

Datum	Kurz	Česká pojišťovna
3/22/2004	379.00	
3/21/2004	371.80	
3/20/2004	378.70	
3/19/2004	381.30	
3/18/2004	389.00	
3/15/2004	389.80	
3/14/2004	388.90	
3/13/2004	386.90	
3/12/2004	381.00	
3/11/2004	383.70	
3/8/2004	386.10	

Datum	Kurz	Komerční banka
3/22/2004	1549.00	
3/21/2004	1429.00	
3/20/2004	1435.00	
3/19/2004	1418.00	
3/18/2004	1433.00	
3/15/2004	1430.00	
3/14/2004	1424.00	
3/13/2004	1415.00	
3/12/2004	1421.00	
3/11/2004	1437.00	
3/8/2004	1450.00	

Datum	Kurz	Česká spořitelna
3/22/2004	1650.00	
3/21/2004	1600.00	
3/20/2004	1600.00	
3/19/2004	1630.00	
3/18/2004	1600.00	
3/15/2004	1610.00	
3/14/2004	1600.00	
3/13/2004	1600.00	
3/12/2004	1639.00	
3/11/2004	1639.00	
3/8/2004	1639.00	

1) Vypočítejte podíly CP v portfoliu, jestliže chceme očekávanou výnosnost ve výši 6% při minimálním riziku. Sell short je povolen. (mohou vyjít i záporné váhy v daném portfoliu)

