

Povinnosti k úspěšnému absolvování kurzu Teorie portfolia

1. 2 Kontrolní testy (v průměru 60%), viz první přednáška.
2. Data z Terminálu Bloomberg – učebna VT4.

Bloomberg:

Maximální rozsah 1-2 A4. Student si vybere 3 libovolné akcie (jiný trh než PSE) a vypočítá jednodenní výnosnosti za jeden měsíc. Stanoví riziko jednotlivých cenných papírů a vytvoří covar a correl matici. Důležité – přiložit k práci kopii stránky Bloomberg pomocí PRTSCR.

Deadline: 1.5.2013.