

Errata k diplomovej práci: Robustnosť Markowitzových portfólií.

1. Str. 7, na začiatku dôkazu vety 3 chýba poznámka, že bez ujmy na obecnosti si zvolíme $j := 1$.
2. Str. 14, v dôkaze ekvivalentnosti úloh (3.6) a 3.7 chýba predpoklad, že matica Σ je pozitívne definitná.
3. Str. 14 resp. str. 15, v úlohe (3.8) resp. (3.9) miesto množiny Σ_μ uvažujeme množinu Θ_μ .
4. Str. 14, v poznámke pod čiarou značenie $A \preceq B$ symbolizuje, že matica $B - A$ je pozitívne semidefinitná.
5. Str. 15, 1. riadok: miesto $x^\top(\Sigma - \bar{\Sigma})x \geq 0$ platí: $x^\top(\bar{\Sigma} - \Sigma)x \geq 0$.
6. Str. 16, 4. riadok: miesto výrazu:

$$\max_{\lambda \in \Lambda} \min_{\alpha \in \mathbb{R}} \left\{ \alpha + \frac{1}{1 - \beta} \int_{\mathbf{r} \in \mathbb{R}} [-x^\top \mathbf{r} - \alpha]^+ \sum_{l=1}^L \lambda_l p(\cdot)_l(\mathbf{r}) d\mathbf{r} \right\}$$

uvažujeme:

$$\max_{\lambda \in \Lambda} \min_{\alpha \in \mathbb{R}} \left\{ \alpha + \frac{1}{1 - \beta} \int_{\mathbf{r} \in \mathbb{R}} [-x^\top \mathbf{r} - \alpha]^+ \sum_{l=1}^L \lambda_l p(\mathbf{r})_l d\mathbf{r} \right\}.$$

7. Str. 16, posledný minimaxový vzorec na 11. riadku má byť v tvare:

$$\min_{(x, \alpha) \in \mathcal{X} \times \mathbb{R}} \max_{l \in \mathcal{L}} F_\beta^l(x, \alpha).$$

8. Str. 21, vzorec (4.2) resp. (4.3) má mať tvar:

$$\bar{\beta} = \hat{\beta}(1 + \varepsilon\delta), \quad \text{resp.} \quad \bar{\beta} = \hat{\beta} + \varepsilon\delta\Delta.$$

9. V Tabuľkách (4.1) - (4.3) a v popise Obr. (4.1), Obr. (4.2) má byť parameter k nahradený parametrom δ .