

Tvorba portfólia je častou a dôležitou úlohou vo finančnom sektore. V práci predstavujeme jeden z matematických modelov, ktorý túto úlohu pomáha riešiť. Predpokladmi modelu sú logaritmická úžitková funkcia a ergodická stacionarita sledovaného trhu. Ide o nízky počet predpokladov, preto je model celkom jednoduchý a prehľadný. V práci sa venujeme popisu modelu a dokázaniu vlastností zameraných najmä na jeho použitie. Rozoberáme prípad známej distribúcie trhu a ponúkame návod k získaniu portfólia. Venujeme sa aj prípadu neznámej distribúcie trhu, kde ponúkame jeden z možných postupov. Pomocou empirickej distribúcie sme schopní získať asymptoticky žiadaný výsledok. Práca je zakončená simulovanou aplikáciou na reálne hodnoty. Skúmame v nej správanie pri použití postupu s empirickou distribúciou na kratších časových úsekoch.