

# Nyári Data Kihívás

**Diverzifikált befektetési portfólió – egy kis adattudománnyal**

**2024.08.01.**

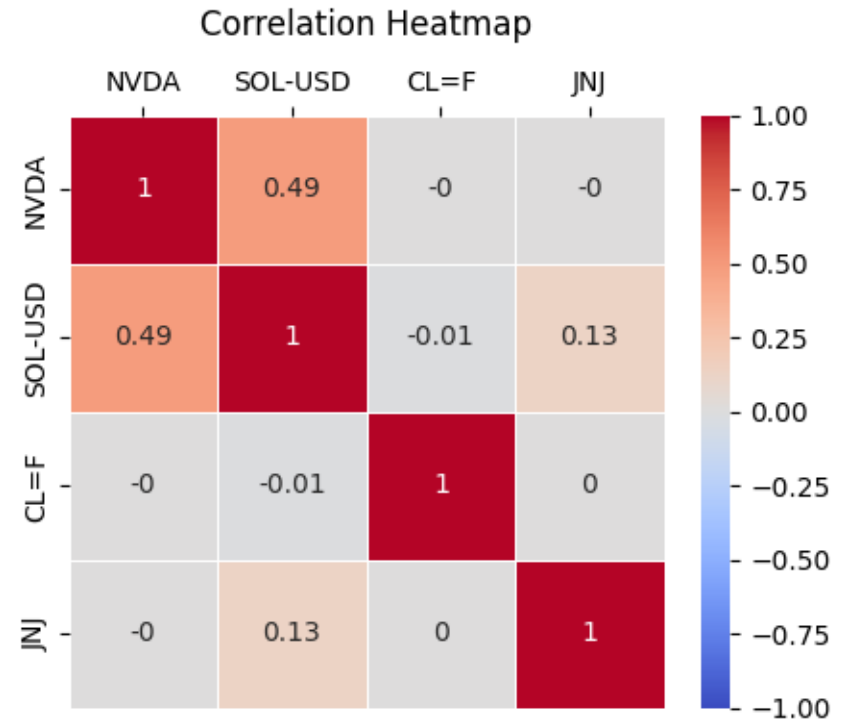
# Kiválasztási szempontok

1. Keressük meg azt a 4 pénzügyi eszközt amelyek leginkább függetlenek egymástól! – **Korreláció elemzés!**
2. Heti, havi, negyedéves vagy éves korreláció a megfelelő?

	Előny	Hátrány	Adatpontok száma
Heti	<ul style="list-style-type: none"><li>• nagyon részletes;</li><li>• gyorsan reagál a piaci eseményekre;</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>• nagyobb volatilitás;</li><li>• rövid távú zaj hatása;</li></ul>	225
Havi	<ul style="list-style-type: none"><li>• kevesebb volatilitás;</li><li>• jó egyensúly részletek és trendek között;</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>• tartalmazhat rövid távú ingadozásokat;</li></ul>	52
Negyedéves	<ul style="list-style-type: none"><li>• hosszabb távú trendek;</li><li>• kevesebb volatilitás;</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>• kevesebb adatpont;</li><li>• piaci események elmosódhatnak;</li></ul>	18
Éves	<ul style="list-style-type: none"><li>• tisztán hosszú távú trendek;</li><li>• minimális rövid távú zaj;</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>• nagyon kevés adatpont;</li><li>• sok fontos részlet elvész</li></ul>	5

