

Test 1

Distanční forma testu - PMF_TEPO

29.03.2021

1. V příloženém excelovém dokumentu máte na listu č. 1 (Pr01) uzavírací ceny pěti společností. Vypočítejte očekávanou výnosnost každé ze společností a její riziko. Dále vytvořte korelační matici. Následně uvažujte portfolio, které má stejné váhové zastoupení každé z uvažovaných akcií. U portfolio stanovte výnos a riziko.
2. Uvažujte modelový scénář založený na expertních odhadech. Na listu č. 2 (Pr02) máte tabulku s očekávanými budoucími cenami a pravděpodobnostmi. Stanovte, jaká je očekávaná cena dané akcie a její riziko, pokud současná cena je 65,--.
3. Na třetím listu (Pr03) máte k dispozici kovarianční matici sedmi akcií (žluto-oranžová barva) a vektor výnosností – poslední sloupec (modrá barva). Stanovte váhy pro portfolio, které bude mít očekávanou výnosnost 1,4 % a dále vypočítejte riziko tohoto portfolio.