Portfolio allocation model

Các nghiên cứu lien quan đến phân bố stocks vào trong một portfolio để đạt được hiệu quả cao nhất

1. Allocation đều nhau theo ngành
2. Allocation theo tỉ trọng của cổ phiếu theo ngành
3. Allocation để đạt được beta bé nhất ?? Tối ưu

Theo dõi phân bố ủa Portfolio Stocks theo

* Cash/Stocks
* Bluechip, midcap, penny
* Ngành đầu tư
* Chiến lược
  + Value Investing
  + Trend following
  + Hybrid (Technical, fundamental, Quantitative Finance)
* Asset allocation

Trend following Market

Alpha seeking performance

Seeking the best performance

Beta

How low

Risk aversion

Premium /

Đặt tên theo chiến lược

Chiến lược làm gì ?

Cần một sản phẩm ấn tượng trước đã

Cần một chiến lược tiếp cận hay trước đã

Cần một người giỏi, biết dùng, dám thử nghiệm

Tự doanh, trading, quản lý quỹ