							
125	13/04/07	6	-1,0	2,2	-3,2	34.851	12.067							
126	20/04/07	6	4,3	0,7	3,6	36.106	12.152							
127	27/04/07	6	2,8	0,8	2,0	36.828	12.249							
128	04/05/07	6	4,0	0,0	4,0	38.301	12.249							
129	11/05/07	6	0,6	1,1	-0,5	38.110	12.384							
130	18/05/07	6	2,8	-0,5	3,3	39.367	12.322							
131	25/05/07	6	1,5	1,4	0,1	39.406	12.494							
132	01/06/07	6	-3,1	-1,9	-1,2	38.934	12.257							
133	08/06/07	6	1,5	1,7	-0,2	38.856	12.465							
134	15/06/07	6	0,4	-2,0	2,4	39.788	12.216							
135	22/06/07	6	2,3	0,1	2,2	40.664	12.228							
136	29/06/07	6	7,7	1,8	5,9	43.063	12.448							
137	06/07/07	6	0,2	1,4	-1,2	42.546	12.622							
138	13/07/07	6	3,9	-1,2	5,1	44.716	12.471							
139	20/07/07	6	-8,8	-4,9	-3,9	42.972	11.860							
140	27/07/07	6	-0,7	-1,8	1,1	43.445	11.646							
141	03/08/07	6	-1,2	1,4	-2,6	42.315	11.809							
142	10/08/07	6	-3,1	-0,5	-2,6	41.215	11.750							
143	17/08/07	6	8,6	2,3	6,3	43.811	12.021							
144	24/08/07	6	-1,7	-0,4	-1,3	43.242	11.973							
145	31/08/07	6	-0,4	-1,4	1,0	43.674	11.805							
146	07/09/07	6	2,5	2,1	0,4	43.849	12.053							
147	14/09/07	6	0,6	2,8	-2,2	42.884	12.390							
148	21/09/07	6	0,2	0,1	0,1	42.927	12.403							
149	28/09/07	6	-1,7	2,0	-3,7	41.339	12.651							
150	05/10/07	6	-0,6	0,3	-0,9	40.967	12.689							
151	12/10/07	6	-1,9	-3,9	2,0	41.786	12.194							
152	19/10/07	6	6,6	2,3	4,3	43.583	12.474							
153	26/10/07	6	-3,7	-1,7	-2,0	42.711	12.262							
154	02/11/07	6	-2,7	-3,7	1,0	43.138	11.809							
155	09/11/07	6	-1,1	0,3	-1,4	42.535	11.844							
156	16/11/07	6	-2,5	-1,2	-1,3	41.982	11.702							
157	23/11/07	6	12,4	2,8	9,6	46.012	12.030							
158	30/11/07	6	1,7	1,6	0,1	46.058	12.222							
159	07/12/07	6	-0,5	-2,4	1,9	46.933	11.929							
160	14/12/07	6	3,3	1,1	2,2	47.965	12.060							
161	21/12/07	6	1,7	-0,4	2,1	48.973	12.012							
162	28/12/07	6	-4,2	-4,5	0,3	49.120	11.471							
163	04/01/08	6	-2,5	-0,8	-1,7	48.285	11.379							
164	11/01/08	6	-1,9	-5,4	3,5	49.975	10.765							
165	18/01/08	6	4,9	0,4	4,5	52.223	10.808							
166	25/01/08	6	7,1	4,9	2,2	53.372	11.337							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performance indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
167	01/02/08	6	-1,1	-4,6	3,5	55.240	10.816							
168	08/02/08	6	-0,3	1,4	-1,7	54.301	10.967							
169	15/02/08	6	-1,1	0,2	-1,3	53.595	10.989							
170	22/02/08	6	0,0	-1,7	1,7	54.506	10.803							
171	29/02/08	6	-0,4	-2,8	2,4	55.815	10.500							
172	07/03/08	6	-1,0	-0,4	-0,6	55.480	10.458							
173	14/03/08	6	-2,4	3,2	-5,6	52.373	10.793							
174	21/03/08	6	2,0	-1,1	3,1	53.996	10.674							
175	28/03/08	6	5,9	4,2	1,7	54.914	11.122							
176	04/04/08	6	-3,2	-2,7	-0,5	54.640	10.822							
177	11/04/08	6	6,0	4,3	1,7	55.569	11.287							
178	18/04/08	6	5,2	0,5	4,7	58.180	11.344							
179	25/04/08	6	1,1	1,1	0,0	58.180	11.469							
180	02/05/08	6	-3,8	-1,8	-2,0	57.017	11.262							
181	09/05/08	6	2,8	2,7	0,1	57.074	11.566							
182	16/05/08	6	-4,2	-3,5	-0,7	56.674	11.161							
183	23/05/08	6	2,9	1,8	1,1	57.298	11.362							
184	30/05/08	6	1,5	-2,8	4,3	59.762	11.044							
185	06/06/08	6	5,2	0,0	5,2	62.869	11.044							
186	13/06/08	6	0,2	-3,1	3,3	64.944	10.702							
187	20/06/08	6	-5,1	-3,0	-2,1	63.580	10.381							
188	27/06/08	6	-2,2	-1,2	-1,0	62.944	10.256							
189	04/07/08	6	6,0	-1,9	7,9	67.917	10.061							
190	11/07/08	6	-0,7	1,7	-2,4	66.287	10.232							
191	18/07/08	6	2,1	-0,2	2,3	67.811	10.212							
192	25/07/08	6	3,7	0,2	3,5	70.185	10.232							
193	01/08/08	6	1,1	2,9	-1,8	68.921	10.529							
194	08/08/08	6	-1,7	0,1	-1,8	67.681	10.540							
