

Cvičení 3

Vypočítejte očekávanou výnosnost a riziko portfolia, které je složeno z:

1. akcií ERSTE, KB a VIG v podílech 35%, 35% a 30%. Použijte jednodenní výnosnosti za poslední rok. Jak by se spočtené hodnoty změnilly, kdyby se podíly akcií v portfoliu vyrovnaly, tj. každá akcie by měla stejný podíl v portfoliu? Jak by se spočtené hodnoty změnilly, pokud bychom předpokládali, že výnosnosti daných akcií jsou navzájem nezávislé?
2. akcií AAA, ORCO, PEGAS, PHILIP MORRIS a UNIPETROL v podílech 25%, 5%, 25%, 30% a 15%. Použijte týdenní výnosnosti za poslední 3 měsíce. Jak by se spočtené hodnoty změnilly, kdyby se podíly akcií v portfoliu vyrovnaly, tj. každá akcie by měla stejný podíl v portfoliu? Jak by se spočtené hodnoty změnilly, pokud bychom předpokládali, že výnosnosti daných akcií jsou navzájem nezávislé?