Celem projektu było stworzenie oraz przeanalizowanie portfela wybranych inwestycji. Przedstawiony portfel składał się z akcji spółki CCC oraz 3 inwestycji alternatywnych: akcji funduszu AMLP, waluty euro i złota. Jako okres badania przyjęto zakres czasowy 01.01.2016-01.10.2024, w którym porównywano miesięczne zmiany cen. Największymi wahaniami charakteryzowała się spółka CCC. Najmniejsze zmiany zauważono w stopach zwrotu waluty euro. W dalszych krokach badania stwierdzono, że jest to również najbezpieczniejsza inwestycja. Z kolei najbardziej stabilną inwestycją okazało się złoto.

Następnie przeprowadzono analizę zależności pomiędzy inwestycjami wchodzącymi w skład portfela. Korelacje pomiędzy poszczególnymi aktywami zawarły się w przedziałach korelacji niskiej, słabej lub umiarkowanej. W tym punkcie uwagę zwraca dodatni współczynnik zależności pomiędzy spółką CCC i funduszem AMLP. Sugeruje on przeanalizowanie składu portfela, aby zminimalizować ryzyko.

Wybrane współczynniki efektywności wykazały, że najlepszy stosunek osiągalnego zysku do podejmowanego ryzyka wykazuje inwestycja w złoto. Najgorzej w tym etapie badania wypadł fundusz AMLP. Zauważono jednak, że wpływ na wyliczone współczynniki mogła mieć sytuacja rynkowa podczas rozprzestrzeniania się pandemii Covid.

Analiza portfeli optymalnych zmieniających się w czasie pokazała, że by jak najefektywniej osiągnąć cel realizowanej strategii inwestycyjnej należałoby regularnie ustalać strukturę badanego portfela.

Obraz zawierający tekst, Czcionka, linia, Wykres

Opis wygenerowany automatycznie

Obraz zawierający tekst, Czcionka, zrzut ekranu, Wykres

Opis wygenerowany automatycznie