

Název práce: Chování portfolií na efektivních a neefektivních trzích

Autor: Iveta Kováčová

Katedra: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí diplomové práce: Doc. RNDr. Jan Hurt, CSc., KPMS MFF UK

Abstrakt: V předložené práci shrneme výsledky týkající se konstrukce optimálních portfolií. Představíme geometrickou reprezentaci portfolií v případě porušení předpokladů o efektivním trhu. Předvedeme technickou analýzu portfolia na konkrétních datech pomocí programu Mathematica 8.0 a porovnáme eficientní množinu portfolia při různých strategiích investování.