

Abstrakt práce

1. Optimalizácia fundamentálnej obchodnej stratégie

2. Bc. Matej Žofaj

3. 2. ročník, 2. stupeň, Financie, bankovníctvo a investovanie

4. Ing. Michal Mešťan

5. Obsah (rozsah 25 riadkov)

a) cieľ riešenia

Cieľom práce je optimalizovať a doplniť fundamentálne pravidlá, podľa výskumu Eugene F. Fama a Kenneth R. French, tak aby zvyšovali výkonnosť stratégie. Parciálnym cieľom práce je skúmanie vplyvu optimalizácie a doplnených pravidiel na moment časového obstarania akcie do portfólia.

b) Obsah riešenia

Optimalizácia a programovanie doplnených fundamentálnych pravidiel a ich vplyv na výkonnosť fundamentálnej obchodnej stratégie.

b) dosiahnuté výsledky:

Prostredníctvom dodatočných fundamentálnych pravidiel implantovaných do vybranej fundamentálnej obchodnej stratégie sme zvýšili celkovú výkonnosť stratégie, ktorej prehodnotenie prebieha raz do mesiaca. Dodatočné fundamentálne pravidlá nevplyvajú na časovanie nákupu akcií do portfólia.

6. Kľúčové slová: fundamentálna obchodná stratégia, optimalizácia, stock screening strategies, výkonnosť akciového portfólia,