

Úloha 1: Na kterém trhu nejvýhodněji investujeme. Nejmenší riziko, největší výnos.

Trh	CP	σ_i	$\rho_{A,B}$	
I	A	0.263		0.21
	B	0.128	0.215	0.18
II	A	0.294		0.26
	B	0.196	-0.706	0.14
III	A	0.200		0.19
	B	0.380	0.109	0.23

Úloha 2:

	<u>CP 1</u>	<u>CP2</u>	<u>CP3</u>	<u>Kovariance</u>	
r_i	0.268	0.193	0.326	$\sigma_{1,2}$	0.143
σ	0.298	0.325	1.156	$\sigma_{1,3}$	-0.265
				$\sigma_{2,3}$	0.314

Výnosnost portfolia volte 5%

Úloha 3:

Emise	CP1	CP2	CP3	CP4	CP5	CP6
CP1	80.5	82.7	85.3	85.1	123.9	22
CP2		184.7	131.5	69.4	49.5	58
CP3			374.2	384.5	366.5	103.8
CP4				684.8	599.1	51.6
CP5					871.4	-21.2
CP6						89.7
CP7						

1. Vypočítejte podíly cenných papírů v portfoliu, je-li povolen sell short, při minimalizaci rizika
2. Očekávaná výnosnost portfolia nechť je 5%

Úloha 4

Cenný papír	Oček. výnos	Riziko
	R_i	sigma i
C ₁	0.05	0.18
C ₂	0.04	0.12

1. **úloha:** Sestavte portfolio a určete podíly CP tak, aby výnos portfolia byl **0,06** (6%).
2. **úloha:** Pro takto stanovené portfolio vypočítejte riziko, jestliže koeficient korelace mez

CP7	ri %
3.5	1.9
-9.9	6.1
343.5	2.9
502.7	4
520.4	5.7
74.4	3.4
574.6	4.9

a

ti cennými papíry bude **0,4**.