

ABSTRAKT

1. Stavba fundamentálnej investičnej stratégie

2. Matej Žofaj

3. 4. Bc., Financie, bankovníctvo a investovanie

4. doc. JUDr. Ing. Ján Šebo, PhD.

5.

- a) Cieľom tejto práce je vybudovanie fundamentálnej investičnej stratégie, ktorej podstatou je získanie čo najvyššej možnej hodnoty Alpha.
- b) Prostredníctvom odborných štúdií, článkov a knižných publikácií zostaviť fundamentálnu investičnú stratégiu na základe fundamentálnych ukazovateľov a pravidiel, ktoré sú v týchto publikáciách spracované. Následne tieto ukazovatele, pravidlá a myšlienky aplikovať v prostredí web portálu Portfolio123 a vyhodnotenie na základe backtestov.
- c) Na základe prevzatých fundamentálnych pravidiel a myšlienok v práci uvedených publikácií a zdrojov sme zostrojili spolu päť stratégií, ktoré zaznamenali postupný progres nadobudnutia vyššej hodnoty Alpha, výkonnosti a ostatných hodnotených ukazovateľov stratégie. Finálna stratégia, pri technických fundamentálnych nastaveniach v prostredí Portfolio123, dosahovala za obdobie viac ako 16 rokov hodnotu Alpha 30,63 %.

6. fundamenty, stratégia, akcie, screening akcií, investovanie