

STRATEGIE INWESTYCYJNE

Inwestycje Kapitałowe - Alokacja Aktywów - akcje - instrumenty pochodne - obligacje...

Poniższe opracowanie stanowi prawdopodobnie najszerszą analizę strategii alokacji aktywów oraz strategii inwestycyjnych dostępną bezpłatnie w polskim internecie. Materiał ten jest kompleksową analizą strategii agresywnych, zrównoważonych oraz defensywnych stosowanych powszechnie na rynku kapitałowym. Znajdą w nim Państwo zarówno opisy strategii stosowanych przez wyspecjalizowane instytucje, takie jak fundusze hedge, jak również opisy strategii stosowanych z powodzeniem przez inwestorów indywidualnych.

Strategie agresywne

Strategie agresywne należą do grupy strategii charakteryzujących się występowaniem dotkliwych poziomów obsunięcia kapitału oraz oczekiwaną stopą zwrotu znacząco przekraczającą poziom tzw. stopy wolnej od ryzyka, reprezentowanej przeważnie przez poziom rentowności długoterminowych instrumentów dłużnych gwarantowanych przez skarb państwa. Jak widać poniżej strategie te mogą zostać oparte o różnorakie instrumenty i bazować na odrębnych podstawach ideowych. W wielu przypadkach zaszeregowanie danej strategii do grupy strategii agresywnych jest jednak zależne od poziomu zaangażowania jakie ona zakłada, co jest równoznaczne ze stwierdzeniem, że taka strategia mogłaby być z powodzeniem zakwalifikowana do strategii pośrednich (zrównoważonych) przy zastosowaniu identycznych wyznaczników strategii, z wyjątkiem poziomu zaangażowania w dane instrumenty... zapoznaj się z pełną treścią publikacji

Analiza strategii agresywnych zawiera:

- Szczegółowy opis poszczególnych strategii
- Analizę podstawowych wad i zalet poszczególnych podejść
- Omówienie wymogów stawianych przez poszczególne strategie
- Zestawienie głównych zagrożeń napotykanych w procesie inwestycyjnym

Strategie zrównoważone (pośrednie)

Strategie pośrednie niekiedy określane również mianem zrównoważonych, to grupa strategii w których akcenty rozkładane są zarówno na zarządzanie poziomem ryzyka i poziomem maksymalnego obsunięcia kapitału od szczytu, jak i na maksymalizację rentowności jaka możliwa jest w granicach wyznaczonych przez założenia odnoszące się do maksymalnego akceptowanego poziomu ryzyka. Strategie te stanowią cenną alternatywę dla inwestora z długoterminowym podejściem do procesu inwestycyjnego gdyż dobrze sprawdzają się w okresach, w których inwestor może zaobserwować pełny cykl gospodarczy zawierający zarówno hossę, jaki i bessa. Główną zaletą tej grupy jest widoczne wygładzenie linii kapitału portfela w stosunku do portfeli agresywnych, poziomy przyjmowanego ryzyka umożliwiające przetrwanie złych okresów koniunktury oraz stosunkowo wysoki potencjał do osiągnięcia „rozsądnych” długoterminowych stóp zwrotu. Strategie tego typu rzadko również wymagają stosowania dźwigni finansowej... zapoznaj się z pełną treścią publikacji

Analiza strategii zrównoważonych zawiera:

- Szczegółowy opis poszczególnych strategii
- Analizę podstawowych wad i zalet poszczególnych podejść
- Omówienie wymogów stawianych przez poszczególne strategie
- Zestawienie głównych zagrożeń napotykanych w procesie inwestycyjnym

Strategie defensywne

Istnieje wiele strategii o charakterze defensywnym jednak nawet ten typ strategii nie eliminuje całkowicie ryzyka jakie zawsze jest związane z różnymi metodami alokacji posiadanych aktywów. Strategie te charakteryzują się natomiast najniższym ryzykiem oraz nie stawiają za cel maksymalizacji poziomu rentowności. Ideą przyświecającą tego typu strategiom jest zachowanie realnej wartości kapitału oraz wypracowanie umiarkowanych zysków przy zachowaniu niskiego poziomu ryzyka. Należy jednak pamiętać, że nie istnieją instrumenty wolne od ryzyka, nawet instrumenty gwarantowane

przez skarb państwa, czy posiadające zabezpieczenie na nieruchomościach są obarczone pewnym poziomem ryzyka, które inwestor powinien przeanalizować przed podjęciem decyzji inwestycyjnej... zapoznaj się z pełną treścią publikacji

Analiza strategii defensywnych zawiera:

- Szczegółowy opis poszczególnych strategii
- Analizę podstawowych wad i zalet poszczególnych podejść
- Omówienie wymogów stawianych przez poszczególne strategie
- Zestawienie głównych zagrożeń napotykanym w procesie inwestycyjnym