

Název práce: Markowitzův model s omezeními

Autor: Jan Němec

Katedra (ústav): Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí bakalářské práce: doc. RNDr. Petr Lachout, CSc.

Abstrakt: Sestavení optimálního portfolia z dostupných obchodovatelných komodit je velmi často diskutovanou otázkou. Jedním z modelů, který uvažuje nejenom výnos portfolia, ale také jeho rizikovost, je Markowitzův model. Bakalářská práce bude uvažovat tento přístup v případech, když je hledané portfolio svázáno dalšími omezeními. Přednostně se práce bude zabývat omezeními, která jsou dána legislativou pro chování různých bankovních subjektů investujících na burzovním trhu.

Klíčová slova: Markowitzův model, omezení na tvorbu portfolia, bankovní regulace