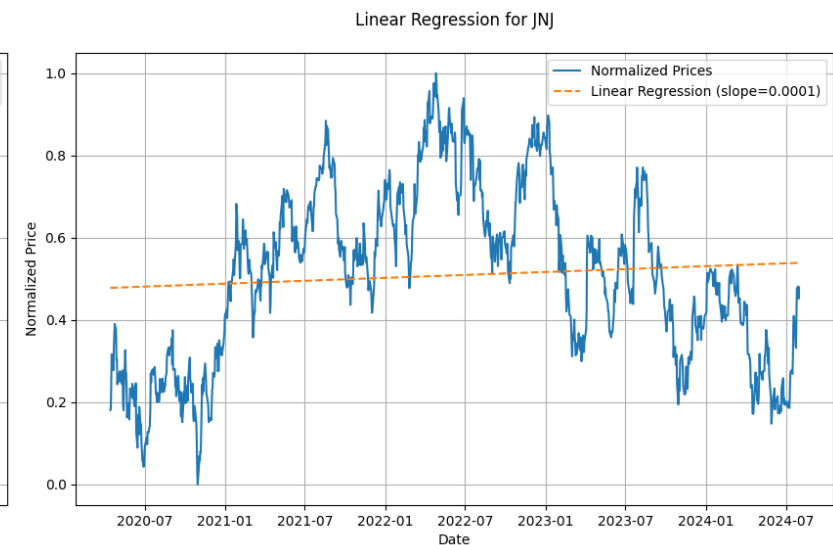
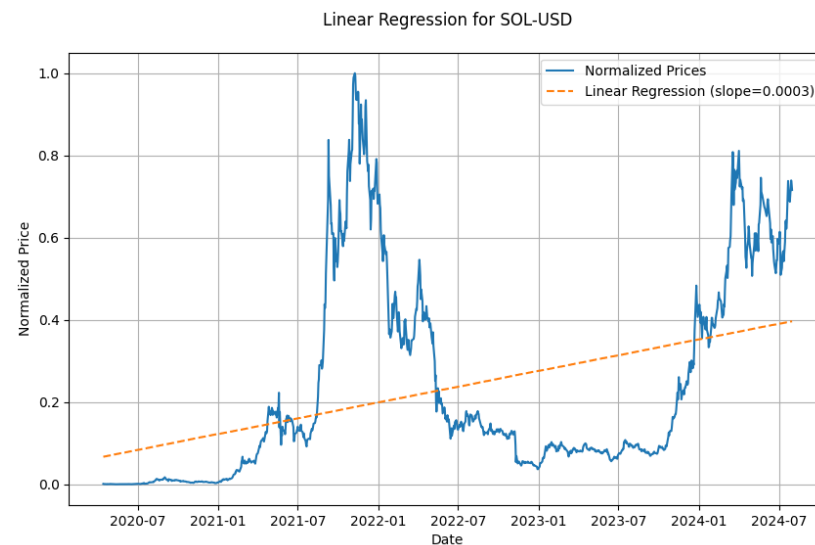
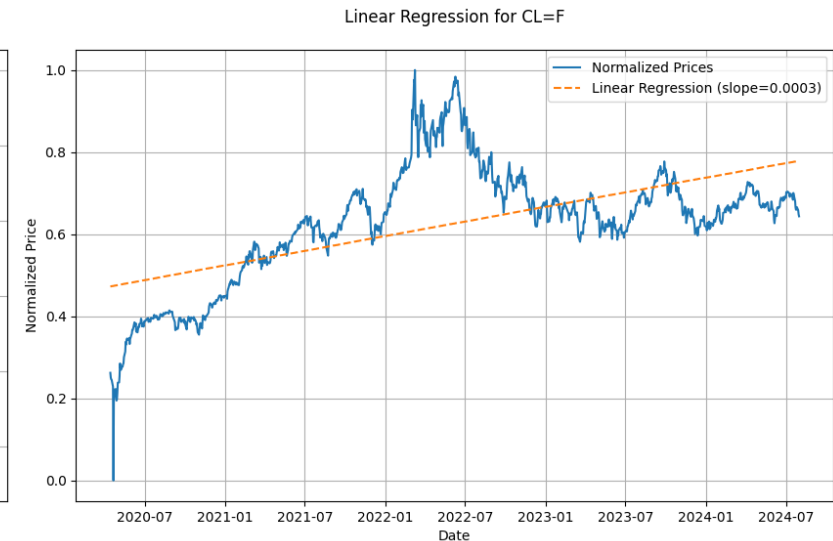
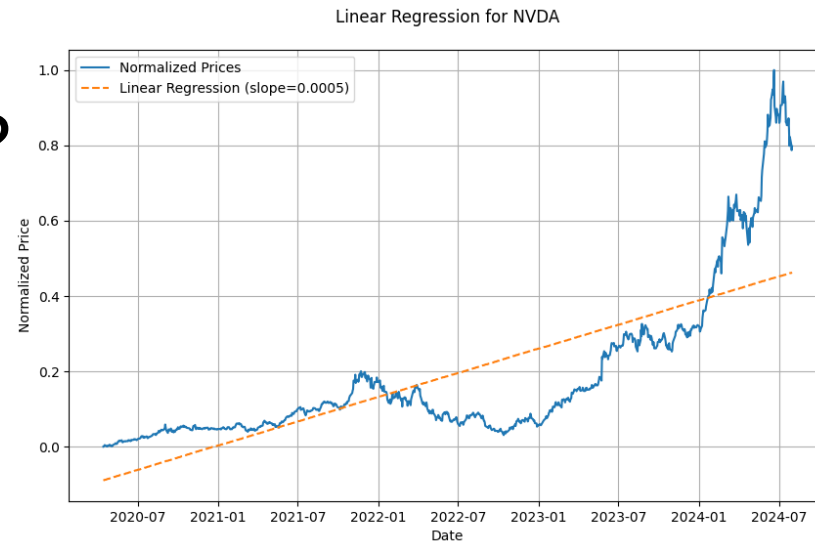
# Melyik négy eszközt válasszuk?

