PRZYKŁADOWY RAPORT

Real Markets | PRO | RAPORT ANALIZY

WYNIK: NISKIE RYZYKO SPADKU — w okresie próby portfel o dzisiejszym składzie tracił do 2,5% od szczytu (ok. 245,09 EUR przy dzisiejszej wartości); w 1 na 20 dni strata portfela przekraczała 36,23 EUR (0,4% wartości). Główne źródło strat w złe dni: USD (77%).

NISKIE

Na tle portfeli odniesienia (największy spadek na tych samych dniach): Twój portfel 2,5%; 100% BTC: brak danych; 60/40: brak danych; równe wagi 3,2%.

Co zrobić teraz: sprawdź, czy spadek rzędu 2,5% (ok. 245,09 EUR) i straty w złe dni mieszczą się w Twojej tolerancji ryzyka; najwięcej do strat w złe dni wnosi USD. Raport opisuje historię próby i nie jest rekomendacją kupna ani sprzedaży.

Dane demonstracyjne: kursy referencyjne EBC (USD, GBP, JPY w EUR) i przykładowy portfel 10 000 EUR. To skrót raportu Real Markets Pro — pełny raport zawiera też zakres, wszystkie pomiary, ustalenia, źródło danych i identyfikator dokumentu. To nie jest doradztwo inwestycyjne.

TWÓJ PORTFEL

Wartość portfela: 10 000 EUR (zadeklarowana przez Ciebie); okres próby: 2025-09-11 – 2026-11-13; obserwacji: 300.
Zmiana wartości w okresie próby: +3,5% (+350,78 EUR).
Największy spadek od szczytu: 2,5% (245,09 EUR przy dzisiejszej wartości).
Zmienność roczna: 3,5%; najgorszy pojedynczy dzień w próbie: -0,7%.
Zły dzień: w 5% najgorszych dni próby strata przekraczała 36,23 EUR (0,4%); średnio w takich dniach 49,18 EUR.
Największe źródła strat w złych dniach: USD 77%; JPY 15%; GBP 8%.
Niepewność oszacowania: zły dzień (95%) 36,23 EUR (przedział ufności 95%: 26,47–44,26 EUR; w ogonie 95% jest 16 z 300 dni); średnia strata w złe dni 49,18 EUR (przedział ufności 95%: 39,73–55,91 EUR); 1 na 100 dni: 55,36 EUR (przedział ufności 95%: 45,58–59,44 EUR; w ogonie 99% jest 4 z 300 dni).
Porównanie z prostymi portfelami odniesienia na tych samych dniach. Twój portfel: spadek 2,5%, Sharpe -0,01.
100% BTC: brak danych — w danych nie ma serii BTC; tego porównania nie wykonano.
60/40 akcje/obligacje: brak danych — w danych nie ma serii akcji ani obligacji; tego porównania nie wykonano.
Równe wagi Twoich pozycji: największy spadek 3,2%, zmienność roczna 3,4%, Sharpe -0,29; Twój portfel spadł o 0,8% pkt proc. mniej; odchylenie od niego (tracking error) 1,1% rocznie.
Liczby dotyczą portfela o dzisiejszym składzie przywracanym po każdym dniu próby. To nie jest historia Twojego rachunku ani prognoza.

PRZYKŁADOWY RAPORT

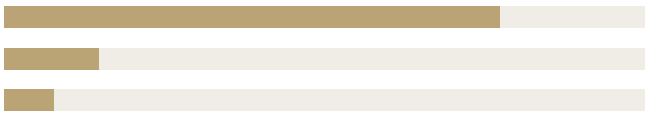
Real Markets | PRO | RAPORT ANALIZY

UDZIAŁ AKTYWÓW W STRACIE W ZŁE DNI

USD: 77,4%

JPY: 14,8%

GBP: 7,8%



Udział = wkład aktywa w średnią stratę portfela w 5% najgorszych obserwacji; wartość ujemna łagodziła straty. Kwoty w TXT i JSON.

GRANICE TEGO RAPORTU

1. Liczby opisują historię próby (2025-09-11 – 2026-11-13); nie są prognozą — przyszłe spadki i straty mogą być większe.
2. Wyniki portfela liczymy dla dzisiejszego składu przywracanego po każdym dniu; to nie jest historia Twojego rachunku.
3. To analiza informacyjna, nie doradztwo inwestycyjne: raport nie wskazuje, co kupić, sprzedać ani jak zmienić portfel.
4. Dane dostarczyłeś Ty; nie potwierdziliśmy niezależnie ich źródła.
5. Pełna lista zapisanych ograniczeń (28) jest w załączniku technicznym pliku TXT i w pliku JSON.