

Cvičení 3

1. Mějme bezrizikové aktivum s výnosností $r_f = 3,5\%$ a portfolia umístěná na efektivní množině. Sestrojte graf umístění jednotlivých portfolií, jestliže budeme měnit podíly investování do bezrizikového aktiva a rizikového portfolia.

Riziková portfolia	A	B	C	D
\bar{r}_p	6,2%	4%	7,5%	8,4%
σ_p	14,5%	9,7%	17%	20%

U všech portfolií budeme volit podíly (váhy) takto:

	1.	2.	3.	4.	5.
r_f	0,20	0,40	0,50	0,60	0,80
Portfolio	0,80	0,60	0,50	0,40	0,20