

Финален проект

Изграждане и изпълнение на инвестиционна стратегия

Finance Academy 2025

Шаблон за предаване на курсов проект
“Изграждане и изпълнение на инвестиционна
стратегия”

Задача 1. За да започнете с изграждането на своята инвестиционна стратегия, моля, посочете каква сума ще бъде инвестирана първоначално, както и сумата, която ще заделяте месечно/годишно (ако има такава). Опишете подробно своите инвестиционни цели.

Отговор:

Задача 2. Какъв е времевият хоризонт на инвестицията?

Отговор:



Задача 3. Каква е очакваната доходност след пенсиониране?

Отговор:

Задача 4. Каква е търсената доходност преди пенсиониране?

Отговор:

Задача 5. В колко различни актива ще инвестирате и какво ще бъде разпределението по %?

Използвайте Portfolio Visualizer и изградете портфолио от различни активи (до 10 актива). Напишете името на всеки актив и опишете подробно защо е избран. В допълнение, приложете скрийншот.

Отговор и скрийншот:

Задача 6. Какво е нивото на max drawdown на портфолиото, за периода от последните 10 години до сега?

Скриншот:

Задача 7. Колко е Sharpe Ratio (съотношението на Шарп) на портфолиото, за периода от последните 10 години до сега?

Приложете скрийншот колко е Sharpe Ratio за избраното портфолио. Можете да намерите информацията в Portfolio Visualizer или да направите изчислението сами.

Скриншот:

Задача 8. Колко е Traynor Ratio (съотношението на Трейнър) на портфолиото, за периода от последните 10 години до сега?

Приложете скрийншот колко е Treynor Ratio за избраното портфолио. Можете да намерите информацията в Portfolio Visualizer или да направите изчислението сами.

Скриншот:

Задача 9. Как се е представило портфолиото в най-лошата и най-добра си година, в периода от последните 10 години до сега? Проверете каква може да е причината и се обосновайте.

Използвайки Portfolio Visualizer, проверете в коя година портфолиото от задача 5 е било с най-висока и най-ниска доходност. Направете скрийншот и оградете съответните години.

(Тази информация може да бъде намерена в таб "Annual Returns")

Отговор и скрийншот:



Задача 10. Кой от активите е донесъл най-голяма доходност през най-добрата година?

Приложете скрийншот от Portfolio Visualizer.

Скриншот:

Задача 11. Каква е корелацията между всички активи в портфолиото за периода от последните 10 години до сега?

Приложете скрийншот от Portfolio Visualizer.

Скриншот:

Указания и оценяване

Финалната оценка от обучение “Изграждане и изпълнение на инвестиционна стратегия” се формира от оценката от практическия проект описан по-горе.

Шаблон

Използвайте предоставения по-горе шаблон, за да попълните отговорите си на съответните места, маркирани с “**отговор**” или “**скрийншот**”. Проекти ще бъдат приемани единствено в този формат.

Финален срок за изпращане

Проектът трябва да бъде изпратен до **23:59** часа на **5-ти октомври** за редовната сесия или **23:59** на **26-ти октомври** за поправката.

Срок за проверка

В зависимост от натовареността и големината на проектите можете да очаквате оценки за финалните си проекти в срок между 2 и 4 календарни седмици от финалната дата на изпращане на проекта.

Точкова система

Задача	Максимален брой точки	Вашите точки
--------	-----------------------	--------------

1	10	
2	10	
3	10	
4	10	
5	10	
6	10	
7	10	
8	10	
9	10	
10	10	
11	10	
Общо	110	

Екипът на Finance Academy ви желае успех! 😊