

CVIČENÍ 4a

1.

	ČEZ	Philip Moris	Unipetrol
25.3.2005	420.41	19285	142
24.3.2005	409.35	18818	140
23.3.2005	395.82	18046	133.11
22.3.2005	392.37	17701	134.59
21.3.2005	378.73	17346	126.3
18.3.2005	395.28	17893	133.85
17.3.2005	399.7	17838	126.92
16.3.2005	410.13	17749	138.25
15.3.2005	438.63	18925	156.2
14.3.2005	448.49	19040	171.19
11.3.2005	466.06	18456	211.8
10.3.2005	459.18	18763	207.5
9.3.2005	449.01	18821	200.8
8.3.2005	444.23	18751	187.5
7.3.2005	437.14	18756	184.68
4.3.2005	423.08	18700	180.18
3.3.2005	420.82	18725	186.5
2.3.2005	428.28	19571	183.8
1.3.2005	430.08	19362	187.05
28.2.2005	428.81	19345	180.54
25.2.2005	416.41	18965	170.4
24.2.2005	413.46	18935	169.35
23.2.2005	420.47	18791	168.39
22.2.2005	412.83	18631	175.44
21.2.2005	399.72	18530	152.35
18.2.2005	393.59	18886	140.2
17.2.2005	384.54	18855	137.14
16.2.2005	387.68	18820	136.54
15.2.2005	388.74	18868	133.31
14.2.2005	388.56	18951	128.3
11.2.2005	385.81	19376	125.85
10.2.2005	375.89	19714	120.79
9.2.2005	368.69	19942	124.69
8.2.2005	366.69	19916	124.49
7.2.2005	361.28	19655	123.55
4.2.2005	354.17	18996	121.24
3.2.2005	351.92	19138	126.7
2.2.2005	351.02	18801	127.44
1.2.2005	349.62	18806	127.49
31.1.2005	351.48	18416	130.99
28.1.2005	354	18420	126.84
27.1.2005	353.41	18105	122.3
26.1.2005	354.54	17806	121.8
25.1.2005	354.21	17490	124.94
24.1.2005	346.68	17551	117.39
21.1.2005	347.43	17549	109.72
20.1.2005	347.51	17448	103.34

19.1.2005	353.38	17564	102.94
18.1.2005	355.43	17991	102.54

Úloha:

1. Vypočítat jednodenní a dvoudenní výnosnosti CP
2. Určit kovariance a riziko změny výnosnosti CP
3. Vypočítat jednodenní, dvoudenní výnosnost portfolia a podíly CP v p
4. R_f 0.034

KB

1175.2
1170.1
1145
1147.6
1117.4
1137.7
1131.7
1143.4
1214.1
1220.1
1255.8
1262.7
1250.1
1240.9
1250.4
1217.6
1205.1
1211.3
1212.9
1199.9
1187.9
1171.9
1174
1176.6
1161.2
1147.9
1139.7
1148.6
1142.4
1141.6
1135.6
1118
1121.1
1118.1
1108.8
1105.3
1106.7
1102.7
1106.6
1096.2
1102.2
1094.2
1098.3
1094.4
1063.2
1056.2
1053.3

1061.1
1068.5

ortfoliu (sell short je povolen)

CVIČENÍ 4a

1.

	ČEZ	Philip Moris	Unipetrol
25.3.2005	420.41	19285	142
24.3.2005	409.35	18818	140
23.3.2005	395.82	18046	133.11
22.3.2005	392.37	17701	134.59
21.3.2005	378.73	17346	126.3
18.3.2005	395.28	17893	133.85
17.3.2005	399.7	17838	126.92
16.3.2005	410.13	17749	138.25
15.3.2005	438.63	18925	156.2
14.3.2005	448.49	19040	171.19
11.3.2005	466.06	18456	211.8
10.3.2005	459.18	18763	207.5
9.3.2005	449.01	18821	200.8
8.3.2005	444.23	18751	187.5
7.3.2005	437.14	18756	184.68
4.3.2005	423.08	18700	180.18
3.3.2005	420.82	18725	186.5
2.3.2005	428.28	19571	183.8
1.3.2005	430.08	19362	187.05
28.2.2005	428.81	19345	180.54
25.2.2005	416.41	18965	170.4
24.2.2005	413.46	18935	169.35
23.2.2005	420.47	18791	168.39
22.2.2005	412.83	18631	175.44
21.2.2005	399.72	18530	152.35
18.2.2005	393.59	18886	140.2
17.2.2005	384.54	18855	137.14
16.2.2005	387.68	18820	136.54
15.2.2005	388.74	18868	133.31
14.2.2005	388.56	18951	128.3
11.2.2005	385.81	19376	125.85
10.2.2005	375.89	19714	120.79
9.2.2005	368.69	19942	124.69
8.2.2005	366.69	19916	124.49
7.2.2005	361.28	19655	123.55
4.2.2005	354.17	18996	121.24
3.2.2005	351.92	19138	126.7
2.2.2005	351.02	18801	127.44
1.2.2005	349.62	18806	127.49
31.1.2005	351.48	18416	130.99
28.1.2005	354	18420	126.84
27.1.2005	353.41	18105	122.3
26.1.2005	354.54	17806	121.8
25.1.2005	354.21	17490	124.94
24.1.2005	346.68	17551	117.39
21.1.2005	347.43	17549	109.72
20.1.2005	347.51	17448	103.34

19.1.2005	353.38	17564	102.94
18.1.2005	355.43	17991	102.54

Úloha:

1. Vypočítat jednodenní a dvoudenní výnosnosti CP
2. Určit kovariance a riziko změny výnosnosti CP
3. Vypočítat jednodenní, dvoudenní výnosnost portfolia a podíly CP v p
4. R_f 0.034

KB

1175.2
1170.1
1145
1147.6
1117.4
1137.7
1131.7
1143.4
1214.1
1220.1
1255.8
1262.7
1250.1
1240.9
1250.4
1217.6
1205.1
1211.3
1212.9
1199.9
1187.9
1171.9
1174
1176.6
1161.2
1147.9
1139.7
1148.6
1142.4
1141.6
1135.6
1118
1121.1
1118.1
1108.8
1105.3
1106.7
1102.7
1106.6
1096.2
1102.2
1094.2
1098.3
1094.4
1063.2
1056.2
1053.3

1061.1
1068.5

ortfoliu (sell short je povolen)