

Abstrakt práce

1. Téma práce : Riadenie portfólia obchodných systémov
2. Meno autora: Peter Kubaška
3. Ročník a odbor štúdia: 5. ročník, Financie bankovníctvo a investovanie
4. Konzultant/vedúci práce: doc. Ing. Vladimír Úradníček, Ph.D.
5. Obsah:

Cieľom práce je zaoberať sa práve aktívnym prístupom k riadeniu portfólia obchodných systémov a pokúsiť sa navrhnúť vlastný koncept s dôrazom na limitovanie rizík vyplývajúcich z investovania do portfólia viacerých obchodných systémov. Výsledkom práce je zavedenie tzv. „Ideálnej Equity Curve (IEC)“, ktorej hlavnou úlohou je identifikovať potenciálne problémové obchodné systémy a tým ochrániť investorský kapitál. Aplikovaním len samotnej IEC sme aktívne riadili portfólio obchodných systémov. Tento systém sa však ukázal pri porovnaní s pasívnym prístupom (benchmarkom) ako nevhodný najmä pri použití množiny výrazne rastových EC, z dôvodu, že stratégia až príliš dlhú dobu držala prostriedky v hotovosti. Z pohľadu investora je tak najvhodnejšie používať kombináciu aktívneho a pasívneho prístupu, založeného na využití toho prístupu, ktorý je momentálne pre investora výhodnejší.

6. Klúčové slová: obchodný systém, riadenie portfólia obchodného systému, diverzifikácia