

Diplomová práce se zabývá modely pro volbu optimálního portfolia. Oproti klasickému přístupu použití střední hodnoty výnosu portfolia a míry rizika portfolia jako kritérií zahrnujeme mezi kritéria také šikmost. Dále jsou formulovány modely, které měří eficienci portfolia definovanou jako vzdálenost portfolia od Paretovy eficientní hranice. Součástí práce je aplikace modelů na finanční data titulů vyskytujících se v burzovním indexu NASDAQ-100 elektronické burzy NASDAQ. Závěr práce obsahuje vzájemné porovnání optimálních portfolií použitých modelů, a také porovnání s triviálními portfolii a samotným indexem NASDAQ-100.