

Projekt – zadanie 3

Termin prezentacji/oddania: 9.05.2023

Dla stóp zwrotu z (co najmniej) dwóch wybranych zmiennych ryzyka (np. z poprzedniego zadania):

1. Wyestymuj średnie, odchylenia standardowe i korelacje oraz:
 - a. Oblicz stopę zwrotu i ryzyko portfela z rzeczywistymi wagami (ustalonymi np. tak, jak w poprzednim zadaniu).
 - b. Narysuj możliwe portfele, czyli wykres punktów (σ_p , $E(R_p)$) dla różnych wag.
 - c. Znajdź portfel o minimalnym ryzyku.
 - d. Znajdź portfel o minimalnym ryzyku przy ustalonej stopie zwrotu.
 - e. Znajdź portfel rynkowy.
2. Wyestymuj parametry modelu jednowskaźnikowego
 - a. Zinterpretuj wyniki (ryzyko systemowe, wrażliwość, ...)
 - b. Powtórz zadania z pkt. 1
 - c. Porównaj wyniki z pkt. 1