

AGH AMA-2-204-MF-s
Teoria Portfela i Zarządzanie Ryzykiem
- PROJEKT -
30 kwietnia 2017

Kartkę z treścią zadania projektowego wydrukuj oraz podpisz we wskazanym miejscu, pamiętaj o zaznaczeniu grupy. Twój podpis oznacza zaakceptowanie poniższej deklaracji.

- DEKLARACJA -

Ja, niżej podpisany/podpisana oświadczam, że przedłożony przeze mnie projekt jest wynikiem mojej samodzielnej pracy.

NAZWISKO i imię, numer indeksu: _____, grupa: CZW8 / PT11 / PT13

Kupno akcji wiąże się z posiadaniem rachunku maklerskiego. Wybierz bank, w którym otworzysz rachunek. Wybierz trzy notowane na Warszawskiej Giełdzie Papierów Wartościowych spółki oraz z dostępnych lokat, bądź obligacji Skarbu Państwa tę, która najlepiej będzie odpowiadała Twojej strategii inwestycyjnej.

W dniu swoich urodzin (chwila zero), w roku poprzedzającym ostatnią ich rocznicę inwestujesz $V(0) = 40\,000$ PLN. Przeprowadź analizę następujących strategii inwestycyjnych (każda trwa rok):

1. (4 pkt) Kwotę $V(0)$ inwestujesz w chwili zero po równo w rozważane walory i czekasz rok.
2. (3 pkt) Kwotę $V(0)$ inwestujesz w chwili zero po równo w rozważane walory i co tydzień dokonujesz zmian w portfelu, tak by wagi każdego z walorów były sobie równe.
3. (3 pkt) Kwotę $V(0)$ inwestujesz według opracowanej przez siebie strategii.

Zadbaj o to, by "być jak najbliżej rzeczywistości". Uwzględnij opłaty, prowizje, podatki. Obliczenia przeprowadź w MS Excel, pakiecie R, bądź w programie Mathematica.

Na koncie Dropbox utwórz katalog o nazwie GRIndeksImieNazwisko, gdzie $GR \in \{1, 2, 3\}$ i w nim umieść pliki związane z projektem:

- plik z obliczeniami, który nazwiesz IndeksImieNazwisko.*, przy czym rozszerzenie pliku zależy od wybranego do obliczeń programu,
- plik z raportem - opisem wyników i wnioskami w formacie pdf o nazwie IndeksImieNazwisko.pdf.

Nowoutworzony katalog Dropbox należy udostępnić, z opcją można edytować, prowadzącemu zajęcia (do 5 maja 2017), którego konto powiązane jest z adresem potorski@agh.edu.pl.

Pliki należy umieścić w nim dwa dni przed terminem obrony projektu.

Plik z raportem należy wydrukować i przynieść na obronę projektu. Nie jest konieczne drukowanie w kolorze. Do raportu należy dołączyć wydrukowaną kartkę z treścią zadania projektowego.

Tę część wypełnia osoba sprawdzająca pracę.

Data dostarczenia projektu	maja 2017
Data obrony projektu	12 maja 2017 / 18 maja 2017

Zadanie	1	2	3	Razem
Do zdobycia	4	3	3	10
Wynik				