

Lista 1

Efektywność i ryzyko na podstawie miar klasycznych

Zadanie 1. Na podstawie zebranych danych oblicz:

- Tygodniowe, miesięczne i roczne proste stopy zwrotu
- Średnią tygodniową, miesięczną i roczną stopę zwrotu.
- Oceń, w którym okresie Twoja inwestycja była bardziej efektywna (weź pod uwagę okres 1-5 lat).

Zadanie 2. Na podstawie tygodniowych stóp zwrotu:

- oblicz podstawowe statystyki opisowe badanej zmiennej. Zinterpretuj uzyskane wyniki.
- Narysuj wykres pudełkowy i histogram badanej cechy.

Zadanie 3. Na podstawie danych tygodniowych wyznacz:

- Tygodniowe premie za ryzyko oraz dodatkowe stopy zwrotu

i na ich podstawie wyznacz:

- Betę inwestycji i zinterpretuj uzyskany wynik;
- Klasyczne miary efektywności i ryzyka dla Twojej inwestycji oraz dla rynku, na którym inwestujesz. Zinterpretuj wyniki i oceń ryzyko i efektywność Twojej inwestycji w relacji do rynku.
- W którym oknie czasowym inwestycje są najbardziej efektywne?