

Cvičení 1

Příklad 1

Kurzy akcií pro hypotetické kurzovní lístky			
<i>Obchodní den na burze</i>	<i>Kurzy akcií jednotlivých firem</i>		
	F1	F2	F3
1.	100	200	1000
2.	110	210	1050
3.	121	205	1080
4.	95	150	1020
5.	98	210	950

Hypotetický kurzovní lístek			
<i>Obchodní den na burze (v praxi je uveden datum obchodního dne)</i>	<i>Kurzy akcií</i>		
	F1	F2	F3
1.			
:	:	:	:
5.			
<i>Očekávaný jednodenní výnos akcie</i>			
<i>Riziko změny jednodenního výnosu akcie</i>			

Hypotetický kurzovní lístek			
<i>Obchodní den na burze (v praxi je uveden datum obchodního dne)</i>	<i>Kurzy akcií jednotlivých firem</i>		
	F1	F2	F3
1.			
:	:	:	:
5.			
<i>Očekávaný dvoudenní výnos akcie</i>			
<i>Riziko změny dvoudenního výnosu akcie</i>			

Vypočítejte jednodenní a dvoudenní výnosnosti jednotlivých akcií a riziko jejich změn

Příklad 2

Kurzy vybraných akcií na počátku čtvrtletí

Emise	R o k							
	2007				2008			
	I.	II.	III.	IV.	I.	II.	III.	IV.
A	1010	1055	1100	1031	988	1065	918	1060
B	2650	3000	3848	3228	3638	4205	3979	4731
C	1505	2030	2190	2325	2250	2443	1700	1796
D	178	300	325	396	351	370	335	327
E	281	372	358	494	460	539	443	468
F	2645	3125	3400	3330	3400	3425	3475	4100
G	547	800	803	1070	975	952	997	944

Vypočítejte výnosnosti jednotlivých akcií za jednotlivá čtvrtletí, riziko změny výnosnosti a střední hodnotu a riziko změny jejich výnosností za dva roky. Vypočítejte kovarianční a korelační matici.

Příklad 3

Pro jednodenní výnosnosti a měsíční výnosnosti spočítejte:

1. střední hodnotu, rozptyl a směrodatnou odchylku pro všechny akcie obchodované ve SPADu k dnešnímu dni.
2. střední hodnotu, výběrový rozptyl a výběrovou směrodatnou odchylku za poslední týden (pondělí až pátek) pro všechny akcie obchodované ve SPADu k dnešnímu dni.
3. kovarianční i korelační matici pro všechny akcie obchodované ve SPADu a pro index PX za posledních 6 měsíců (případně za poslední rok)