

Zadání: Investor vybral 4 tituly akcií A, B, C, D, kam chce investovat 1 mil. Kč. Z časových řad cen zjistil tyto údaje:

	A	B	C	D
Průměry:	0,0660	0,0320	0,1030	0,0070

Kovarianční matice:	0,0600	0,0070	0,0170	0,0080
	0,0070	0,0050	0,0050	0,0013
	0,0170	0,0050	0,0360	0,0032
	0,0080	0,0013	0,0032	0,0080

- Pomocí Excel-Řešitel a Markowitzova modelu nalezněte optimální portfolio, tj. kolik peněz se má investovat do nákupu jednotlivých titulů, aby byl zajištěn výnos alespoň 0,08 (tj. 8%) a přitom riziko bylo minimální. Riziko zde uvažujte jako směrodatnou odchylku.
- Pomocí Excel-Řešitel a Sharpeho modelu nalezněte optimální portfolio, tj. kolik peněz se má investovat do nákupu jednotlivých titulů, aby byl zajištěn maximální výnos a přitom riziko bylo nejvýše 0,12 (tj. 12%).