

Abstrakt práce

Konštrukcia investičného portfólia jednotlivca

Veronika Líšková

1. ročník Ing. FBI

Konzultant: Ing. Michal Mešťan

Obsah

a) cieľ riešenia

Cieľom práce je, s využitím poznatkov z oblasti optimalizácie, skonštruovať také investičné portfólio pre jednotlivcov na Slovensku, ktoré dosiahne vyššie zhodnotenie investície ako v prípade investovania do benchmarku.

b) obsah riešenia:

Pomocou Markowitzovej teórie portfólia vytvoriť optimálne portfólio na vybranom počte ETF pri jednoročnom a trojročnom znovunastavení váh/podielov v ETF a sledovaní vybraných ukazovateľov finančnej praxe.

c) dosiahnuté výsledky:

Pri jednorazovom investovaní nami vytvorené portfólia vždy prekonalí výkonnosť benchmarku. Avšak pri jednoročnom rebalansovaní a pravidelnom sporení zaznamenal lepšie výsledky referenčný nástroj. Priemerný analizovaný výnos bol vyšší v prípade rebalansovania portfólia na trojročnej báze než nad jednoročnej.

6. Kľúčové slová: Optimálne portfólio, ETF, rebalansovanie, Markowitzova teória portfólia