



בדיקה היסטורית • Backtest

רובוט נאסד"ק 100 מול החזקה פשוטה

רווחים דומים לאורך זמן, עם נפילות קטנות בהרבה.

תקופת הבדיקה: 10/2026 – 1989 • כולל עמלות • בלי מינוף

בשורה התחתונה

- **ירידה מקסימלית:** בערך 32% - ברובוט, לעומת בערך 83% - בהחזקת נאסד"ק 100 (משבר הדוט־קום).
- **לאורך כל התקופה** הרובוט הניב תשואה שנתית ממוצעת של בערך 22%, לעומת בערך 15% בהחזקה, בעיקר בזכות ההימנעות מהנפילות הגדולות.
- **חשוב לומר בכנות:** מאז 2013 התשואות דומות, והרובוט אפילו מעט מתחת להחזקה (בערך 19% לעומת בערך 20% בשנה). היתרון שלו בתקופה הזו הוא בעיקר בהגנה, לא בתשואה גבוהה יותר.
- **השנה הגרועה ביותר:** בערך 22% - ברובוט, לעומת בערך 41% - בהחזקה.

-22%

השנה הגרועה ביותר
החזקה: -41%

19%

תשואה שנתית מאז 2013
החזקה: 20%

-32%

ירידה מקסימלית
החזקה: -83%

22%

תשואה שנתית ממוצעת
החזקה: 15%

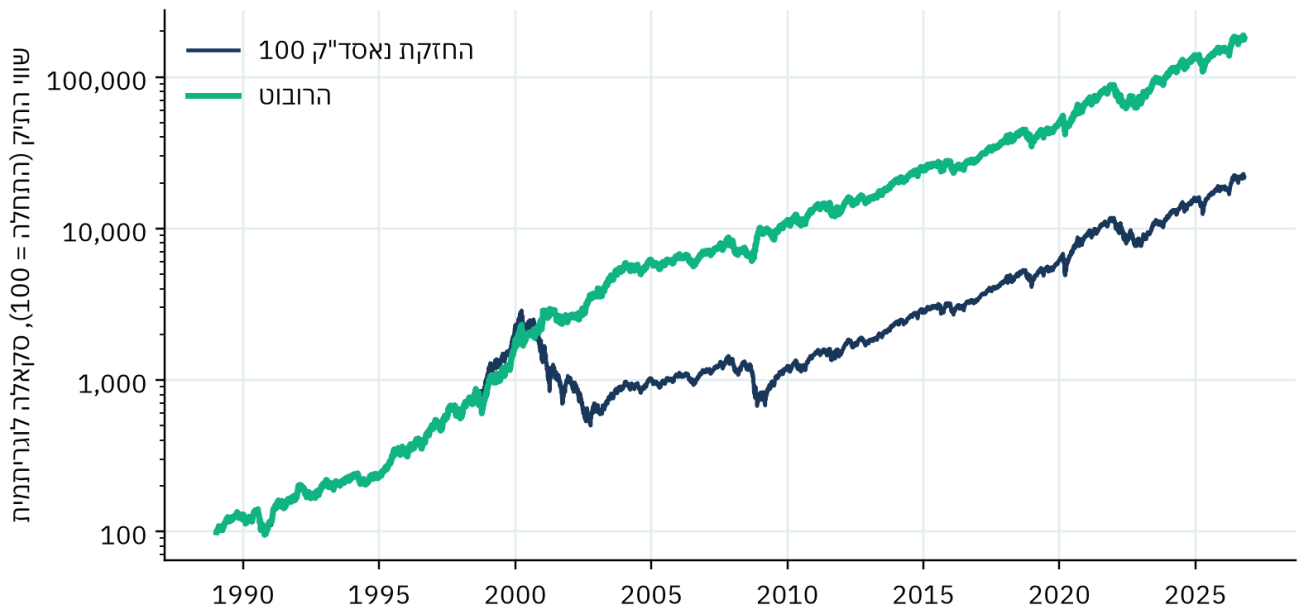
כל המספרים מעוגלים ומבוססים על הרצה על נתוני עבר.

