

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?

Използвайте Portfolio Visualizer и изградете портфолио от различни активи. Опишете подробно защо сте избрали тези активи.

Отговор:

Задача 6. Какво ще бъде разпределението по %?

Приложете скрийншот от Portfolio Visualizer, където разпределението на активите е видимо.

Скриншот:

Задача 7. Как се е представило портфолиото в най-лошата си година в периода от 2003 - март 2024?

Използвайки Portfolio Visualizer, проверете в коя година портфолиото от задача 6 е било с най-ниска доходност. Потърсете каква е възможната причина. (Тази информация може да бъде намерена в таб "Annual Returns")

Отговор:

Задача 8. Колко е Sharpe Ratio (съотношението на Шарп) на портфолиото, за периода януари 2003 - март 2024?

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

Отговор:

Задача 9. Колко е Treynor Ratio (съотношението на Трейнър) на портфолиото, за периода януари 2003 - март 2024?

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

Отговор:

Задача 10. Коя е била най-добрата година за портфолиото и каква е била възвръщаемостта?



Отговор:

Задача 11. Какво е нивото на max drawdown на портфолиото, за периода януари 2003 – март 2024?

Отговор:

Задача 12. Кой от активите е донесъл най-голяма доходност през най-добрата година?

Приложете скрийншот от Portfolio Visualizer.

Скриншот:

Задача 13. Каква е корелацията между всички активи в портфолиото за периода януари 2003 - март 2024?

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 6-ти октомври** за редовната сесия или **23:59 на 27-ми 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	
12	10	
13	10	
Общо	130	

Екипът на Finance Academy ви желае успех! 😊