Projekt: Budowa portfela inwestycyjnego…

Kierunek: Analityka Gospodarcza

Przedmiot: Inwestycje alternatywne

Prowadzący: Marcin Potrykus

Autorzy: Julia Dobosz[[1]](#footnote-1), Aleksandra Juchniewicz[[2]](#footnote-2)

Streszczenie

Wprowadzenie

Pojęcie inwestycji

Pojęcie inwestycji alternatywnych

Rodzaje inwestycji alternatywnych

Cechy wybranych inwestycji alternatywnych

Pojęcie portfel inwestycyjny

Opis metod badawczych i wyniki badań

1. Statystyki opisowe dla analizowanych inwestycji (1 pkt)

2. Stopę zwrotu, ryzyko, efektywność oraz wagi portfela cechującego się:

a. minimalnym ryzykiem (1 pkt),

b. maksymalną efektywnością (1 pkt).

3. Wartość współczynników korelacji dla analizowanych inwestycji (0,5 pkt)

4. Wartości różnych współczynników efektywności poznanych na wykładzie (0,5 pkt)

5. Zbiór możliwości inwestycyjnych z zaznaczeniem:

a. portfela o minimalnym ryzyku (0,5 pkt),

b. portfela o maksymalnej efektywności (0,5 pkt),

c. portfeli jednoelementowych (0,5 pkt),

d. krzywej wolnej od ryzyka (0,5 pkt). Dodatkowo można uwzględnić:

• krótką sprzedaż (0,5 pkt),

• pokazać jak optymalne portfele zmieniają się w czasie (możliwe dla dużej liczby notowań) (1 pkt),

• skład portfeli z granicy efektywnej (0,5 pkt)

Założenia:

1) dla każdej z inwestycji do obliczeń wykorzystać minimum 100 stóp zwrotu (np. dane dzienne, miesięczne),

2) posługiwać się logarytmiczną stopą zwrotu,

3) stopę zwrotu wolną od ryzyka przyjąć na poziomie 0,1 średniej stopy zwrotu z inwestycji w akcje przedsiębiorstwa wchodzącego w skład WIG30.

4) należy wskazać źródło danych. Obliczenia przeprowadzić na podstawie materiałów z wykładów i laboratoriów z wykorzystaniem oprogramowania omówionego na zajęciach. Wszelkie dodatkowe elementy związane z analizą portfelową mile widziane, trzeba zamieścić w punkcie dodatkowe elementy projektu.

Wnioski

Bibliografia

1. s202359@student.pg.edu.pl [↑](#footnote-ref-1)
2. xxxx@student.pg.edu.pl [↑](#footnote-ref-2)