מאת: אנזו יונס דוד • רובוט משלך



צמיחת התיק לאורך הזמן

הגרף בסקאלה לוגריתמית. ההחזקה (בכחול) נופלת חזק במשברים של שוק ההון ב־2000 וב־2008. הרובוט (בירוק) עובר אותם עם נזק קטן בהרבה.



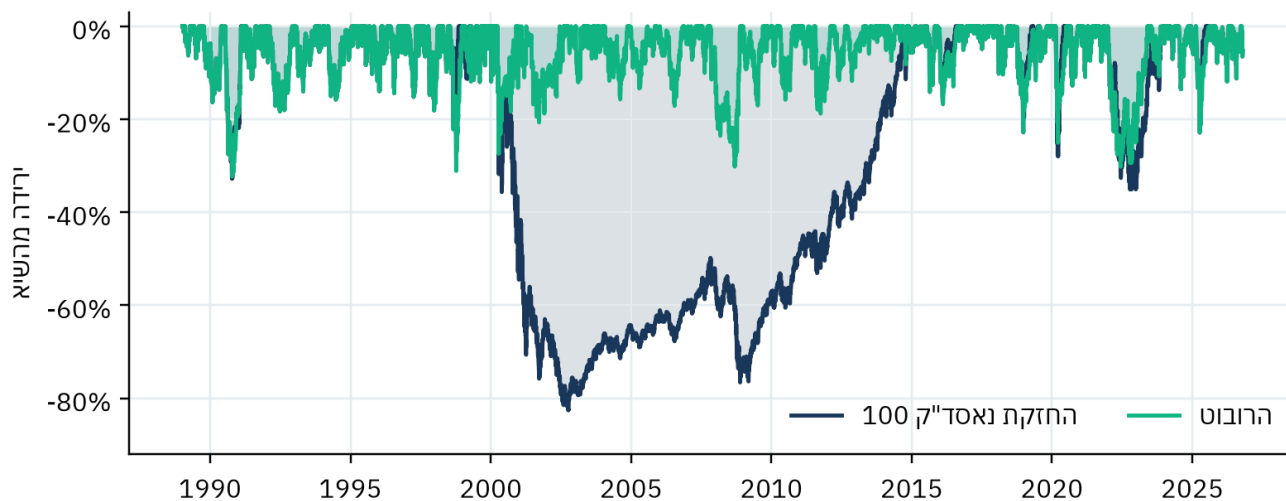
שווי התיק כשנקודת ההתחלה היא 100.

המספרים

מדד	הרובוט	החזקת נאסד"ק 100
תשואה שנתית ממוצעת, 1989–2026	22%	15%
תשואה שנתית ממוצעת, 2013–2026	19%	20%
ירידה מקסימלית	-32%	-83%
השנה הגרועה ביותר	(2022) -22%	(2008) -41%



הנפילות



ירידה מהשיא האחרון, באחוזים.

איך הרובוט עובד, בקצרה

הרובוט מחזיק את נאסד"ק 100 רוב הזמן. כשכמה סימני סיכון בשוק ההון מופיעים יחד, הוא עובר זמנית לנכס הגנתי, וחוזר למניות לפי כללים קבועים מראש, בלי רגשות ובלי ניחושים. בלי מינוף ובלי מכירה בחסר. הכללים והפרמטרים המדויקים הם חלק מהשיטה ואינם מפורסמים.

איך נבדק

- נתונים יומיים מ-1989 עד אוקטובר 2026. כל החלטה מתקבלת רק לפי מידע שהיה זמין באותו יום.
- עמלות והחלקה: 0.10% על כל עסקה.
- השיטה נבנתה על נתוני 1989-2012, והתקופה 2013-2026 משמשת כבדיקה. בתקופה הזו התשואה דומה להחזקה, מעט נמוכה ממנה.
- אחרי מספר בדיקות, הגרסה הסופית נבחרה כשנתוני 2013-2026 כבר היו ידועים. לכן היא נבדקת עכשיו גם בזמן אמת, בלי כסף אמיתי.

אנזו יונס דוד · רובוט משלך · robot-mishelcha.com