

POLITECHNIKA GDAŃSKA



WYDZIAŁ ZARZĄDZANIA I EKONOMII



Katedra Analizy Ekonomicznej i Finansów

Kierunek: Analityka Gospodarcza

Przedmiot: Inwestycje alternatywne

Laboratorium: Projekt

Opracował: Marcin Potrykus

Projekt

Skonstruować portfel inwestycyjny dla 2 (2 pkt) lub 3 (4 pkt) inwestycji alternatywnych (każda z innej kategorii, kategorie nie mogą się powtarzać) + inwestycja w akcje polskiego przedsiębiorstwa wchodzącego w skład indeksu WIG30 (wcześniej WIG20). Wyniki projektu to sprawozdanie w formie elektronicznej zawierające:

- 1. Statystyki opisowe dla analizowanych inwestycji (2 pkt)**
- 2. Stopę zwrotu, ryzyko, efektywność oraz wagi portfela cechującego się:**
 - a. minimalnym ryzykiem (2 pkt),
 - b. maksymalną efektywnością (2 pkt).
- 3. Wartość współczynników korelacji dla analizowanych inwestycji (1 pkt)**
- 4. Wartości różnych współczynników efektywności poznanych na wykładzie (2 pkt)**
- 5. Zbiór możliwości inwestycyjnych z zaznaczeniem:**
 - a. portfela o minimalnym ryzyku (1 pkt),
 - b. portfela o maksymalnej efektywności (1 pkt),
 - c. portfeli jednoelementowych (1 pkt),

Dodatkowo można uwzględnić:

- krótką sprzedaż (2 pkt),
- pokazać jak optymalne portfele zmieniają się w czasie (możliwe dla dużej liczby notowań) (1 pkt),
- skład portfeli z granicy efektywnej (1 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.

Projekt można wykonywać w zespołach 3 lub 4 osobowych.