195	15/08/08	6	1,7	-0,5	2,2	69.170	10.487							
196	22/08/08	6	2,5	-0,7	3,2	71.383	10.413							
197	29/08/08	6	-6,6	-3,2	-3,4	68.956	10.080							
198	05/09/08	6	1,6	0,8	0,8	69.508	10.161							
199	12/09/08	6	-6,2	0,3	-6,5	64.990	10.191							
200	19/09/08	6	-8,6	-3,4	-5,2	61.610	9.845							
201	26/09/08	6	-13,6	-9,4	-4,2	59.023	8.919							
202	03/10/08	6	-17,5	-18,2	0,7	59.436	7.296							
203	10/10/08	6	6,0	4,7	1,3	60.209	7.639							
204	17/10/08	6	-12,4	-6,7	-5,7	56.777	7.127							
205	24/10/08	6	19,6	10,6	9,0	61.887	7.883							
206	31/10/08	6	-9,7	-3,8	-5,9	58.235	7.583							
207	07/11/08	6	-13,7	-6,1	-7,6	53.809	7.121							
208	14/11/08	6	-7,2	-8,3	1,1	54.401	6.530							
209	21/11/08	6	6,8	12,1	-5,3	51.518	7.320							
210	28/11/08	6	-2,6	-2,2	-0,4	51.312	7.159							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performace indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
211	05/12/08	6	1,1	0,5	0,6	51.620	7.194							
212	12/12/08	6	0,4	1,0	-0,6	51.310	7.266							
213	19/12/08	6	1,4	-1,6	3,0	52.849	7.150							
214	26/12/08	6	7,6	6,8	0,8	53.272	7.636							
215	02/01/09	6	-3,9	-4,4	0,5	53.539	7.300							
216	09/01/09	6	2,7	-4,5	7,2	57.393	6.972							
217	16/01/09	6	-7,8	-2,1	-5,7	54.122	6.825							
218	23/01/09	6	1,8	-0,7	2,5	55.475	6.778							
219	30/01/09	6	0,1	5,2	-5,1	52.646	7.130							
220	06/02/09	6	-1,1	-4,7	3,6	54.541	6.795							
221	13/02/09	6	-0,4	-6,8	6,4	58.032	6.333							
222	20/02/09	6	1,3	-4,5	5,8	61.397	6.048							
223	27/02/09	6	-2,6	-7,0	4,4	64.099	5.625							
224	06/03/09	6	8,6	10,8	-2,2	62.689	6.232							
225	13/03/09	6	4,5	1,7	2,8	64.444	6.338							
226	20/03/09	6	4,3	6,2	-1,9	63.220	6.731							
227	27/03/09	6	1,8	3,3	-1,5	62.271	6.953							
228	03/04/09	6	9,1	1,7	7,4	66.879	7.071							
229	10/04/09	6	6,5	1,6	4,9	70.156	7.184							
230	17/04/09	6	12,0	-0,3	12,3	78.786	7.163							
231	24/04/09	6	2,2	1,4	0,8	79.416	7.263							
232	01/05/09	6	4,5	5,9	-1,4	78.304	7.692							
233	08/05/09	6	-3,6	-4,9	1,3	79.322	7.315							
234	15/05/09	6	2,6	0,5	2,1	80.988	7.351							
235	22/05/09	6	9,6	3,7	5,9	85.766	7.623							
236	29/05/09	6	3,0	2,3	0,7	86.367	7.799							
237	05/06/09	6	3,2	0,7	2,5	88.526	7.853							
238	12/06/09	6	-6,5	-2,6	-3,9	85.073	7.649							
239	19/06/09	6	1,4	-0,2	1,6	86.434	7.634							
240	26/06/09	6	-3,0	-2,4	-0,6	85.916	7.450							
241	03/07/09	6	-5,1	-1,9	-3,2	83.166	7.309							
242	10/07/09	6	9,1	7,0	2,1	84.913	7.821							
243	17/07/09	6	2,1	4,2	-2,1	83.130	8.149							
244	24/07/09	6	4,2	0,9	3,3	85.873	8.222							
245	31/07/09	6	10,4	2,4	8,0	92.743	8.420							
246	07/08/09	6	0,8	-0,6	1,4	94.041	8.369							
247	14/08/09	6	10,9	2,2	8,7	102.223	8.553							
248	21/08/09	6	3,2	0,3	2,9	105.187	8.579							
249	28/08/09	6	-0,9	-1,2	0,3	105.503	8.476							
250	04/09/09	6	6,1	2,6	3,5	109.196	8.696							
251	11/09/09	6	3,3	2,5	0,8	110.069	8.914							
252	18/09/09	6	-4,0	-2,2	-1,8	108.088	8.718							
253	25/09/09	6	-2,2	-1,8	-0,4	107.656	8.561							
254	02/10/09	6	10,1	4,6	5,5	113.577	8.955							

Numero Settimana	Data	Num titoli	Performance portafoglio	Performace indice S&P500	Differenziale portafoglio e indice	capitale iniziale portafoglio	capitale iniziale indice S&P500	tit 1	tit 2	tit 3	tit 4	tit 5	tit 6	Indice S&P500
255	09/10/09	6	0,6	1,5	-0,9	112.554	9.089							
256	16/10/09	6	-6,8	-0,7	-6,1	105.689	9.025							
257	23/10/09	6	-11,6	-4,0	-7,6	97.656	8.664							
258	29/10/09	6	5,6	3,2	2,4	100.000	8.942							1.066,11
259	05/11/09	6	1,6	0,0	1,5	101.567	8.946							1.066,63
260	12/11/09	6	3,9	1,9	2,0	105.566	9.119							1.087,24