- NVIDIA Corporation (NVDA) – Technology
- Solana (SOL-USD) – Cryptocurrency
- Crude Oil (CL=F) – Future
- Johnson & Johnson (JNJ) – Healthcare



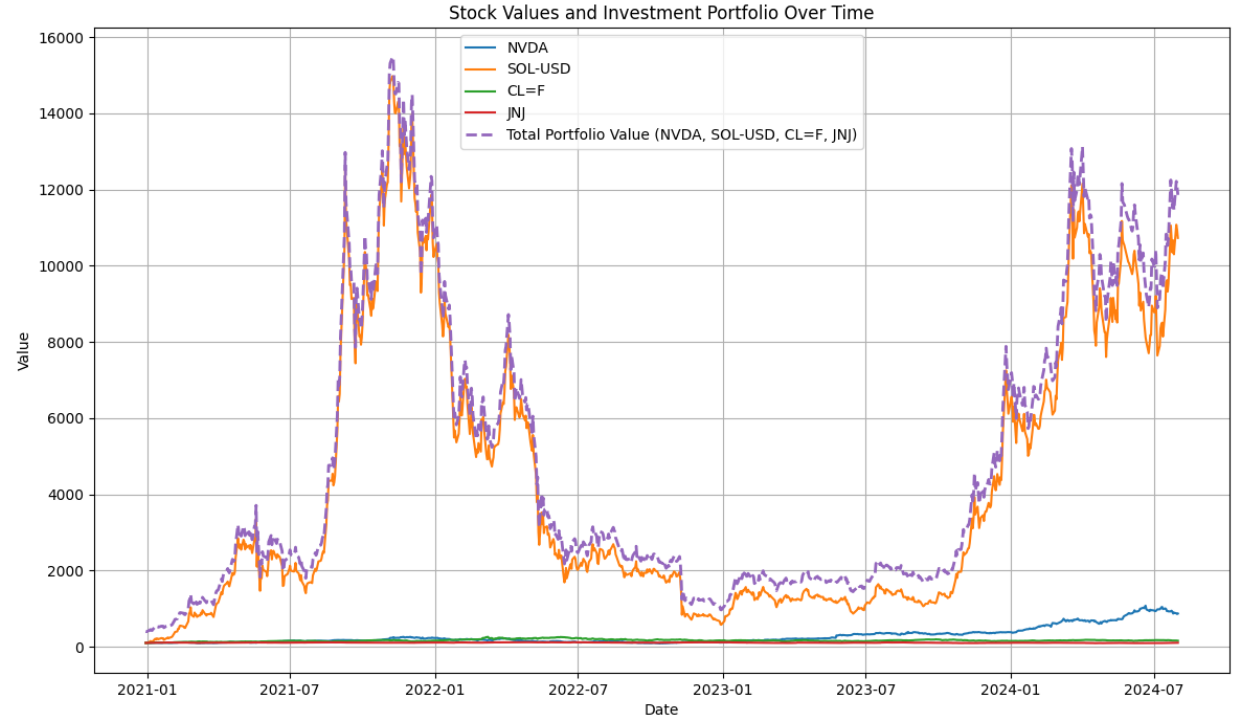
# Milyen trend volt 2020.04.10. és 2024.07.31. között?

- Mindegyik részvény növekvő trendet mutat.
- Az értékek normalizálva vannak, hogy a növekedés összehasonlítható legyen.



# Mennyit érne most a befektetés?

- Ha \$100-\$100-t fektettünk volna be 2021.01.01-jén?
  - NVDA: \$869,11
  - SOL-USD: \$10.727,00
  - CL=F: \$156,33
  - JNJ: \$103,30
  - Összesen: \$11.855,74



# Összefoglalás

- Vizsgált időszak: **2020.04.10. - 2024.07.31.**
- Kiválasztott pénzügyi eszközök (havi korreláció elemzés alapján, figyelembe véve a trendeket):
  - **NVIDIA, SOL-USD, CL=F, JNJ**
- 2021.01.01-i befektetés (\$100 eszközönként) jelenlegi értéke: **\$11.855,74**
- **Figyelem!**  
Ez a prezentáció tájékoztató jellegű. Nem minősül pénzügyi tanácsadásnak. Befektetési döntéseit saját felelősségére hozza meg, és konzultáljon pénzügyi tanácsadóval vagy szakértővel.